

BlackRock®

Jahresbericht und geprüfter Jahresabschluss

BlackRock Strategic Funds (BSF)

Handelsregister Luxemburg: B 127481

Für das zum 31. Mai 2022 endende Geschäftsjahr

Inhaltsverzeichnis

| | |
|--|------------|
| Allgemeine Informationen | 2 |
| Schreiben der Vorsitzenden des Verwaltungsrats an die Anteilinhaber | 5 |
| Bericht des Anlageberaters | 7 |
| Bericht des Verwaltungsrats | 13 |
| Vergütungsbericht (ungeprüft) | 17 |
| Zusammensetzung des Nettofondsvermögens | 21 |
| Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre | 30 |
| Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen | 41 |
| Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile | 50 |
| Vermögensaufstellung | 61 |
| BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund | 61 |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | 189 |
| BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund | 192 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | 242 |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | 247 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | 252 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | 256 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | 263 |
| BlackRock ESG Euro Bond Fund | 268 |
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund | 282 |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund | 291 |
| BlackRock European Absolute Return Fund | 299 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | 304 |
| BlackRock European Select Strategies Fund | 308 |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | 328 |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund | 329 |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund | 341 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | 372 |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | 403 |
| BlackRock Global Event Driven Fund | 406 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | 415 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | 421 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | 423 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | 425 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | 427 |
| BlackRock Style Advantage Fund | 429 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | 477 |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund | 483 |
| BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund | 490 |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | 598 |
| Anmerkungen zum Jahresabschluss | 602 |
| Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers | 624 |
| Anhang I – Anteilklassen (ungeprüft) | 627 |
| Anhang II – Globales Marktrisiko (ungeprüft) | 630 |
| Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) | 633 |

Anteilszeichnungen erfolgen ausschließlich auf der Basis des aktuellen Verkaufsprospekts und der wesentlichen Anlegerinformationen (KIID), ergänzt durch den letzten geprüften Jahres- und ungeprüften Halbjahresbericht, sofern Letzterer jüngeren Datums als der Jahresbericht und der geprüfte Abschluss ist. Entsprechende Exemplare stehen am Geschäftssitz der BlackRock Strategic Funds (die „Gesellschaft“) zur Verfügung und können beim Investor Servicing Team vor Ort, bei der Übertragungsstelle, bei der Verwaltungsgesellschaft oder den Vertriebsstellen angefordert werden. Weitere Informationen entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Allgemeine Informationen“.

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

Allgemeine Informationen

Verwaltungsrat

Denise Voss, Vorsitzende
Paul Freeman
Ursula Marchioni (zurückgetreten am 13. Mai 2022)
Barry O'Dwyer (zurückgetreten am 31. Juli 2022)
Geoffrey D. Radcliffe
Davina Saint (ernannt am 13. Mai 2022)
Keith Saldanha

Alle Mitglieder des Verwaltungsrates sind nicht geschäftsführende Mitglieder des Verwaltungsrates.

Ursula Marchioni, Barry O'Dwyer, Geoffrey D. Radcliffe und Keith Saldanha sind Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe (BlackRock, Inc. ist die oberste Holdinggesellschaft der BlackRock-Gruppe, zu der die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageberater und die Hauptvertriebsgesellschaft gehören).

Paul Freeman ist ein ehemaliger Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe.
Denise Voss und Davina Saint sind unabhängige Verwaltungsratsmitglieder.

Verwaltungsgesellschaft

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

Anlageberater

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

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

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

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

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

Unteranlageberater

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

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

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

Hauptvertriebsgesellschaft

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

Verwahrstelle und Fondsbuchhalter

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

Transfer- und Registerstelle

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

Unabhängiger Wirtschaftsprüfer

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

Rechtsberater

Linklaters LLP
35, avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxemburg,
Großherzogtum Luxemburg

Wertpapierleihstelle

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

Zahlstellen

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

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

Allgemeine Informationen Fortsetzung

Italien

Allfunds Bank, S.A.
Zweigniederlassung Mailand
Via Santa Margherita 7
20121 Mailand,
Italien

BNP Paribas Securities Services
Succursale di Milano
Via Ansperto. 5
20123 Mailand,
Italien

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

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

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

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

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

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

Luxemburg

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

Polen

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

Schweden

BlackRock Investment Management (UK)
Limited Zweigniederlassung Stockholm
Norrandsgatan 16
111 43 Stockholm
Schweden

Schweiz

State Street Bank International GmbH
Munich, Zurich Branch
Beethovenstrasse 19
CH-8027 Zürich, Schweiz

Vereinigtes Königreich

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

Eingetragener Sitz

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

Allgemeine Informationen Fortsetzung

Anfragen

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

Schriftliche Anfragen:

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

P.O. Box 1058,

L-1010 Luxemburg,

Großherzogtum Luxemburg

Alle anderen Anfragen:

Tel.: + 44 207 743 3300

Fax: + 44 207 743 1143

E-Mail: investor.services@blackrock.com

Aktueller Prospekt

Der Prospekt der Gesellschaft sowie die jeweiligen wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) sind zusammen mit Exemplaren des Antragsformulars direkt beim Investor Service Centre, der Verwaltungsgesellschaft oder einer ihrer Niederlassungen oder Vertriebsstellen erhältlich. Exemplare der Gesellschaftssatzung, des Jahresberichts und des geprüften Abschlusses sowie der ungeprüfte Zwischenbericht und Zwischenabschluss sind ebenfalls kostenfrei bei einer dieser Stellen sowie bei den Zahlstellen erhältlich. Außerdem sind sämtliche Unterlagen unter www.blackrockinternational.com verfügbar.

Vertretungen

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

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

In Polen wird die Gesellschaft durch Dubinski Fabrycki Jelenski, ul. Zielna 37, 00-108 Warschau, Polen, vertreten.

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

Bestand an Anlagen

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

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

Liquiditätsinstrumente werden vornehmlich anhand des Sitzlandes des Emittenten klassifiziert.

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

Käufe und Verkäufe

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

Vertriebsberechtigungen

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

Anteile bestimmter Fonds der Gesellschaft können zudem in Singapur im Wege von Privatplatzierungen angeboten werden.

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

Schreiben der Vorsitzenden des Verwaltungsrats an die Anteilhaber

Mai 2022

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

mit diesem Schreiben möchte ich Sie über die Aktivitäten der BlackRock Strategic Fonds (die „Gesellschaft“ oder „BSF“) in den zwölf Monaten bis zum 31. Mai 2022 informieren. Zum 31. Mai 2022 gehörten 30 Fonds (einzeln „ein Fonds“, zusammen „die Fonds“) zur Fondspalette der Gesellschaft.

COVID-19 hat in den letzten zwei Jahren tiefgreifende Auswirkungen auf alle Aspekte der Gesellschaft gehabt. Während in den Industrieländern zunehmend Einigkeit darüber herrscht, dass die schlimmsten Auswirkungen jetzt vorbei sind, wird erwartet, dass Reisebeschränkungen, verstärkte Gesundheitskontrollen in Einfuhrhäfen und anderen Grenzstellen, Unterbrechungen und Verzögerungen bei der Vorbereitung und Bereitstellung von Gesundheitsdienstleistungen, Stornierungen, Störungen der Lieferkette und eine geringere Verbrauchernachfrage zu anhaltenden Herausforderungen führen werden. Auch wenn in vielen Ländern mittlerweile breit angelegte Impfprogramme vorhanden sind und sich positive Auswirkungen zeigen, wirkt sich COVID-19 weiterhin negativ auf die Wirtschaften vieler Nationen auf der ganzen Welt aus, und diese Auswirkungen könnten bei niedrigeren Impraten, wie in bestimmten Schwellenländern, schwerwiegender ausfallen.

Gerade, als sich die Welt nach der COVID-19-Pandemie langsam wieder erholte, die Lockdowns beendet wurden und die Wirtschaft wieder anlief, wurde Europa vom Krieg getroffen. Russlands Angriff auf die Ukraine verursacht erhebliche humanitäre Kosten, destabilisiert aber auch eine Weltwirtschaft, die sich gerade erst zu erholen beginnt. Insbesondere die steigenden Rohstoffpreise tragen zum bestehenden Inflationsdruck bei und bedrohen das Wachstum.

Sowohl Russland als auch die Ukraine sind wichtige Rohstoffproduzenten. Russland gehört zu den weltweit größten Exporteuren von Öl, Gas und Kohle, während die Ukraine ein bedeutender Agrarexporteur ist, insbesondere für Weizen. Der Preis für Erdgas ist im Vergleich zum Vorjahr um 125 % gestiegen, für Brent Crude um 63 %, während der Weizenpreis 62 % höher ist. Dies hat die Haushalte weltweit stark unter Druck gesetzt und dazu geführt, dass sich die Ausgaben auf Basiskonsumgüter konzentrieren.

Die Inflation war bereits hoch, da gestörte Lieferketten mit der wiederbelebten Nachfrage nach COVID-19 kollidierten. Aufgrund des fortschreitenden Drucks sahen sich die Zentralbanken gezwungen, ab November die Zinsen anzuheben. Die Federal Reserve hat die Zinsen 2022 erneut angehoben, womit ihr Referenzzinssatz nun bei 1,5–1,75 % liegt. Für den Rest des Jahres wird mit weiteren Anstiegen gerechnet, wobei die Mitglieder des Federal Open Market Committee („FOMC“) andeuten, dass der Zinssatz Anfang 2023 3,4 % erreichen dürfte. Andere Notenbanken folgten der Fed.

Dies beeinträchtigte die wirtschaftliche Erholung. In seinem jüngsten Weltwirtschaftsausblick korrigierte der Internationale Währungsfonds (IWF) seine Prognose nach unten und geht nun weltweit von einem schwächeren Wachstum aus. Es heißt darin: „Die wirtschaftlichen Schäden durch den Konflikt (in der Ukraine) werden 2022 zu einer deutlichen Verlangsamung des globalen Wachstums führen und die Inflation erhöhen. Die Kraftstoff- und Nahrungsmittelpreise sind schnell gestiegen und treffen die gefährdeten Bevölkerungsgruppen in Ländern mit niedrigem Einkommen am härtesten.“

Der IWF geht davon aus, dass sich das globale Wachstum von schätzungsweise 6,1 % im Jahr 2021 auf 3,6 % in den Jahren 2022 und 2023 verlangsamen wird. Dies ist für 2022 und 2023 0,8 bzw. 0,2 Prozentpunkte niedriger als im Update vom Januar. Weiter wird ausgeführt, dass diese Prognose von ungewöhnlich hoher Unsicherheit geprägt ist und Abwärtsrisiken für die globalen Aussichten dominieren.

Die sich abschwächende Konjunktur und die kriegsbedingte Verunsicherung spiegeln sich in der Marktvolatilität wider. Der S&P 500 machte bis Anfang 2022 weiterhin unbeständige Fortschritte, sank dann aber schnell, als die Auswirkungen der höheren Inflation und des internationalen Konflikts klar wurden. Insbesondere der Technologiesektor hatte nach einer Reihe schwächer als erwartet ausgefallener Ergebnisse und einer Überprüfung seiner hohen Bewertungen angesichts gestiegener Zinsen zu kämpfen.

Für Anleger in festverzinsliche Papiere, vor allem jene in Staats- und Unternehmensanleihen höchster Qualität, war es eine sehr schwierige Zeit. Die Rendite der 10-jährigen US-Staatsanleihen stieg von rund 1,5 % Ende November auf derzeit rund 3,2 %. Steigen die Renditen, sinkt der Kurs, so dass die Anleger erhebliche Kapitalverluste verzeichneten. Eine ähnliche Schwäche wiesen Unternehmensanleihen höherer Qualität auf, deren Preise im Vergleich zu Staatsanleihen stärker einbrachen.

Näheres zur Wertentwicklung der Fonds enthält der Bericht des Anlageberaters, in dem auch einige unserer Einschätzungen zum Anlageausblick näher erläutert werden. Insgesamt sank das verwaltete Vermögen der Gesellschaft („AUM“) in den zwölf Monaten um 18,0 % von 27.313 Mio. USD auf 22.406 Mio. USD, wobei sich die Schwellenländer und europäische Rentenfonds als besonders schwach erwiesen.

Das stärkste prozentuale Wachstum verzeichnete der BlackRock Global Real Asset Securities Fund, dessen AUM um 161,8 % auf 825 Mio. USD stieg. Der BlackRock UK Equity Absolute Return Fund und der BlackRock Asia Pacific Absolute Return Funds verzeichneten ebenfalls einen Anstieg ihres AUM um 50,7 % bzw. 44,3 % auf 214 Mio. GBP bzw. 50 Mio. USD. Der BlackRock European Unconstrained Equity Fund performte ebenfalls stark und sein AUM stieg um 26,24 % auf 59,1 Mio. EUR.

Schreiben der Vorsitzenden des Verwaltungsrats an die Anteilinhaber

Mai 2022 Fortsetzung

Zu den Schwachstellen zählte der BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund, der 60,7 % seines Vermögens verlor und somit auf 356 Mio. USD sank. Er war eine von mehreren Schwellenländerstrategien, die Schwäche zeigten. Der BlackRock Style Advantage Fund zeigte sich ebenfalls schwach und fiel im Jahresverlauf um 31,3 %. Der BlackRock Style Advantage Screened Fund, der BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund und der BlackRock Total Advantage Fund wurden im Laufe des Jahres geschlossen.

In Europa gab es weiterhin diverse Gesetzesänderungen, die sich auf Anleger auswirken könnten. Zu den wichtigsten Entwicklungen im Berichtszeitraum gehörten:

- ▶ Die neue Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) der Europäischen Union ist im März 2021 in Kraft getreten. Sie sieht neue Transparenz- und Berichtspflichten für Wertpapierfirmen vor, die sowohl auf Unternehmensebene als auch auf Produktebene gelten. Bestimmte Teile des Rahmenwerks wurden 2022 endgültig beschlossen und treten Anfang 2023 in Kraft. Gleichzeitig arbeitet die EU an einem EU-weiten Klassifizierungssystem oder -rahmen. Diese Klassifizierung soll Unternehmen und Investoren eine gemeinsame Sprache bieten, um festzustellen, inwieweit wirtschaftliche Aktivitäten als ökologisch nachhaltig betrachtet werden können. Es gibt auch Maßnahmen zur Verbesserung der Berichterstattung, wie etwa die derzeit erörterte Richtlinie über die Nachhaltigkeitsberichterstattung von Unternehmen (Corporate Sustainability Reporting Directive, „CSRD“). Die luxemburgische Regierung hat kürzlich weitere Schritte unternommen, um Investitionen in ökologisch nachhaltige Fonds zu fördern, indem sie die „taxe d'abonnement“ (Zeichnungssteuer) für Fonds, die bestimmte Umweltkriterien erfüllen, ermäßigt hat.
- ▶ Ab dem 1. Januar 2023 bringt die erweiterte PRIIPs-Verordnung wesentliche Veränderungen für die Fondsbranche mit sich, die zuvor von einer Ausnahmeregelung profitiert hatte. OGAW-KIIDs werden durch die strengeren PRIIPs-KIDs-Anforderungen ersetzt. Zu den Änderungen gehören die Berechnung der Risiken, der Wertentwicklung und der Transaktionskosten.

Fragen zum vorliegenden Schreiben können Sie jederzeit über unsere Website www.blackrockinternational.com oder per E-Mail an investor.services@blackrock.com richten.

Mit freundlichen Grüßen

Denise Voss
Vorsitzende
Juni 2022

Bericht des Anlageberaters

Performancerückblick

1. Juni 2021 – 31. Mai 2022

Marktrückblick

Die Märkte waren bereits vor der russischen Invasion in der Ukraine ins Schleudern geraten. Die Aussicht auf höhere Zinsen führte dazu, dass die Anleger die Bewertungen im hoch bewerteten Technologiesektor erneut prüften und es in der zweiten Jahreshälfte 2021 an den Märkten kaum Fortschritte gab. Erst als sich das reale Ausmaß der Ukraine-Krise zeigte – und insbesondere ihre Auswirkungen auf Inflation und Zinssätze – gerieten die Anleger in Panik. Der Markt war geprägt von Zeiten, in denen die Anleger ihre Papiere hielten, gefolgt von weiteren Einbrüchen.

Energie und Rohstoffe waren die herausragenden Gewinner dieser turbulenten Zeit. Als die Rohstoffpreise stiegen, erzielten die Energieriesen enorme Gewinne, so dass die nationalen Regierungen begannen, Übergewinnsteuern in Betracht zu ziehen. In den ersten fünf Monaten 2022 übertraf der MSCI World Select Natural Resources Index den breiteren MSCI World Index um fast 40 %.

Die Schwachstelle war die Technologie. Nach einer langen Periode, in der starke Gewinne die Aktienkurse im Sektor weiter nach oben trieben, wurden wieder etwas schwächere Ergebnisse gemeldet. Die Akzeptanz in Bereichen wie E-Commerce und Streaming-Diensten verlangsamte sich, da sich das Leben wieder normalisierte und die Anleger ihre Erwartungen anpassten. Gleichzeitig wurde durch die Inflation der Wert der langfristigen Cashflows vieler wachstumsstarker Technologieunternehmen gemindert.

Als robuster erwiesen sich die Sektoren, die die Folgen der Inflation am besten meistern konnten. Auch Gewerbeimmobilien und Infrastrukturanlagen entwickelten sich gut, wobei sich ihre Cashflows an die Inflation anpassten. Es war ein besserer Zeitraum für Dividendenstrategien, da die Anleger zunehmend aktuelle Cashflows gegenüber zu erwartenden Cashflows priorisierten. Die verbleibenden Beschränkungen für Bankdividenden wurden im Berichtszeitraum aufgehoben, und relativ starke Unternehmensgewinne ermöglichten es Unternehmen, erneut Dividenden auszuschütten.

Im Allgemeinen waren regionale Unterschiede nicht so stark wie Sektorunterschiede. Im Zwölfmonatszeitraum war jedoch eine deutliche Kluft zwischen Schwellen- und Industrieländern auszumachen. Schwellenländer neigten dazu, ihre Geldpolitik früher und deutlicher zu ändern. Dies hat die Performance beeinträchtigt. Ebenso wirkte sich die relative Schwäche Chinas auf die Gesamtwertentwicklung der Schwellenmärkte aus. Lateinamerika war mit seiner Stärke bei den natürlichen Ressourcen ein bemerkenswerter Lichtblick.

Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren („ESG“) stellten weiterhin einen wichtigen Aspekt dar, auch wenn ESG-bewusste Fonds ihren bedeutenden Erfolg im Jahr 2021 nicht wiederholen konnten. Während viele „grüne“ Unternehmen davon profitierten, dass sich viele Regierungen das Prinzip „Build back better“ auf die Fahnen schrieben, da sich dies positiv auf die Aktienkurse auswirkte, war es eine stärkere Zeit für konventionelle Energie – wie Öl und Gas.

Vor allem im Vereinigten Königreich war es für die Anleihenmärkte eine schwierige Zeit. Die Renditen 10-jähriger

US-Staatsanleihen, die sich umgekehrt zu den Preisen bewegen, stiegen von 1,5% zu Beginn des Berichtszeitraums auf 3,2% am Ende. Besonders in Mitleidenschaft gezogen wurden Anleger in britische Staatsanleihen, die zweistellige Einbußen hinnehmen mussten. Indexgebundene Anleihen, die sich eher im Rahmen der Inflationserwartungen bewegen als die tatsächliche Inflationsrate, haben seit Anfang 2022 ebenfalls deutliche Rückgänge hinnehmen müssen.

Wertentwicklung der Fonds

Wertentwicklung der Aktienfonds

Eine Tabelle mit den Wertentwicklungsrenditen der primären Anteilklassen der einzelnen Fonds im Vergleich zu den jeweiligen Benchmarks finden Sie auf den Seiten 10, 11 und 12. Es folgt eine kurze Zusammenfassung der Wertentwicklung der Fonds.

Der BlackRock European Absolute Return Fund kletterte um 3,0% (EUR), überholte damit seine Benchmark, den Dreimonats-Euribor, der 0,5% einbüßte. Der BlackRock UK Equity Absolute Return Fund stieg gegenüber seiner Benchmark, dem Dreimonats-SONIA, welcher um 0,3% stieg, um 6,9%. Der BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund verlor im Laufe des Berichtszeitraums 1,7% und blieb damit hinter seiner Benchmark zurück, die um 0,3% zulegte.

Der BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund gab im Berichtszeitraum um 15,4% nach und lag damit hinter seiner Benchmark, dem Dreimonats-SONIA, der ein Plus von 0,3% erzielte. Der BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund stieg um 7,0% und schnitt damit besser ab als der Dreimonats-SOFR-Index, der ein Plus von 0,3% verzeichnete.

Der BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund fiel um 16,2% und lag damit vor seiner Benchmark, dem MSCI Emerging Markets Index (USD), der ein Minus von 19,8% verzeichnete. Der BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund fiel um 5,3% und blieb damit hinter seiner Benchmark, dem BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill (USD), zurück, der 0,1% zulegen konnte.

Der BlackRock European Opportunities Extension Fund fiel um 1,8% (EUR) und lag damit hinter seiner Benchmark, dem S&P Europe BMI Index (Developed Markets Only) (EUR), der um 1,6% stieg. Der BlackRock European Select Strategies Fund fiel um 7,4% und lag damit vor seiner Benchmark, die 7,9% einbüßte. Der BlackRock Global Event Driven Fund fiel um 3,9%, verglichen mit der unveränderten Wertentwicklung der Benchmark, dem BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill.

Der BlackRock Systematic ESG World Equity Fund fiel um 6,3% und lag damit hinter seiner Benchmark, dem MSCI World Index (Net Total Return), der um 4,9% fiel. Der BlackRock Style Advantage Fund stieg um 4,8%, die Rendite des 3 Month SOFR Index war hingegen unverändert. Der BlackRock Systematic Global Equity Fund fiel um 8,1% und blieb damit hinter seiner Benchmark, dem MSCI All Country World Index (Net Total Return), zurück, der um 6,8% fiel. Der BlackRock Global Real Asset Securities Fund fiel um 6,9% und lag damit

Bericht des Anlageberaters Performancerückblick

1. Juni 2021 – 31. Mai 2022 Fortsetzung

hinter seiner Benchmark, dem FTSE Custom Developed Core Infrastructure 50/50 EPRA/Nareit Developed Dividend+ Net Index, der um 1,4 % fiel.

Wertentwicklung der Anleihefonds

Der BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund, der seine Wertentwicklung nicht mit der einer Benchmark vergleicht, fiel im Berichtszeitraum um 11,7 %. Der BlackRock Fixed Income Strategies Fund fiel im Berichtszeitraum um 2,7 % und blieb damit hinter seinem Benchmark, dem Euro Overnight Index Average, zurück, der um 0,5 % fiel. Der BlackRock Global Absolute Return Bond Fund fiel um 4,2 % und lag damit hinter seinem Benchmark, dem 3-Monats-Euribor-Index, der ein Minus von 0,6 % verzeichnete.

Der BlackRock ESG Euro Bond Fund gab 11,1 % ab und blieb damit hinter seinem Benchmark zurück, die 10,2 % einbüßte. Der BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund verzeichnete einen Rückgang um 9,4 % und lag damit hinter seinem Benchmark, dem Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate Sustainable SRI Index (EUR), der einen Rückgang von 8,7 % verzeichnete.

Wertentwicklung der Mischfonds

Der BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund gab 7,2 % ab und blieb damit hinter seinem Benchmark, dem Euro Overnight Index Average (EUR), zurück, der ein Minus von 0,5 % verbuchte. Das BlackRock Managed Index Portfolio – Conservative – fiel um 5,2 %. Die Portfolios Defensive, Growth und Moderate stiegen um 4,9 %, 3,2 % bzw. 2,9 %. Keiner der Fonds in den Managed Index Portfolios verfügt über einen Benchmark.

Aussichten

2022 hat bereits eine Reihe neuer Herausforderungen mit sich gebracht, als sich die Welt noch nicht wirklich von COVID-19 erholt hatte. Die Pandemie hat ein schwieriges Erbe mit hoher Staatsverschuldung, Lieferkettenproblemen und Inflation hinterlassen. Diese Probleme wurden nun durch den Krieg in der Ukraine verschärft, wobei die hohen Rohstoffpreise die Energie- und Lebensmittelkosten für Haushalte auf der ganzen Welt belasten.

Gleichzeitig müssen sich die entwickelten Märkte einem neuen fiskal- und geldpolitisches Umfeld anpassen. Konjunkturpakete, niedrige Zinsen und quantitative Lockerungen boten während der Pandemie Unterstützung. Nach und nach werden diese Unterstützungsmaßnahmen eingestellt. Die Wachstumsraten verlangsamten sich bereits und es bestehen Befürchtungen, dass eine Reihe großer Volkswirtschaften 2023 in eine Rezession abgleiten werden.

Die Zentralbanken haben deutlich gemacht, dass sie die Inflation als größeres Risiko als die Rezession ansehen, und verfolgen weiterhin aggressive Zinserhöhungen. Die USA und Großbritannien haben die Zinsen bereits angehoben und prognostizieren für den Rest des Jahres 2022 weitere Zinserhöhungen. Auf Anlegerseite wurden ebenfalls eine Reihe von Zinserhöhungen in der Eurozone eingepreist. Inflation lässt sich selten ohne Folgen für die Weltwirtschaft bändigen, und die Notenbanken verfolgen einen gefährlichen Weg.

Dies führt zu einer erheblichen Unsicherheit hinsichtlich der Wachstumsaussichten. Es mehren sich Anzeichen dafür, dass das Wachstum unter Druck steht, und die Regierungen beginnen, ihre Prognosen für das Bruttoinlandsprodukt („BIP“) nach unten zu revidieren, um die Auswirkungen des Kriegs in der Ukraine widerzuspiegeln. Dies könnte die Märkte im kommenden Jahr destabilisieren, und wird sicherlich Auswirkungen auf die Art der Sektoren haben, die gut abschneiden.

Die Märkte sind dennoch ein gutes Stück zurückgekehrt und der Unternehmenssektor hat sich als einigermaßen widerstandsfähig erwiesen. Dadurch erscheinen die Bewertungen attraktiver. Zweifellos gibt es Unternehmen, die diesen Sturm trotz der heraufziehenden Konjunkturschwäche überstehen und sich gut entwickeln können. Gleichermäßen haben höhere Renditen von Anleihen dazu geführt, dass festverzinsliche Wertpapiere seit einiger Zeit als besser bewertet erscheinen als früher. Letztendlich wird es im kommenden Jahr Herausforderungen geben, doch werden sich auch Chancen bieten.

Juni 2022

Bericht des Anlageberaters

Performancerückblick

1. Juni 2021 – 31. Mai 2022 Fortsetzung

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

In der Performancerenditetablelle sind die Fonds enthalten, die gemäß der EU-Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen („SFDR“) ökologische oder soziale Merkmale fördern („Artikel-8-Fonds“). Weitere Einzelheiten dazu, wie Artikel-8-Fonds diese Merkmale und Ziele erreicht haben, sind im Abschnitt SFDR-Überprüfung dieses Berichts des Anlageberaters für den Berichtszeitraum enthalten.

Die Technical Screening Criteria („TSC“) der EU-Taxonomie-Verordnung („Taxonomie“) wurden erst am 9. Dezember 2021 (d. h. in Bezug auf die ersten beiden Taxonomie-Umweltziele Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel) fertiggestellt oder werden derzeit noch erarbeitet (d. h. für die übrigen vier Taxonomie-Umweltziele). Diese detaillierten Kriterien erfordern die Verfügbarkeit mehrerer, spezifischer Datenpunkte für jede Investition. Für den Berichtszeitraum lagen dem Anlageverwalter keine ausreichend zuverlässigen, zeitnahen und überprüfbaren Daten vor, um Anlagen mithilfe der TSC bewerten zu können.

Darüber hinaus sind die Regulatory Technical Standards (RTS) im Rahmen der SFDR, welche die Methodik zur Berechnung des Anteils von ökologisch nachhaltigen Anlagen und die Vorlagen für diese Offenlegungen definieren, noch nicht in Kraft. Für den Berichtszeitraum war der Anlageverwalter nicht in der Lage, standardisierte und vergleichbare Angaben zu den Taxonomie-Anpassungen der Fonds zu machen.

Auch wenn es Anlagen der jeweiligen Fonds geben kann, die in wirtschaftlichen Aktivitäten tätig sind, die zu einem Umweltziel beitragen und möglicherweise gegen die TSC bewertet werden können, ist der Anlageverwalter derzeit nicht in der Lage, Folgendes zu beschreiben:

1. das Ausmaß, zu dem die Anlagen des jeweiligen Fonds in wirtschaftlichen Aktivitäten erfolgen, die als ökologisch nachhaltig gelten und mit der Taxonomie-Verordnung in Einklang stehen;
2. den prozentualen Anteil der Anlagen in ökologisch nachhaltigen wirtschaftlichen Aktivitäten in den jeweiligen Fondsportfolios, die mit der Taxonomie-Verordnung im Einklang stehen; oder
3. den prozentualen Anteil der Aktivierungs- und Übergangsaktivitäten (wie in der Taxonomie-Verordnung beschrieben) am Portfolio der jeweiligen Fonds.

Der Anlageverwalter überprüft diese Situation aktiv, und wenn er nach eigenem Ermessen festgestellt hat, dass er über ausreichende zuverlässige, zeitnahe und überprüfbare Daten zu den Anlagen des jeweiligen Fonds verfügt, wird der Anlageverwalter die vorstehend genannten Beschreibungen zur Verfügung stellen. In diesem Fall wird der Prospekt des Fonds oder der entsprechende Nachtrag aktualisiert. Weitere Informationen finden Sie unter <https://www.blackrock.com/corporate/literature/prospectus/eu-taxonomy.pdf>

Bei allen anderen Fonds, die nicht die SFDR-Kriterien für Fonds nach Artikel 8 oder 9 erfüllen, berücksichtigen die diesen Finanzprodukten zugrunde liegenden Anlagen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Bericht des Anlageberaters Performancerückblick

1. Juni 2021 – 31. Mai 2022 Fortsetzung

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

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

| Name des Fonds | Ergebnis im Finanzzeitraum bis zum 31. Mai 2022 | | Wertentwicklung im Kalenderjahr | | | Auflegungsdatum | SFDR- Klassifizierung |
|--|---|------------------|------------------------------------|-----------------|---------------------------|------------------|--------------------------|
| | 1 Jahr | 2021 | 2020 | 2019 | | | |
| BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist | 6,99 % | 8,80 % | (2,84) % | 2,19 % | 17. Februar 2012 | Sonstiges | |
| 3 Month SOFR Index ⁽¹⁾ | 0,29 % | 0,18 % | 1,08 % | 2,60 % | | | |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund 'D' Class Non Dist | 5,82 % | 7,44 % | 8,43 % | 4,08 % | 31. August 2016 | Sonstiges | |
| 3 Month SOFR Index ⁽¹⁾ | 0,29 % | 0,18 % | 1,08 % | 2,60 % | | | |
| BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist | (1,72) % | 10,29 % | 7,54 % | (1,98) % | 22. Februar 2017 | Sonstiges | |
| 3 Month SOFR Index ⁽¹⁾ | 0,29 % | 0,18 % | 1,08 % | 2,60 % | | | |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund 'A' Class Non Dist | (7,17) % | 3,38 % | 7,19 % | 8,55 % | 28. Januar 2011 | Sonstiges | |
| Euro Short-Term Rate Overnight Index ⁽¹⁾ | (0,52) % | (0,47) % | (0,44) % | (0,38) % | | | |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund 'D' Class Non Dist | (15,41) % | 9,83 % | 10,48 % | 14,24 % | 17. Oktober 2018 | Sonstiges | |
| 3 Month SONIA Index ⁽¹⁾ | 0,34 % | 0,09 % | 0,29 % | 0,81 % | | | |
| BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund 'D' Class Non Dist⁽²⁾ | — | 7,68 % | (19,70) % | 1,61 % | 15. November 2012 | Sonstiges | |
| 3 Month SOFR Index ⁽¹⁾ | — | 0,18 % | 1,08 % | 2,60 % | | | |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund 'A' Class Non Dist | (16,23) % | 3,86 % | (9,86) % | 23,24 % | 18. September 2015 | Sonstiges | |
| MSCI Emerging Markets Index | (19,83) % | (2,54) % | 18,31 % | 18,42 % | | | |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund 'A' Class Non Dist | (11,72) % | (12,25) % | 14,07 % | 5,66 % | 12. Juni 2013 | Sonstiges | |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund 'A' Class Non Dist | (9,59) % | (1,16) % | 8,41 % | 6,50 % | 6. Dezember 2017 | Sonstiges | |
| J.P. Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified 1-3 year Index | (10,67) % | 1,04 % | 0,46 % | 4,02 % | | | |
| BlackRock ESG Euro Bond Fund 'A' Class Non Dist | (11,09) % | (4,01) % | 4,16 % | 5,69 % | 23. August 2016 | Artikel 8 | |
| Bloomberg MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Index | (10,19) % | (2,98) % | 4,21 % | 5,91 % | | | |

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

Bericht des Anlageberaters Performancerückblick

1. Juni 2021 – 31. Mai 2022 Fortsetzung

| Name des Fonds | Ergebnis im Finanzzeitraum bis zum 31. Mai 2022 | | Wertentwicklung im Kalenderjahr | | | Auflegungsdatum | SFDR- Klassifizierung |
|---|---|---------|------------------------------------|---------|--------------------|-----------------|--------------------------|
| | 1 Jahr | 2021 | 2020 | 2019 | | | |
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund 'A' Class Non Dist | (9,42)% | (1,87)% | 2,79% | 1,01% | 21. Juni 2019 | Artikel 8 | |
| Bloomberg MSCI Euro Corporate Sustainable SRI Index | (8,71)% | (0,99)% | 2,70% | 0,91% | | | |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund | (3,98)% | — | — | — | 1. März 2021 | Artikel 8 | |
| Bloomberg MSCI Euro Aggregate 1-3 Years Sustainable SRI Index | (2,39)% | — | — | — | | | |
| BlackRock European Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist | 3,02% | 8,31% | 8,72% | 0,54% | 27. Februar 2009 | Sonstiges | |
| 3 Month EURIBOR Index ⁽¹⁾ | (0,53)% | (0,56)% | (0,43)% | (0,39)% | | | |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund 'A' Class Non Dist | (1,75)% | 44,23% | 10,99% | 31,64% | 31. August 2007 | Sonstiges | |
| S&P Europe BMI Index (Developed Markets only) | 1,59% | 25,14% | (1,45)% | 27,77% | | | |
| BlackRock European Select Strategies Fund 'A' Class Non Dist | (7,38)% | 2,31% | 2,24% | 9,94% | 19. August 2015 | Sonstiges | |
| 75% Bloomberg Pan European Aggregate Index (Hedged EUR) / 25% MSCI Europe Index (Hedged EUR) | (7,89)% | 2,65% | 3,24% | 10,13% | | | |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund 'A' Class Non Dist | (1,87)% | 32,42% | 10,75% | 39,23% | 6. Dezember 2018 | Sonstiges | |
| MSCI Europe Index (Net Total Return) | 3,01% | 25,13% | (3,32)% | 26,05% | | | |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund 'A' Class Non Dist | (5,48)% | (0,59)% | 1,15% | 1,88% | 11. Juni 2019 | Sonstiges | |
| Euro Short-Term Rate Overnight Index ⁽¹⁾ | (0,52)% | (0,47)% | (0,44)% | (0,22)% | | | |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund 'A' Class Non Dist | (2,65)% | (1,54)% | 3,44% | 2,23% | 30. September 2009 | Sonstiges | |
| Euro Short-Term Rate Overnight Index ⁽¹⁾ | (0,52)% | (0,47)% | (0,44)% | (0,38)% | | | |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund 'A' Class Non Dist | (4,17)% | (2,15)% | 2,65% | 1,29% | 25. Mai 2012 | Sonstiges | |
| 3 Month Euribor Index | (0,58)% | (0,55)% | (0,39)% | (0,34)% | | | |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund 'D' Class Non Dist | (21,37)% | (7,49)% | 14,89% | 6,34% | 12. Dezember 2018 | Sonstiges | |
| 3 Month SOFR Index ⁽¹⁾ | 0,29% | 0,18% | 1,08% | 2,60% | | | |
| BlackRock Global Event Driven Fund 'A' Class Non Dist | (3,92)% | 1,46% | 6,74% | 6,93% | 5. August 2015 | Sonstiges | |
| BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill | 0,14% | 0,05% | 0,67% | 2,28% | | | |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund 'A' Class Non Dist | (6,86)% | 13,20% | 6,51% | 25,18% | 30. November 2017 | Sonstiges | |
| FTSE Custom Developed Core Infrastructure 50/50 EPRA/Nareit Developed Dividend+ Net Index | (1,43)% | 13,75% | (6,80)% | 21,79% | | | |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative 'A' Class Non Dist | (5,21)% | 7,59% | 0,35% | 14,80% | 26. Januar 2018 | Sonstiges | |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive 'D' Class Dist | (4,91)% | 3,87% | (0,22)% | 11,41% | 10. April 2015 | Sonstiges | |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth 'D' Class Dist | (3,23)% | 19,03% | 7,36% | 23,36% | 10. April 2015 | Sonstiges | |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate 'D' Class Dist | (2,86)% | 12,37% | 0,37% | 18,91% | 10. April 2015 | Sonstiges | |
| BlackRock Style Advantage Fund 'A' Class Non Dist | 4,83% | 14,17% | (23,28)% | (2,61)% | 29. Februar 2016 | Sonstiges | |
| 3 Month SOFR Index ⁽¹⁾ | 0,29% | 0,18% | 1,08% | 2,60% | | | |
| BlackRock Style Advantage Screened Fund 'A' Class Non Dist⁽²⁾ | — | 12,93% | (19,51)% | 0,82% | 29. Oktober 2018 | Artikel 8 | |
| 3 Month SOFR Index ⁽¹⁾ | — | 0,18% | 1,08% | 2,60% | | | |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund 'A' Class Non Dist | (6,31)% | 23,15% | 17,69% | 27,48% | 20. August 2015 | Artikel 8 | |
| MSCI World Index (Net Total Return) | (4,82)% | 21,82% | 15,90% | 27,67% | | | |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund 'A' Class Non Dist | (8,14)% | 17,67% | 15,83% | 24,72% | 18. September 2015 | Sonstiges | |
| MSCI All Country World Index (Net Total Return) | (6,78)% | 18,54% | 16,25% | 26,60% | | | |

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

Bericht des Anlageberaters Performancerückblick

1. Juni 2021 – 31. Mai 2022 Fortsetzung

| Name des Fonds | Ergebnis im Finanzzeitraum bis zum 31. Mai 2022 | | Wertentwicklung im Kalenderjahr | | | Auflegungsdatum | SFDR- Klassifizierung |
|--|---|----------|------------------------------------|----------|--|-------------------|--------------------------|
| | 1 Jahr | 2021 | 2020 | 2019 | | | |
| BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund 'A' Class Non Dist | (5,29) % | 2,65 % | (0,61) % | (1,20) % | | 2. Juni 2014 | Sonstiges |
| BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill | 0,14 % | 0,05 % | 0,67 % | 2,28 % | | | |
| BlackRock Total Advantage Fund 'A' Class Non Dist⁽²⁾ | — | 8,30 % | (12,70) % | 10,28 % | | 11. Dezember 2017 | Sonstiges |
| 3 Month Euribor Index | — | (0,35) % | (0,39) % | (0,34) % | | | |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist | 6,86 % | 0,83 % | (1,37) % | 9,20 % | | 18. August 2016 | Sonstiges |
| 3 Month SONIA Index ⁽¹⁾ | 0,34 % | 0,09 % | 0,29 % | 0,81 % | | | |

⁽¹⁾ Die Benchmark hat sich im Laufe des Jahres geändert. Weitere Einzelheiten finden Sie in Anhang F des Prospekts.

⁽²⁾ Der Fonds wurde im Laufe des Jahres aufgelöst. Näheres hierzu siehe Erläuterung 1. Die angegebene Performance zeigt die Performance des Fonds vom 1. Juni 2021 bis zum Datum der Auflösung des Fonds.

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

SFDR-Review

BlackRock ESG Euro Bond Fund

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund

Für das am 31. Mai 2022 endende Geschäftsjahr wurden die vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale durch die Anwendung von Ausschluss-Screenings erfüllt, die auf bestimmten umwelt- und sozialbezogenen Merkmalen basieren. Darüber hinaus waren die Fonds zu mindestens 90 % in Wertpapieren mit einem Rating von BB oder höher gemäß der Definition der ESG Intangible Value Assessment Ratings von MSCI oder der ESG Sovereign Ratings von MSCI und für Unternehmensemissionen einem Score von mindestens eins gemäß dem ESG-Kontroversen-Score von MSCI angelegt, wie im Prospekt näher beschrieben. Der Anlageverwalter ist weiterhin davon überzeugt, dass die zugrunde liegenden Anlagen in Unternehmen weiterhin die im Prospekt des Fonds dargelegten Good-Governance-Kriterien erfüllen.

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund

Für das am 31. Mai 2022 endende Geschäftsjahr wurden die vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale durch die Anwendung von Ausschluss-Screenings erfüllt, die auf bestimmten umwelt- und sozialbezogenen Merkmalen basieren, wie im Prospekt des Fonds dargelegt. Darüber hinaus wendete der Anlageverwalter einen systematischen Ansatz bei der Aktienauswahl auf der Grundlage ihrer ESG-Merkmale und der prognostizierten Rendite, des Risikos und der Transaktionskosten an. Weitere Einzelheiten sind im Verkaufsprospekt des Fonds enthalten. Der Anlageverwalter ist nach wie vor davon überzeugt, dass die zugrunde liegenden Anlagen in Unternehmen weiterhin die im Prospekt des Fonds dargelegten Good-Governance-Kriterien erfüllen.

BlackRock Style Advantage Screened Fund

Für den am 10. Mai 2022 (Auflösungsdatum) endenden Zeitraum wurden die vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale durch die Anwendung von Ausschluss-Screenings erfüllt, die auf bestimmten umwelt- und sozialbezogenen Merkmalen basieren, wie im Prospekt des Fonds dargelegt. Weitere Einzelheiten sind im Verkaufsprospekt des Fonds enthalten. Der Anlageverwalter war nach wie vor davon überzeugt, dass die zugrunde liegenden Anlagen in Unternehmen weiterhin bis zum Auflösungsdatum die im Prospekt des Fonds dargelegten Good-Governance-Kriterien erfüllten.

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

Bericht des Verwaltungsrats

Grundsätze der Corporate Governance

Einleitung

BlackRock Strategic Funds (die „Gesellschaft“) ist eine als offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (Société d'Investissement à Capital Variable) nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg errichtete Aktiengesellschaft (Société Anonyme). Die Gesellschaft wurde von der luxemburgischen Aufsichtsbehörde, der Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“), als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) gemäß den Bestimmungen von Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung zugelassen und unterliegt deren Aufsicht gemäß diesem Gesetz. Die Gesellschaft befolgt die Grundsätze des vom luxemburgischen Fondsverband ALFI aufgestellten Verhaltenskodex in seiner revidierten Fassung von 2013 (der „Kodex“), herausgegeben im Juni 2013.

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft (der „Verwaltungsrat“) hat sich den höchsten Corporate-Governance-Standards verpflichtet und ist mit Blick auf die Führung der Geschäfte der Gesellschaft gegenüber den Anteilhabern rechenschaftspflichtig. Der Verwaltungsrat hat die Grundsätze und Empfehlungen des Kodex in einen Corporate-Governance-Rahmen für die Gesellschaft einfließen lassen, den der Verwaltungsrat zur Einhaltung der Grundsätze des Kodex für eine Anlagegesellschaft für angemessen hält. Der Verwaltungsrat ist der Auffassung, dass die Gesellschaft die Grundsätze des Kodex für das zum 31. Mai 2022 endende Geschäftsjahr eingehalten hat.

Nachstehend sind die während des Berichtsjahres vom 1. Juni 2021 bis zum 31. Mai 2022 geltenden Corporate-Governance-Strukturen und -Prozesse der Gesellschaft zusammengefasst.

Zusammensetzung des Verwaltungsrats

Zum Datum des vorliegenden Berichts bestand der Verwaltungsrat aus fünf nicht geschäftsführenden Verwaltungsratsmitgliedern (einschließlich zwei von der Gesellschaft unabhängigen Mitgliedern). Der Verwaltungsrat verpflichtet sich, für ein ausgewogenes Verhältnis von Kompetenzen, Erfahrung, Unabhängigkeit und Wissen seiner Mitglieder zu sorgen.

Die Biografien der Verwaltungsratsmitglieder auf Seite 16 des vorliegenden Berichts spiegeln umfangreiches Anlagewissen und Erfahrung, Kompetenz in Geschäfts- und Finanzfragen sowie fundierte Kenntnisse der Gesetze und Vorschriften wider, die Voraussetzung für eine effektive strategische und ordnungsgemäße Führung und Kontrolle der Gesellschaft sind. Der Verwaltungsrat möchte ein weiteres Verwaltungsratsmitglied hinzufügen, und nach Auffassung von BlackRock ist diese Zusammensetzung des Verwaltungsrats angemessen und ausgewogen.

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

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

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

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

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

Verantwortung des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat trifft sich mindestens vierteljährlich und darüber hinaus bei Bedarf zu kurzfristig anberaumten Sitzungen. Dem Verwaltungsrat werden alle Informationen rechtzeitig und in angemessener Form und Qualität bereitgestellt, damit dieser seine Aufgaben erfüllen kann. Der Verwaltungsrat ist für den langfristigen Erfolg der Gesellschaft verantwortlich und sich seiner Verantwortung dafür bewusst, die Gesellschaft im Rahmen sorgfältiger und effektiver

Bericht des Verwaltungsrats Fortsetzung

Kontrollen, die eine Beurteilung und Steuerung von Risiken ermöglichen, zu führen, zu lenken und zu kontrollieren. Der Verwaltungsrat behält sich Entscheidungen über die Festlegung der Anlagepolitik und Anlageziele, über die Änderung der Anlagestrategie, den Abschluss wesentlicher Verträge, die Änderung der Zusammensetzung des Verwaltungsrats, den Wechsel des externen Abschlussprüfers, die strafrechtliche Verteidigung oder Beilegung von Rechtsstreitigkeiten, die für die Gesellschaft wesentlich oder bedeutsam sind, und eine wesentliche Änderung der Rechnungslegungsgrundsätze vor. Der Verwaltungsrat genehmigt ferner den Prospekt und etwaige Ergänzungen dazu, Schreiben an Anteilinhaber, Abschlüsse und alle anderen wichtigen rechtlichen Dokumente.

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

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

Versicherung

Die Gesellschaft hat eine Organhaftpflichtversicherung mit angemessener Deckung abgeschlossen.

Übertragung von Aufgaben

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

Verwaltung und Administration

Der Verwaltungsrat hat die Anlageverwaltung, die Administration, die Vermarktung und den Vertrieb der

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

Die Verwaltungsgesellschaft hat die Verwaltung des Anlageportfolios an die Anlageberater übertragen. Die Anlageberater arbeiten nach den vom Verwaltungsrat bestimmten Richtlinien, die im Prospekt der Gesellschaft für deren Fonds ausführlich beschrieben sind. Die jeweiligen Anlageberater tragen die direkte Verantwortung für Entscheidungen im Tagesgeschäft der Fonds der Gesellschaft und legen gegenüber der Verwaltungsgesellschaft Rechenschaft über die Wertentwicklung der Fonds ab. Ferner hat der Verwaltungsrat die Ausübung der Stimmrechte, die mit den im Portfolio enthaltenen Wertpapieren verbunden sind, an die jeweiligen Anlageberater übertragen, die diese wiederum an BlackRock Investment Management (UK) Limited („BIM UK“) übertragen können. Die Ausübung von Stimmrechten im Namen der Anteilinhaber erfolgt in einer Weise, die als im besten wirtschaftlichen Interesse von langfristig orientierten Anlegern betrachtet wird.

Die Verwaltungsgesellschaft hat ihre Pflichten zur Administration der Gesellschaft und ihrer Fonds an State Street Bank International GmbH, Zweigstelle Luxemburg, übertragen (der „Fondsverwalter“). Der Fondsverwalter ist für die Verwaltung der Geschäfte der Gesellschaft verantwortlich, einschließlich Berechnung des Nettoinventarwerts und Erstellung des Abschlusses der Gesellschaft, wobei er der grundsätzlichen Überwachung durch die Verwaltungsgesellschaft unterliegt. Der Fondsverwalter ist eine Tochtergesellschaft von State Street Bank & Trust Co.

Die Verwaltungsgesellschaft hat ihre Aufgaben als Übertragungs- und Registerstelle an J.P. Morgan SE, Zweigniederlassung Luxemburg übertragen.

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

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

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

Die Verwaltungsgesellschaft ist für das Risikomanagement und die internen Kontrollen der Gesellschaft und die Überprüfung ihrer Wirksamkeit verantwortlich. Dadurch soll sichergestellt

Bericht des Verwaltungsrats Fortsetzung

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

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

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

Finanzberichterstattung

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

Vergütungspolitik

Die Gesellschaft ist eine Investmentgesellschaft ohne Mitarbeiter oder geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder. Kein (derzeitiges oder früheres) Verwaltungsratsmitglied hat Anspruch auf eine Pension von der Gesellschaft, und die Gesellschaft gewährt weder Aktienoptionen noch langfristige Leistungsanreize. Die Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder enthält keine erfolgsabhängige Komponente. Die Verwaltungsratsmitglieder, die auch Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe sind, haben keinen Anspruch auf eine Vergütung für ihre Tätigkeit im Verwaltungsrat. Alle anderen Verwaltungsratsmitglieder erhalten eine Vergütung, deren Höhe die Anteilinhaber bei der Jahreshauptversammlung beschließen und die auf Seite 610 angegeben ist. Der Verwaltungsrat ist der Auffassung, dass die Höhe der Vergütung dieser Verwaltungsratsmitglieder ihre zeitliche Verpflichtung und ihre Verantwortung angemessen widerspiegelt. Der Verwaltungsrat hält die Vergütung angesichts der Größe, Komplexität und der Bandbreite der verwalteten Fonds für fair und angemessen. Die Obergrenze für die Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder wird vom Verwaltungsrat beschlossen.

Kommunikation mit Anteilhabern

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

Die nächste Jahreshauptversammlung der Anteilinhaber wird am Donnerstag, den 24. November 2022 abgehalten, und die Anteilinhaber werden gebeten, die üblichen Angelegenheiten, die bei dieser Versammlung vorgestellt werden, zu prüfen, einschließlich:

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

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

Bericht des Verwaltungsrats Fortsetzung

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

Biografien der Mitglieder des Verwaltungsrats

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

Geoffrey D. Radcliffe (britische und luxemburgische Staatsbürgerschaft, wohnhaft in Luxemburg): Geoffrey Radcliffe ist als Managing Director für BlackRock in Luxemburg tätig. Er ist Mitglied von BlackRock Business Operations & Technology, des Global Accounting und Product Services Teams und leitet die Abteilungen Product Oversight, Governance International und Alternatives International für BlackRock EMEA- sowie die Asien-Pazifik-Region. Geoffrey Radcliffe ist Fellow beim Institute of Chartered Accountants in England and Wales und Associate beim Chartered Institute of Bankers. Er verfügt über eine mehr als 30-jährige Erfahrung in den Bereichen Anlagefonds, Wirtschaftsprüfung und Banking in verschiedenen Positionen in Luxemburg, Bermuda, London und Isle of Man. Geoffrey Radcliffe kam 1998 zur BlackRock-Gruppe. Er ist Vorsitzender des Verwaltungsrats der BlackRock Luxembourg S.A. und BlackRock Fund Management Company S.A. und Mitglied der Verwaltungsräte einiger Anlagefonds von BlackRock. Er ist seit 2013 Mitglied des Verwaltungsrats von ALFI (Luxembourg Fund Industry Association).

Paul Freeman (Brite): Herr Freeman ist ein nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied mit über 40 Jahren Erfahrung in der Anlageverwaltungsbranche. Derzeit ist er Verwaltungsratsmitglied bei einer Reihe von Sondervermögen mit Sitz in Luxemburg und auf den Kaimaninseln. Bis April 2022 war er nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied einer Reihe von Tochterunternehmen der BlackRock-Gruppe in Irland, einschließlich der OGAW/ AIFM-Verwaltungsgesellschaft, für die er auch Vorsitzender

des Investment Committees war. Bis Dezember 2015 war er Managing Director von BlackRock (er kam im August 2005 zur Gruppe). Zwischen Juli 2011 und Dezember 2015 arbeitete Paul Freeman eng mit dem Government Affairs Team von BlackRock zusammen und wirkte neben der Verwaltung von Fonds in verschiedenen internen Lenkungsausschüssen mit. Bis Juli 2011 war er Head of Product Development and Range Management für die EMEA-Region, wo er für die Entwicklung und laufende Produktverwaltung aller in der EMEA-Region ansässigen und von BlackRock grenzübergreifend vertriebenen Fonds verantwortlich zeichnete. Vor seiner Zeit bei BlackRock bekleidete Herr Freeman Führungspositionen bei Schroders, Rothschild Asset Management, Henderson Investors und GT Management (inzwischen zu Invesco gehörend). Paul Freeman ist Chartered Accountant.

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

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

Vergütungsbericht (ungeprüft)

Die nachfolgenden Informationen beziehen sich auf die Vergütungspolitik der BlackRock-Gruppe („BlackRock“), die für BlackRock (Luxembourg) S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“) gilt. Die Offenlegung der Informationen erfolgt in Übereinstimmung mit der Richtlinie 2009/65/EG zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) in ihrer jeweils aktuellen Fassung, einschließlich der Richtlinie 2014/91/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. Juli 2014 (die „Richtlinie“) und den von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) veröffentlichten „Guidelines on sound remuneration policies under the UCITS Directive and AIFMD“.

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

Die Verwaltungsgesellschaft hat die nachfolgend zusammengefasste OGAW-Vergütungspolitik verabschiedet.

Vergütungs-Governance

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

(a) MDCC

Die Aufgaben des MDCCs umfassen:

Aufsicht über:

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

- ▶ die Überprüfung und Erörterung der Ausführungen und Analysen zur Vergütung im jährlichen Proxy Statement von BlackRock, Inc. mit dem Management und Genehmigung der Aufnahme des MDCC-Berichts in das Proxy Statement;

- ▶ soweit angemessen, die Überprüfung, die Beurteilung und die Erstellung von Berichten und Empfehlungen für den Verwaltungsrat (Board of Directors) der BlackRock, Inc. („Verwaltungsrat der BlackRock, Inc.“) zur Nachwuchsförderung und Nachfolgeplanung bei BlackRock,

mit Schwerpunkt auf der Leistungsanerkennung und Nachfolgeregelung auf den höchsten Management-Ebenen; und

- ▶ die Unterstützung der Geschäftsleitungen der in der EMEA-Region regulierten Unternehmen bei der Einhaltung ihrer gesetzlichen Verpflichtungen im Zusammenhang mit der Vergütung durch die Überwachung der Gestaltung und der Implementierung der EMEA-Vergütungsrichtlinie.

Das MDCC arbeitet direkt mit dem unabhängigen Vergütungsberater Semler Brossy Consulting Group LLC zusammen, der in keiner Beziehung zu BlackRock, Inc. oder zum Verwaltungsrat der BlackRock, Inc. steht, welche seine unabhängige Beratung des MDCC in Vergütungsangelegenheiten beeinträchtigen würde.

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

2021 kam das MDCC zu 8 Sitzungen zusammen. Die Statuten des MDCC sind auf der Website der BlackRock, Inc. (www.blackrock.com) abrufbar.

Durch seine regelmäßigen Prüfungen ist das MDCC weiterhin mit den Grundsätzen der Politik und des Ansatzes von BlackRock hinsichtlich der Vergütung zufrieden.

(b) Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

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

Entscheidungsprozess

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

Für die Festlegung der jährlichen Boni werden keine Formeln und keine festen Benchmarks verwendet. In die Festlegung der individuellen Vergütung fließen verschiedene Faktoren ein, wie nicht-finanzielle und andere Unternehmensziele sowie das gesamte Geschäfts- und Anlageergebnis. Diese Ergebnisse werden in ihrer Gesamtheit ohne spezielle Gewichtung betrachtet und es besteht kein direkter Zusammenhang zwischen einzelnen Leistungsbestandteilen und der Höhe des jährlichen Bonus. Die variable Vergütung, die einzelnen Mitarbeitern für ein bestimmtes Leistungsjahr zuerkannt wird, kann auch null sein.

Vergütungsbericht (ungeprüft) Fortsetzung

Die jährlichen Boni werden aus einem Bonuspool gezahlt.

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

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

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

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

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

Kontrollfunktionen

Jede der Kontrollfunktionen (Enterprise Risk, Legal & Compliance und Internal Audit) hat ihre eigene von den Geschäftsbereichen unabhängige Organisationsstruktur. Der Leiter jeder Kontrollfunktion ist entweder Mitglied des Global Executive Committee („GEC“) oder des globalen Managementkomitees oder hat eine Berichtspflicht gegenüber dem Verwaltungsrat der BlackRock Group Limited, der Muttergesellschaft der regulierten EMEA-Unternehmen von BlackRock, einschließlich der Verwaltungsgesellschaft.

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

Zusammenhang zwischen Bezahlung und Leistung

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

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

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

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

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

Vergütungsbericht (ungeprüft) Fortsetzung

- ▶ die Leistung der Verwaltungsgesellschaft, der von der Verwaltungsgesellschaft verwalteten Fonds und/oder der betreffenden Funktion;
- ▶ für einen Mitarbeiter individuell relevante Faktoren; Beziehungen zu Kunden und Kollegen; Teamarbeit; Fähigkeiten; etwaige Verhaltensprobleme; und, vorbehaltlich geltender Grundsätze, potenzielle Auswirkungen, die eine Beurlaubung auf den Beitrag zum Geschäft gehabt haben könnte;
- ▶ Risikosteuerung im Rahmen der für Kunden von BlackRock angemessenen Risikoprofile;
- ▶ strategische Geschäftsanforderungen, unter anderem Pläne zur Mitarbeiterbindung;
- ▶ Marktwissen; und
- ▶ Bedeutung für das Geschäft.

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

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

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

Ermessensabhängige Bonuszahlungen für alle Mitarbeiter, einschließlich Führungskräften, unterliegen einer Richtlinie, welche die Bar- und die BlackRock-Aktienkomponente der Bonuszahlung bestimmt und darüber hinaus zusätzliche Erdienungs-/Rückforderungsbedingungen festlegt. Die Zuerkennung von Aktien erfolgt vorbehaltlich einer weiteren

Beurteilung der Wertentwicklung aufgrund der Veränderung des Aktienkurses der BlackRock, Inc. im Erdienungszeitraum. Mit der jährlichen Gesamtvergütung steigt auch die Aktienkomponente. Das MDCC hat diesen Ansatz 2006 beschlossen, um die Mitarbeiter stärker an das Unternehmen zu binden und das Vergütungspaket für entsprechende Mitarbeiter, wie Führungskräfte, stärker an den Interessen der Aktionäre auszurichten. Die Aktienkomponente wird in drei gleichmäßigen Raten über einen Zeitraum von drei Jahren nach Gewährung übertragen.

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

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

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

Ausgewiesene Mitarbeiter

Die OGAW-Vergütungsrichtlinie legt das Verfahren fest, das zur Identifizierung von Mitarbeitern, d.h. Kategorien von Mitarbeitern der Verwaltungsgesellschaft, verwendet wird, darunter Führungskräfte, Risikoträger, Kontrollfunktionen und andere Mitarbeiter, die sich aufgrund Ihrer Gesamtvergütung in derselben Einkommensstufe befinden wie die Geschäftsleitung

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

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

Vergütungsbericht (ungeprüft) Fortsetzung

und Risikoträger und deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf die Risikoprofile der Verwaltungsgesellschaft oder der von ihr verwalteten Fonds haben.

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

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

Quantitative Offenlegung der Vergütung

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

Offenlegungen werden vorgenommen in Bezug auf (a) die Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft; (b) Mitglieder der Geschäftsleitung; und (c) Mitarbeiter, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der Gesellschaft haben, einschließlich Personen, die, wenn sie auch nicht direkt von der Verwaltungsgesellschaft beschäftigt sind, von ihrem Arbeitgeber damit beauftragt sind, Leistungen direkt für die Verwaltungsgesellschaft zu erbringen.

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

Mitarbeiter und Mitglieder der Geschäftsleitung der Verwaltungsgesellschaft erbringen üblicherweise sowohl OGAW-bezogene Leistungen als auch Leistungen ohne Bezug zu OGAW im Zusammenhang mit mehreren Fonds, Kunden und Funktionen der Verwaltungsgesellschaft und im Rahmen der breiteren BlackRock-Gruppe. Die offengelegten Werte stellen daher eine Summe jedes individuellen Anteils der Vergütung dar, der der Verwaltungsgesellschaft entsprechend einer objektiven Zurechnungsmethode, die das breit gefächerte Leistungsspektrum der Verwaltungsgesellschaft berücksichtigt, zugewiesen werden kann. Entsprechend drücken die Werte nicht die tatsächliche Vergütung einer Person oder deren Vergütungsstruktur aus.

Der Betrag der Gesamtvergütung der Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft, die dem OGAW-bezogenen Geschäft der Verwaltungsgesellschaft im am 31. Dezember 2021 endenden Geschäftsjahr zugewiesen wurde, beläuft sich auf 150,7 Mio. USD. Dieser Wert setzt sich aus einer festen Vergütung in Höhe von 13,6 Mio. USD und einer variablen Vergütung in Höhe von 137,1 Mio. USD zusammen. Diese Vergütung nach den oben beschriebenen Vorgaben erfolgte an insgesamt 163 Mitarbeiter.

Der Betrag der aggregierten Vergütung der Mitglieder der Geschäftsleitung der Verwaltungsgesellschaft, die dem OGAW-bezogenen Geschäft der Verwaltungsgesellschaft im am 31. Dezember 2021 endenden Geschäftsjahr zugewiesen wurde, beläuft sich auf 0,3 Mio. USD, die Vergütung der anderen Mitarbeiter, deren Tätigkeiten wesentliche Auswirkungen auf das Risikoprofil der Gesellschaft haben, betrug 150,4 Mio. USD.

Zusammensetzung des Nettofondsvermögens

zum 31. Mai 2022

| | | BlackRock Strategic Funds Kombiniert | BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund | BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund | BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund |
|---|----------------|--|--|---|---|--|
| | Anmerkung | USD | USD | USD | USD | EUR |
| Aktiva | | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 21.871.051.243 | 783.719.738 | 51.277.763 | 33.411.215 | 1.002.885.949 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/ (-verlust) | | (524.570.472) | (977.992) | (1.212.243) | 79.850 | 80.554.670 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 21.346.480.771 | 782.741.746 | 50.065.520 | 33.491.065 | 1.083.440.619 |
| Bankguthaben | 2(a) | 788.423.603 | 6.707.264 | 2.874.866 | 2.472.280 | 26.907.144 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | 564.827.696 | 6.039.854 | 806.767 | 199.079 | 24.585.579 |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 89.199.306 | 162.328 | 91.267 | 333.110 | 1.277.486 |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 1.033.970.524 | 430.045.880 | 2.735.585 | 11.076.578 | 9.378.178 |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 50.655.163 | 1.712.295 | — | 10.400 | 1.961.074 |
| Nicht realisierter Nettowertzuwachs aus: | | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 121.854.080 | — | 26.006 | — | 2.094.668 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 165.683.679 | 7.062.521 | 29.441 | 192.230 | 2.640.487 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 283.510.041 | 136.149.849 | 216.943 | 4.045.497 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | 6.739.731 | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 114.947.464 | — | — | — | 537.273 |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | 5.526.754 | — | — | — | — |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 2.830.959 | — | 98 | — | 24.402 |
| Gesamt Fondsvermögen | | 24.574.649.771 | 1.370.621.737 | 56.846.493 | 51.820.239 | 1.152.846.910 |
| Verbindlichkeiten | | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | 138.492.125 | 409 | 2.233.606 | 1.882.214 | 540.335 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 104.014.850 | — | 1.442.007 | 125.045 | 1.077.053 |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | 20.852.884 | 6.276.311 | 79.203 | 262.272 | 159.051 |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 1.112.872.501 | 436.660.760 | 751.515 | 10.814.740 | 891.859 |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 55.163.153 | 514.439 | — | — | 1.196.360 |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | 8.139.279 | — | — | — | — |
| Nicht realisierter Nettowertverlust aus: | | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 45.291.049 | — | 162.746 | 63.240 | 7.359.619 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 86.980.330 | 505.669 | 2.050 | 14.245 | 5.251.677 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 264.510.639 | 138.127.132 | 2.033.028 | 4.035.391 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | 6.071.001 | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 271.790.575 | — | — | — | 6.445.300 |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | 8.544.283 | — | — | — | — |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 45.739.329 | 3.297.252 | 109.421 | 181.756 | 929.825 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 2.168.461.998 | 585.381.972 | 6.813.576 | 17.378.903 | 23.851.079 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 22.406.187.773 | 785.239.765 | 50.032.917 | 34.441.336 | 1.128.995.831 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammensetzung des Nettofondsvermögens

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | | BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund |
|---|----------------|---|--|---|--|
| | Anmerkung | GBP | USD | USD | USD |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 624.801.166 | — | 464.267.949 | 1.279.849.545 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/ (-verlust) | | (23.708.886) | — | (122.529.272) | (274.452.453) |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 601.092.280 | — | 341.738.677 | 1.005.397.092 |
| Bankguthaben | 2(a) | 50.966.868 | — | 3.484.484 | 59.152.032 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | 25.937.378 | 47.000 | 19.138.549 | 28.265.780 |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 247.415 | — | 1.609.719 | 19.686.577 |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 31.081.567 | — | 25.668.880 | 43.718.995 |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | — | — | 31.045 | 76.121 |
| Nicht realisierter Nettowertzuwachs aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | — | — | 4.966.223 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 420.006 | — | 286.307 | 24.548.373 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 28.670.939 | — | 11.775.868 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | 23.217.291 |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | 877.150 |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | — | — | 18.117 | 16.091 |
| Gesamt Fondsvermögen | | 738.416.453 | 47.000 | 403.751.646 | 1.209.921.725 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | 57.234 | 23.072 | 16.530.702 | 15.482.240 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 49 | — | 26.986 | 25.456.410 |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | 527.843 | — | 243.950 | 506.616 |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 112.746.328 | — | 16.058.382 | — |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | — | — | 57.652 | 108.260 |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | — | — | 57 | 432.657 |
| Nicht realisierter Nettowertverlust aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 6.073.436 | — | 704.446 | 456.346 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 4.233.573 | — | 43.177 | 16.419.214 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 13.351.378 | — | 12.540.335 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | 12.400.689 |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | 252.352 |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 2.128.739 | 23.928 | 1.225.219 | 495.390 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 139.118.580 | 47.000 | 47.430.906 | 72.010.174 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 599.297.873 | — | 356.320.740 | 1.137.911.551 |

⁽¹⁾ Der Fonds wurde aufgelöst, Näheres hierzu siehe Anmerkung 1.

Zusammensetzung des Nettofondsvermögens

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | | BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | BlackRock ESG Euro Bond Fund | BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund | BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund |
|---|----------------|---|---------------------------------|---|---|
| | Anmerkung | USD | EUR | EUR | EUR |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 103.650.204 | 564.825.653 | 274.322.940 | 161.339.594 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/ (-verlust) | | (16.304.571) | (51.588.923) | (21.961.647) | (5.518.677) |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 87.345.633 | 513.236.730 | 252.361.293 | 155.820.917 |
| Bankguthaben | 2(a) | 7.214.225 | 1.754.970 | 2.011.665 | 262.721 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | 3.373.074 | 7.147.289 | 4.266.663 | 1.602.127 |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 1.181.958 | 2.009.700 | 1.411.942 | 593.072 |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 411.590 | 7.580.742 | 4.237.736 | 3.986.091 |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 6.320 | 673.714 | 41.000 | 110.971 |
| Nicht realisierter Nettowertzuwachs aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 650.418 | 1.679.425 | 1.437.517 | 2.041.586 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 532.193 | 593.409 | 159.992 | 181.380 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 226.601 | 678.115 | 500.871 | 207.902 |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | 12.249 | 134.625 | 3.736 |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 2.933 | 4.159 | 8.998 | 16.203 |
| Gesamt Fondsvermögen | | 100.944.945 | 535.370.502 | 266.572.302 | 164.826.706 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | 330.225 | 2.650.324 | 1.804.493 | 1.725.391 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 700.551 | 630.042 | 1.099.915 | 743.839 |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | 61.141 | — | — | — |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | — | 6.796.124 | 1.831.986 | 1.350.195 |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 54.208 | 321.022 | 4.452 | — |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | — | — | 10 | — |
| Nicht realisierter Nettowertverlust aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | 1.210.508 | 278.432 | 619.407 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 878.833 | 454.977 | 294.453 | 125.649 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 2.563.575 | 4.789.612 | 2.327.177 | 1.345.043 |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | 4.714 | 607.779 | 1.438 |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 60.568 | 329.647 | 171.702 | 102.919 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 4.649.101 | 17.186.970 | 8.420.399 | 6.013.881 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 96.295.844 | 518.183.532 | 258.151.903 | 158.812.825 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammensetzung des Nettofondsvermögens

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | | BlackRock European Absolute Return Fund | BlackRock European Opportunities Extension Fund | BlackRock European Select Strategies Fund | BlackRock European Unconstrained Equity Fund |
|---|----------------|--|---|--|--|
| | Anmerkung | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 1.488.709.646 | 441.529.126 | 388.601.222 | 52.270.600 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/ (-verlust) | | 80.808.823 | 160.333.557 | (15.337.044) | 6.767.798 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 1.569.518.469 | 601.862.683 | 373.264.178 | 59.038.398 |
| Bankguthaben | 2(a) | 11.106.153 | 2.644.328 | 1.940.648 | 124.320 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | 22.696.241 | 10.404.522 | 5.894.709 | — |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 2.396.744 | 2.475.456 | 2.037.660 | 40.892 |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 68.176.646 | 6.704.205 | 8.342.723 | — |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 6.714.024 | 476.256 | 270.779 | 470 |
| Nicht realisierter Nettowertzuwachs aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | — | 2.821.612 | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 361.547 | 78.503 | 1.327.226 | 21.696 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 15.989.414 | 7.702.501 | 33.294 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | 1.078.171 | — |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | 186.334 | — |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 10.026 | 3.329 | 4.628 | 352 |
| Gesamt Fondsvermögen | | 1.696.969.264 | 632.351.783 | 397.201.962 | 59.226.128 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | 2.346.568 | 13.015 | 1.731.571 | — |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 30.375 | 4.491 | 7.896 | — |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | 6.186.535 | 69.599 | 32.815 | — |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 108.704.786 | 15.003.353 | 4.387.195 | — |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 2.126.667 | 2.021.425 | 1.704.141 | 22.091 |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | — | 269.541 | 22.878 | — |
| Nicht realisierter Nettowertverlust aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | — | 1.311.332 | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 1.678.581 | 33.844 | 714.099 | 46.187 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 33.316.910 | 8.799.595 | 191.883 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | 4.452.671 | — |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | 137.185 | — |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 12.694.940 | 1.781.169 | 596.907 | 86.807 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 167.085.362 | 27.996.032 | 15.290.573 | 155.085 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 1.529.883.902 | 604.355.751 | 381.911.389 | 59.071.043 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammensetzung des Nettofondsvermögens

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | | BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund | BlackRock Fixed Income Strategies Fund | BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | BlackRock Global Equity Absolute Return Fund |
|---|----------------|--|---|--|---|
| | Anmerkung | EUR | EUR | EUR | USD |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 384.647.625 | 4.262.683.726 | 137.877.112 | 63.777.518 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/ (-verlust) | | (35.801.914) | (253.026.481) | (5.364.874) | (5.538.579) |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 348.845.711 | 4.009.657.245 | 132.512.238 | 58.238.939 |
| Bankguthaben | 2(a) | 9.418.209 | 110.699.496 | 18.360.883 | 6.854.086 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | 8.686.411 | 279.859.223 | 7.441.699 | 2.121.923 |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 2.413.643 | 27.948.484 | 1.178.420 | 69.057 |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 2.208.944 | 202.339.938 | 6.211.385 | 428.356 |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 260.084 | 9.353.022 | 282.114 | — |
| Nicht realisierter Nettowertzuwachs aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 13.150.758 | 66.814.285 | 1.421.751 | 74.100 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 503.804 | 33.531.481 | 911.323 | 304.410 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | — | — | 1.012.212 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | 6.291.464 | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 2.495.507 | 70.122.362 | 4.395.757 | — |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | 1.103.016 | 2.589.768 | 310.626 | — |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 14.844 | 59.854 | 37.403 | — |
| Gesamt Fondsvermögen | | 389.100.931 | 4.812.975.158 | 179.355.063 | 69.103.083 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | — | 82.328.236 | 1.394.148 | 1.490 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 11.424.918 | 39.902.883 | 1.324.476 | 399.408 |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | 69 | — | 1.215 | 224.337 |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 3.071.861 | 74.831.987 | 6.652.824 | 873 |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 431.887 | 27.820.141 | 1.734 | 288.125 |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | 4 | 2.372.424 | 5.040 | — |
| Nicht realisierter Nettowertverlust aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 374.126 | 13.598.148 | 393.593 | 772.392 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 420.238 | 24.742.831 | 1.866.597 | 468.936 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 33.956 | — | — | 904.239 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | 5.667.212 | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 4.583.651 | 202.535.529 | 6.379.199 | — |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | 799.664 | 1.814.227 | 119.522 | — |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 187.717 | 4.420.980 | 395.890 | 29.282 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 21.328.091 | 474.367.386 | 24.201.450 | 3.089.082 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 367.772.840 | 4.338.607.772 | 155.153.613 | 66.014.001 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammensetzung des Nettofondsvermögens

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | | BlackRock Global Event Driven Fund | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive |
|---|----------------|---------------------------------------|--|---|--|
| | Anmerkung | USD | USD | EUR | EUR |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 5.121.501.683 | 813.863.313 | 89.940.383 | 157.919.333 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/ (-verlust) | | 8.966.481 | (44.870.792) | 2.508.877 | (385.350) |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 5.130.468.164 | 768.992.521 | 92.449.260 | 157.533.983 |
| Bankguthaben | 2(a) | 364.930.002 | 24.142.305 | 61.666 | 190.653 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | 21.013.587 | 28.259.387 | — | — |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 12.584.691 | 2.539.575 | — | — |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 106.341.183 | 2.799.535 | 452.115 | — |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 6.343.819 | 12.055.132 | 132.362 | 1.081.473 |
| Nicht realisierter Nettowertzuwachs aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 15.748.798 | — | — | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 68.106.053 | 862.578 | 633.374 | 1.428.184 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 44.495.192 | 446.588 | — | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | — |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | — |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 128.819 | 7.398 | 1.889 | 4.289 |
| Gesamt Fondsvermögen | | 5.770.160.308 | 840.105.019 | 93.730.666 | 160.238.582 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | 34.352 | — | 27.283 | — |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 1.254 | — | — | — |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | 5.116.125 | — | — | — |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 188.990.769 | 3.799.218 | 541.828 | 1.065.426 |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 12.750.505 | 249.704 | 28.342 | 104.497 |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | — | 4.785.365 | 560 | 5.031 |
| Nicht realisierter Nettowertverlust aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 11.572.425 | 505.962 | 230.334 | 886.830 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 32.325.260 | — | — | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 2.413.421 | — | — | — |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | 4.559.129 | — | — |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 6.896.740 | 926.910 | 90.215 | 119.798 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 260.100.851 | 14.826.288 | 918.562 | 2.181.582 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 5.510.059.457 | 825.278.731 | 92.812.104 | 158.057.000 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammensetzung des Nettofondsvermögens

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | | BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | BlackRock Style Advantage Fund | BlackRock Style Advantage Screened Fund ⁽¹⁾ |
|---|----------------|---|---|-----------------------------------|--|
| | Anmerkung | EUR | EUR | USD | USD |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 431.337.102 | 761.867.854 | 91.021.121 | — |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/ (-verlust) | | 11.054.133 | 17.329.042 | (91.071) | — |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 442.391.235 | 779.196.896 | 90.930.050 | — |
| Bankguthaben | 2(a) | 357.365 | 474.219 | 15.056.264 | 106.451 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | — | — | 13.251.129 | — |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 824 | — | 544.977 | — |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 964.369 | — | 13.508.408 | — |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 2.540.316 | 3.615.050 | 3.674 | — |
| Nicht realisierter Nettowertzuwachs aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | — | 2.174.691 | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 3.183.588 | 6.166.203 | 7.221.055 | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | — | 4.961.698 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | 5.786.477 | — |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | — |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 2.487 | 5.217 | 2.327.991 | — |
| Gesamt Fondsvermögen | | 449.440.184 | 789.457.585 | 155.766.414 | 106.451 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | — | — | 78.045 | — |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | — | — | 2.812.833 | — |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | — | — | 207.198 | — |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 2.964.283 | 1.782.056 | 11.316.481 | — |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 252.979 | 1.536.462 | 201.646 | — |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | 3.909 | 47.511 | — | — |
| Nicht realisierter Nettowertverlust aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | — | 3.134.806 | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 1.061.871 | 2.577.607 | 5.938.154 | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | — | 5.815.001 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | 4.963.563 | — |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | — |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 353.386 | 566.548 | 300.650 | 106.451 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 4.636.428 | 6.510.184 | 34.768.377 | 106.451 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 444.803.756 | 782.947.401 | 120.998.037 | — |

⁽¹⁾ Der Fonds wurde aufgelöst, Näheres hierzu siehe Anmerkung 1.

Zusammensetzung des Nettofondsvermögens

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | | BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | BlackRock Systematic Global Equity Fund | BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund | BlackRock Total Advantage Fund ⁽¹⁾ |
|---|----------------|---|--|--|--|
| | Anmerkung | USD | USD | USD | EUR |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 436.651.655 | 146.954.143 | 49.843.033 | — |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/ (-verlust) | | (1.981.482) | (3.442.552) | (73.059) | — |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 434.670.173 | 143.511.591 | 49.769.974 | — |
| Bankguthaben | 2(a) | 4.544.624 | 1.865.365 | 5.093.949 | 21.979 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | 64.172 | 25.026 | 128.244 | — |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 727.504 | 372.918 | 37.312 | — |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 2.277 | 1.361 | 10.204.198 | — |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 751.519 | 6.197 | 185.651 | — |
| Nicht realisierter Nettowertzuwachs aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 156.622 | 46.462 | 32.519 | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 78.182 | 5.992 | 494.453 | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | — | 3.999.978 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | — |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | — |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 7.549 | 2.985 | 106.784 | — |
| Gesamt Fondsvermögen | | 441.002.622 | 145.837.897 | 70.053.062 | 21.979 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | 11 | 380.072 | 143.891 | — |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 7 | 6 | 119.751 | — |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | — | 8 | 83.888 | — |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | — | — | 12.095.545 | — |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 367.222 | 238.465 | 70.903 | — |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | — | — | — | — |
| Nicht realisierter Nettowertverlust aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | — | 8.681 | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 1.231 | 1.120 | 32.950 | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | — | 4.165.524 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | — |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | — |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 262.996 | 111.500 | 850.585 | 21.979 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 631.467 | 731.171 | 17.571.718 | 21.979 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 440.371.155 | 145.106.726 | 52.481.344 | — |

⁽¹⁾ Der Fonds wurde aufgelöst, Näheres hierzu siehe Anmerkung 1.

Zusammensetzung des Nettofondsvermögens

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | Anmerkung | BlackRock UK Equity Absolute Return Fund GBP |
|---|----------------|---|
| Aktiva | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 229.278.189 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/ (-verlust) | | (442.144) |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 228.836.045 |
| Bankguthaben | 2(a) | 16.006.297 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | 8.190.050 |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 1.622.755 |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 3.554.291 |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | — |
| Nicht realisierter Nettowertzuwachs aus: | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 18.859 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 11.833.141 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | — |
| Gesamt Fondsvermögen | | 270.061.438 |
| Verbindlichkeiten | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | 701 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 10.070.000 |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | 173.594 |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 35.104.817 |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 10.171 |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | — |
| Nicht realisierter Nettowertverlust aus: | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 4.294.055 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 1.591.435 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 1.904.395 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 2.940.892 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 56.090.060 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 213.971.378 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2022

| | Währung | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 | 31. Mai 2020 |
|--|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 785.239.765 | 687.136.883 | 937.142.511 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Auf AUD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A | AUD | 196,95 | 170,72 | 207,03 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 110,40 | 90,95 | 103,78 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | SEK | 127,86 | 120,10 | 125,53 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | USD | 140,36 | 131,19 | 136,43 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | EUR | 125,00 | 117,77 | 123,55 |
| Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | GBP | 176,88 | 146,85 | 175,23 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | USD | 121,08 | 113,03 | 116,95 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | CHF | 104,97 | 98,68 | 103,32 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 130,21 | 122,08 | 127,47 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 116,74 | 108,83 | 112,83 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 99,57 | 94,29 | 99,43 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 106,67 | 99,92 | 104,03 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | JPY | 10.325,84 | 9.650,34 | 10.001,49 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | SEK | 99,60 | 92,79 | 96,24 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | USD | 115,33 | 107,53 | 110,94 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | USD | 175,18 | 160,83 | 164,27 |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 50.032.917 | 34.677.165 | 30.464.640 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | EUR | 109,36 | 104,61 | 92,79 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 125,85 | 104,88 | 101,49 |
| Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | GBP | 119,39 | 100,65 | 101,81 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | USD | 124,50 | 117,65 | 103,93 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 130,21 | 108,33 | 104,66 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 112,73 | 107,49 | 95,06 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | GBP | 116,56 | 110,23 | 97,58 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 123,04 | 102,93 | 99,77 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 108,14 | 103,96 | 92,26 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | USD | 137,75 | 127,23 | 108,88 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z | USD | 126,47 | 118,98 | 104,24 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | CHF | 112,58 | 106,88 | 94,23 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | EUR | 114,08 | 108,20 | 95,52 |
| BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 34.441.336 | 35.205.475 | 26.406.843 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 121,31 | 123,43 | 104,08 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 110,55 | 113,58 | 96,16 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | USD | 123,96 | 125,48 | 105,78 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 112,09 | 114,79 | 96,90 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 107,58 | 111,15 | 94,68 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | USD | 136,85 | 136,78 | 110,29 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | GBP | 102,86 | — | — |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | EUR | 116,52 | 118,53 | 99,38 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | USD | 127,67 | 128,61 | 107,15 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | GBP | 120,80 | 121,72 | 101,46 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 | 31. Mai 2020 |
|---|------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 1.128.995.831 | 1.229.637.507 | 1.034.442.870 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 122,66 | 132,13 | 118,63 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | SEK | 125,00 | 134,68 | 120,70 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse AI | EUR | 103,20 | 111,17 | 99,81 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 131,69 | 140,87 | 125,59 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 116,54 | 126,17 | 113,84 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 135,50 | 144,61 | 128,63 |
| Auf CAD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | CAD | 126,82 | 134,25 | 118,58 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | JPY | 10.997,03 | 11.674,51 | 10.348,04 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | SEK | 135,68 | 144,84 | 128,76 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | USD | 108,42 | 114,40 | 100,92 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 144,37 | 153,24 | 135,55 |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | GBP | 599.297.873 | 820.997.763 | 633.318.122 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | CHF | 99,15 | 119,18 | 108,27 |
| CNH-Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | CNH | 927,68 | 1.074,29 | — |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 102,32 | 122,72 | 111,34 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 103,37 | 123,18 | 110,86 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | GBP | 102,29 | 121,46 | 109,28 |
| Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D ⁽¹⁾ | AUD | 77,83 | — | — |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | CHF | 102,35 | 122,40 | 110,92 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 103,70 | 123,91 | 111,94 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 106,94 | 126,42 | 113,34 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | USD | 109,69 | 129,54 | 116,00 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | GBP | 101,05 | 119,14 | 106,51 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | CHF | 103,56 | 123,47 | 111,60 |
| Auf JPY lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I ⁽¹⁾ | JPY | 8.445,41 | — | — |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I ⁽¹⁾ | JPY | 7.890,36 | — | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | GBP | 108,33 | 127,60 | 114,10 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | EUR | 104,89 | 124,74 | 112,40 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | USD | 111,07 | 130,89 | 116,94 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status | GBP | 107,97 | 127,08 | 113,66 |
| Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X ⁽¹⁾ | AUD | 76,02 | — | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | GBP | 117,96 | 137,34 | 119,14 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | CHF | 104,76 | 124,83 | 112,30 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | GBP | 109,90 | 129,23 | 115,11 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | EUR | 106,22 | 126,27 | 113,26 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | USD | 112,81 | 132,40 | 117,81 |
| BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund⁽²⁾ | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | — | 12.621.637 | 14.513.860 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | GBP | — | 92,27 | 85,25 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | — | 100,11 | 91,79 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | — | 88,46 | 82,05 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | — | 96,65 | 88,78 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | USD | — | 107,80 | 98,42 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | — | 96,40 | 89,07 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | — | 85,29 | 79,52 |
| Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | GBP | — | 107,04 | 111,75 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | GBP | — | 82,87 | 75,99 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | — | 125,32 | 124,77 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | — | 101,01 | 91,46 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | USD | — | 94,97 | 86,39 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | USD | — | 108,38 | 97,57 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 | 31. Mai 2020 |
|---|------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 356.320.740 | 905.434.827 | 585.619.249 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 176,36 | 210,52 | 148,70 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | CHF | 83,18 | 101,30 | 72,45 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | USD | 91,86 | 110,47 | 78,17 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | CHF | 84,67 | 102,57 | 72,97 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 150,04 | 182,71 | 129,96 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | USD | 170,29 | 202,27 | 142,15 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 169,26 | 176,48 | 136,16 |
| Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 114,27 | 120,60 | 97,28 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 158,56 | 166,98 | 130,10 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | USD | 99,44 | 117,77 | 82,54 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 102,41 | 106,48 | 81,91 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | USD | 198,80 | 233,11 | 161,71 |
| Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse Z | GBP | 121,94 | 127,95 | 102,56 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | USD | 190,01 | 224,34 | 156,72 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 1.137.911.551 | 1.532.287.129 | 1.581.561.191 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | GBP | 74,12 | 85,81 | 85,60 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 106,38 | 120,50 | 114,76 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 93,21 | 107,00 | 103,00 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | SEK | 81,35 | 93,20 | 89,50 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | CHF | 80,85 | 92,83 | 89,38 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse AI | EUR | 88,45 | 101,48 | 97,66 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | USD | 81,67 | 93,57 | 93,54 |
| Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 87,14 | 87,64 | 96,17 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 73,99 | 86,04 | 86,93 |
| Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 85,29 | 87,40 | 100,04 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 73,52 | 85,19 | 84,91 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | USD | 114,18 | 128,37 | 121,33 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | CHF | 83,75 | 95,40 | 91,36 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 100,72 | 114,75 | 109,62 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | USD | 101,80 | 115,89 | 110,93 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 90,48 | 104,40 | 101,00 |
| Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse I | EUR | 83,65 | 83,93 | 92,17 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I | EUR | 72,64 | 85,06 | 85,63 |
| Auf EUR lautender Hedged ausschüttender Anteil (G) der Klasse I | EUR | 68,81 | 79,97 | 80,83 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | USD | 69,44 | 79,95 | 79,63 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 88,36 | 100,28 | 95,61 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | USD | 113,47 | 127,33 | 120,13 |
| Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse X | EUR | 84,59 | 85,05 | 93,30 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | USD | 125,56 | 139,82 | 130,92 |
| Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | AUD | 105,66 | 118,31 | 111,17 |
| Auf CAD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | CAD | 92,89 | 103,79 | 97,43 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 96.295.844 | 77.615.734 | 69.623.667 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 107,23 | 118,60 | 104,93 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse AI | EUR | 85,55 | 99,46 | 93,16 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse AI | EUR | 96,81 | 108,36 | 96,86 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | USD | 108,92 | 120,04 | 105,84 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 99,53 | 110,95 | 98,89 |
| Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse E | EUR | 103,91 | 104,67 | 106,49 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse E | EUR | 82,28 | 95,66 | 89,59 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 120,49 | 117,58 | 114,75 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 95,77 | 107,77 | 96,89 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 99,77 | 111,23 | 99,06 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | USD | 111,25 | 122,04 | 107,08 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 | 31. Mai 2020 |
|---|------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| BlackRock ESG Euro Bond Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 518.183.532 | 642.499.599 | 423.582.725 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | EUR | 92,48 | 104,01 | 103,56 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 92,55 | 104,09 | 103,63 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse AI | EUR | 91,90 | 103,36 | 102,93 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 94,40 | 105,81 | 104,98 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 89,90 | 101,62 | 101,70 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 95,19 | 106,54 | 105,55 |
| Ausschüttungsanteile (G) der Klasse X | EUR | 88,48 | 98,94 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 97,33 | 108,50 | 107,07 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z | EUR | 96,62 | 107,98 | 106,81 |
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 258.151.903 | 271.817.140 | 182.474.888 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 92,94 | 102,60 | 98,43 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A ⁽¹⁾ | SEK | 904,42 | — | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse AI | EUR | 92,08 | 101,65 | 97,51 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | EUR | 90,41 | 99,69 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 94,04 | 103,40 | 98,80 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 90,73 | 100,67 | 97,09 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 94,43 | 103,69 | 98,93 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I ⁽¹⁾ | SEK | 907,73 | — | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 95,53 | 104,47 | 99,28 |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 158.812.825 | 238.040.560 | — |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 95,66 | 99,62 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse AI | EUR | 95,62 | 99,62 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 96,07 | 99,72 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 95,10 | 99,50 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 96,15 | 99,74 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 96,64 | 99,85 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z | EUR | 96,46 | 99,81 | — |
| BlackRock European Absolute Return Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 1.529.883.902 | 1.528.371.943 | 1.263.445.114 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | EUR | 147,80 | 143,48 | 141,59 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 147,85 | 143,52 | 141,64 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | EUR | 152,91 | 147,83 | 145,45 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | CHF | 149,69 | 145,16 | 143,54 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 155,59 | 150,41 | 147,85 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 166,50 | 159,38 | 156,14 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | USD | 102,38 | 98,03 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 140,24 | 136,71 | 135,47 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | EUR | 159,24 | 153,57 | 150,59 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse S | EUR | 110,83 | 106,81 | 105,03 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 102,72 | 97,32 | — |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 604.355.751 | 660.042.096 | 827.548.340 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | GBP | 438,88 | 452,57 | 335,26 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 520,78 | 530,04 | 375,58 |
| Ausschüttungsanteile (G) der Klasse D | EUR | 189,38 | 193,51 | 137,68 |
| Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 454,24 | 465,61 | 343,60 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 541,89 | 548,87 | 387,37 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 494,65 | 505,90 | 359,94 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 288,48 | 291,50 | 205,25 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 346,05 | 346,17 | 237,37 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 | 31. Mai 2020 |
|---|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BlackRock European Select Strategies Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 381.911.389 | 485.703.169 | 524.910.242 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | EUR | 103,64 | 112,38 | 105,42 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 105,21 | 113,59 | 106,32 |
| Auf CZK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | CZK | 1.062,26 | 1.116,18 | 1.041,02 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse AI | EUR | 96,70 | 104,40 | 97,72 |
| Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D | USD | 114,90 | 122,89 | 114,19 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 109,58 | 117,60 | 109,42 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse E | EUR | 101,51 | 110,14 | 103,61 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 101,71 | 110,36 | 103,82 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse I | EUR | 101,97 | 110,57 | 103,82 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 106,99 | 114,61 | 106,43 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 115,52 | 123,00 | 113,57 |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 59.071.043 | 46.793.755 | 23.685.016 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 164,76 | 167,90 | 133,88 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 167,37 | 169,88 | 134,70 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 168,75 | 169,82 | 134,11 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 159,92 | 163,63 | 130,95 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | USD | 130,32 | 129,64 | 102,01 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | EUR | 168,67 | 170,39 | 135,17 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | GBP | 171,19 | 171,44 | 134,63 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | EUR | 183,82 | 184,49 | 144,91 |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 367.772.840 | 385.400.409 | 134.136.086 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | EUR | 97,67 | 103,33 | 98,63 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 97,67 | 103,33 | 98,63 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse AI | EUR | 96,85 | 102,49 | 97,84 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | EUR | 98,80 | 104,19 | 99,06 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 98,80 | 104,13 | 99,01 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 96,17 | 102,28 | 98,12 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 99,41 | 104,55 | 99,21 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 101,16 | 105,78 | 99,77 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 | 31. Mai 2020 |
|---|------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 4.338.607.772 | 5.676.286.758 | 6.110.615.059 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | EUR | 105,38 | 108,25 | 103,80 |
| Auf CHF lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | CHF | 101,18 | 104,12 | 100,07 |
| Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | USD | 117,76 | 119,73 | 113,77 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | CHF | 101,46 | 104,42 | 100,38 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | JPY | 10.121,78 | 10.484,10 | 10.012,68 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 118,18 | 120,15 | 114,18 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | EUR | 121,03 | 124,33 | 119,18 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | GBP | 107,82 | 109,80 | 104,59 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse AI | EUR | 100,73 | 103,48 | 99,23 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | EUR | 104,84 | 107,43 | 102,86 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 111,05 | 112,72 | 107,27 |
| Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | USD | 116,67 | 118,37 | 112,21 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | CHF | 103,93 | 106,55 | 102,05 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | USD | 120,82 | 122,38 | 115,83 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 127,14 | 130,08 | 124,27 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 113,65 | 115,29 | 109,40 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 113,78 | 117,47 | 113,23 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse I | EUR | 124,05 | 126,97 | 121,52 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 128,49 | 131,21 | 125,08 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | USD | 111,06 | 112,29 | 106,08 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse S ⁽¹⁾ | EUR | 99,92 | — | — |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S ⁽¹⁾ | USD | 100,12 | — | — |
| Ausschüttungsanteil der Klasse X | EUR | 102,80 | 105,35 | 100,85 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 138,28 | 140,37 | 133,00 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 155.153.613 | 159.454.244 | 135.075.502 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 101,23 | 105,63 | 100,01 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | SEK | 993,14 | 1.033,93 | 976,61 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 111,34 | 115,06 | 107,93 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D | GBP | 96,31 | 99,85 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 106,28 | 110,33 | 103,91 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | CHF | 98,07 | 103,08 | 96,83 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 96,47 | 101,15 | 96,21 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 103,06 | 106,78 | 100,37 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | GBP | 104,30 | 107,15 | 100,12 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | SEK | 1.029,15 | 1.064,15 | 997,97 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 114,58 | 118,12 | 110,47 |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 66.014.001 | 70.551.611 | 22.443.888 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | EUR | 90,26 | 117,04 | 99,47 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | USD | 97,24 | 123,66 | 103,99 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 104,25 | 116,29 | 107,26 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 100,79 | 113,65 | 105,79 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 101,24 | 112,64 | 103,47 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | USD | 105,47 | 132,41 | 106,39 |
| Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | AUD | 80,51 | 101,74 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z | USD | 99,36 | 125,79 | 104,52 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | CHF | 92,96 | 119,48 | 100,36 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | EUR | 93,60 | 120,23 | 100,87 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | GBP | 95,97 | 122,21 | 102,19 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 | 31. Mai 2020 |
|--|------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| BlackRock Global Event Driven Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 5.510.059.457 | 6.020.440.310 | 3.349.256.567 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | EUR | 106,78 | 112,56 | 103,29 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 127,55 | 132,75 | 120,60 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | CHF | 111,07 | 117,34 | 107,77 |
| HKD-Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | HKD | 1.055,06 | 1.100,63 | 998,17 |
| SGD-Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | SGD | 105,47 | 109,91 | 99,84 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | EUR | 111,24 | 117,25 | 107,49 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse AI | EUR | 103,26 | 108,86 | 99,58 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 103,26 | 107,41 | — |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | CHF | 113,95 | 119,78 | 109,57 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | USD | 131,06 | 135,72 | 122,77 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 115,07 | 120,69 | 110,19 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 119,97 | 124,81 | 113,39 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 133,00 | 122,12 | 122,27 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 111,01 | 117,60 | 108,27 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | USD | 122,68 | 126,67 | 114,31 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | EUR | 112,51 | 117,61 | 107,09 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | GBP | 116,03 | 120,37 | 109,09 |
| Auf BRL lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | BRL | 100,37 | 87,34 | 74,95 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | JPY | 11.290,43 | 11.717,71 | 10.621,44 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | USD | 121,45 | 125,40 | 113,16 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | CHF | 110,18 | 115,46 | 105,35 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | EUR | 117,33 | 122,71 | 111,76 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse IA | USD | 116,54 | 119,73 | 108,48 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse IA | EUR | 104,75 | 108,98 | 99,81 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse S | USD | 107,53 | 111,01 | 100,04 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S | EUR | 104,85 | 109,63 | 99,79 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | USD | 152,12 | 155,50 | 136,10 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | CHF | 120,68 | 126,22 | 114,32 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | USD | 137,52 | 141,69 | 127,06 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | EUR | 123,27 | 128,65 | 116,33 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | GBP | 129,41 | 133,95 | 120,64 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 825.278.731 | 315.221.465 | 96.029.475 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Auf CHF lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A ⁽¹⁾ | CHF | 89,86 | — | — |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | USD | 88,20 | 103,02 | 85,60 |
| Auf AUD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | AUD | 93,08 | — | — |
| Auf CAD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | CAD | 93,13 | — | — |
| Auf CNH lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | CNH | 932,30 | — | — |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | EUR | 84,76 | 100,71 | 84,20 |
| Auf HKD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | HKD | 88,47 | 103,65 | 86,81 |
| Auf SGD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | SGD | 87,70 | 102,79 | 86,32 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 129,27 | 138,79 | 105,27 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A ⁽¹⁾ | CHF | 90,89 | — | — |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A ⁽¹⁾ | EUR | 91,13 | — | — |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | USD | 90,04 | 104,42 | 86,68 |
| Auf SGD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | SGD | 85,63 | — | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | USD | 132,77 | 141,69 | 106,82 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 140,56 | 133,11 | 111,39 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I ⁽¹⁾ | EUR | 92,86 | — | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | USD | 92,40 | — | — |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | CHF | 91,24 | — | — |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | EUR | 91,43 | — | — |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | GBP | 91,67 | — | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | USD | 137,92 | 145,98 | 109,12 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | USD | 134,57 | 143,19 | 107,62 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 | 31. Mai 2020 |
|---|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 92.812.104 | 101.728.225 | 155.738.897 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | EUR | 103,90 | 109,60 | 98,80 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 104,34 | 110,07 | 99,06 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 112,70 | 117,47 | 104,89 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | EUR | 104,19 | 109,64 | 98,83 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 107,26 | 112,43 | 100,54 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | USD | 115,83 | 119,95 | 106,42 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 110,20 | 114,57 | 101,91 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 98,45 | 104,37 | 94,40 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 103,60 | 108,52 | — |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Balance | EUR | 103,90 | 109,59 | 98,80 |
| Vermögensstrategie Moderat - Ausgewogen ausschüttender Anteil | EUR | 109,21 | 114,96 | 103,60 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 158.057.000 | 159.169.033 | 202.971.849 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | EUR | 102,58 | 108,56 | 103,36 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | GBP | 104,24 | 109,40 | 103,54 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 118,73 | 124,34 | 117,42 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | EUR | 105,17 | 111,29 | 105,97 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 98,90 | 104,48 | 99,47 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 104,12 | 109,10 | 103,23 |
| Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | USD | 115,99 | 121,27 | 114,53 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | CHF | 102,35 | 107,93 | 102,45 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | USD | 124,17 | 129,22 | 121,25 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 110,11 | 115,80 | 109,56 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 111,36 | 116,14 | 109,22 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 94,11 | 100,09 | 95,77 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 98,75 | 103,78 | — |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | USD | 112,34 | 116,83 | 109,56 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Substanz | EUR | 98,10 | 103,81 | 98,84 |
| Vermögensstrategie Defensiv ausschüttender Anteil | EUR | 102,62 | 108,51 | 103,30 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 109,18 | 114,30 | 107,63 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 444.803.756 | 369.847.480 | 278.497.988 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | EUR | 144,07 | 149,81 | 120,00 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | GBP | 125,28 | 129,34 | 103,16 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 171,47 | 175,88 | 139,89 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | EUR | 140,54 | 146,15 | 117,07 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 138,71 | 143,57 | 114,36 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 142,79 | 146,72 | 116,31 |
| Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | USD | 163,41 | 166,75 | 131,95 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | CHF | 135,52 | 140,39 | 112,05 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | USD | 177,35 | 180,77 | 142,88 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 156,69 | 161,92 | 128,88 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 143,49 | 147,21 | 116,68 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 112,19 | 117,26 | 94,40 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 116,19 | 119,98 | — |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | USD | 139,72 | 142,33 | 112,30 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Chance | EUR | 118,96 | 123,70 | 99,08 |
| Vermögensstrategie Wachstum ausschüttender Anteil | EUR | 130,27 | 134,75 | 107,33 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 144,38 | 148,53 | 117,67 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 | 31. Mai 2020 |
|---|------------|--------------------|--------------------|----------------------|
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 782.947.401 | 695.253.941 | 695.725.488 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | EUR | 124,13 | 128,60 | 112,26 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | GBP | 113,93 | 117,12 | 101,71 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 145,28 | 148,70 | 128,81 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | EUR | 122,56 | 126,98 | 110,85 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 118,05 | 121,75 | 106,12 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 123,20 | 126,10 | 109,18 |
| Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | USD | 139,49 | 142,14 | 122,94 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | CHF | 118,62 | 122,47 | 106,55 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | USD | 150,92 | 153,50 | 132,11 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 133,16 | 137,10 | 118,93 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 126,86 | 129,60 | 111,86 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 102,19 | 106,41 | 93,35 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse I | EUR | 114,69 | 118,21 | 103,04 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 109,44 | 112,59 | — |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | USD | 125,24 | 127,30 | 109,47 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Wachstum | EUR | 108,03 | 111,92 | 97,70 |
| IndexInvest Wachstum, auf CHF lautender, abgesicherter ausschüttender Anteil | CHF | 116,76 | 121,30 | 106,20 |
| Vermögensstrategie Ausgewogen ausschüttender Anteil | EUR | 115,64 | 119,18 | 103,90 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 126,55 | 129,70 | 111,99 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | GBP | 122,71 | 124,83 | 107,26 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | USD | 127,29 | 128,93 | 110,47 |
| BlackRock Style Advantage Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 120.998.037 | 176.150.611 | 2.150.166.004 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | USD | 87,42 | 83,40 | 86,16 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | EUR | 78,72 | 75,62 | 78,78 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 86,03 | 82,07 | 84,79 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 69,65 | 66,82 | 69,57 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | SEK | 71,95 | 68,74 | 71,25 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | CHF | 72,06 | 68,93 | 71,55 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 93,16 | 77,56 | 87,23 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | USD | 90,15 | 85,52 | 87,73 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 80,72 | 77,10 | 79,82 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 78,28 | 74,14 | 76,20 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 86,83 | 73,07 | 83,25 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 75,51 | 72,91 | 76,34 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil PF der Klasse I | CHF | 74,74 | 71,19 | 73,69 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil PF der Klasse I | EUR | 81,94 | 78,66 | 81,13 |
| Auf BRL lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | USD | 66,09 | 52,21 | 50,61 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | CHF | 72,85 | 69,47 | 71,90 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | USD | 80,01 | 76,09 | 77,97 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | EUR | 81,70 | 77,84 | 80,42 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | GBP | 78,48 | 74,20 | 76,24 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | JPY | 8.331,96 | 7.918,17 | 8.162,20 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | USD | 95,02 | 89,48 | 91,12 |
| Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X ⁽³⁾ | AUD | 95,44 | 89,80 | 91,81 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 77,59 | 73,46 | 75,30 |
| Auf NZD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | NZD | 97,60 | 90,03 | 91,00 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | GBP | 92,93 | 87,26 | 86,47 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z | USD | 90,96 | 86,16 | 88,28 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | EUR | 81,62 | 77,84 | 80,39 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 | 31. Mai 2020 |
|---|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BlackRock Style Advantage Screened Fund⁽²⁾ | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | — | 27.052.932 | 27.998.224 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | — | 87,98 | 91,86 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | USD | — | 89,35 | 92,73 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | — | 84,77 | 88,73 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | GBP | — | 86,64 | 90,11 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | — | 82,01 | 94,49 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | USD | — | 89,82 | 93,05 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | — | 84,74 | 96,34 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | — | 85,26 | 89,05 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | GBP | — | 87,09 | 90,40 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | USD | — | 91,10 | 93,88 |
| Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | AUD | — | 85,43 | 88,17 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 440.371.155 | 358.338.671 | 220.697.286 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 183,89 | 196,28 | 137,96 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 196,63 | 183,58 | 141,09 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 196,33 | 184,88 | 143,36 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 161,79 | 174,96 | 123,47 |
| Auf JPY lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | JPY | 21.501,73 | 19.441,15 | 13.336,58 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | JPY | 18.453,94 | 19.668,58 | 13.794,26 |
| Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | GBP | 243,57 | 228,82 | 182,81 |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 145.106.726 | 185.067.316 | 161.584.844 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 174,61 | 190,08 | 134,52 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 190,92 | 181,53 | 140,40 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 179,67 | 172,55 | 134,71 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 149,81 | 167,05 | 119,92 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | USD | 151,68 | 164,06 | 115,34 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 189,65 | 180,05 | 138,98 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | USD | 137,79 | 148,44 | 103,94 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | 153,54 | 145,19 | 111,64 |
| Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X | GBP | 232,00 | 222,06 | 178,42 |
| Auf JPY lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X | JPY | 15.284,84 | 14.023,59 | 9.634,73 |
| BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 52.481.344 | 47.865.656 | 72.200.396 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | USD | 106,08 | 112,00 | 108,48 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 90,78 | 96,86 | 94,73 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | SEK | 917,73 | 977,04 | 952,17 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse AI | EUR | 91,64 | 97,77 | 95,56 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse C | USD | 94,44 | 100,72 | 98,53 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | USD | 106,37 | 111,63 | 107,46 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | EUR | 98,73 | 104,72 | 101,81 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 102,84 | 108,11 | 104,55 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 90,39 | 96,96 | 95,30 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 92,62 | 99,27 | 96,22 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse J | USD | 111,23 | 116,76 | 112,41 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | USD | 125,26 | 129,52 | 122,84 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2022 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 | 31. Mai 2020 |
|---|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BlackRock Total Advantage Fund⁽²⁾ | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | — | 17.698.528 | 30.967.819 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | — | 90,75 | 85,02 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | — | 92,52 | 86,20 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | USD | — | 99,11 | 91,61 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | — | 94,66 | 87,65 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | — | 94,53 | 88,55 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | — | 93,16 | 86,61 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | EUR | — | 94,90 | 87,75 |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | GBP | 213.971.378 | 141.963.933 | 153.650.726 |
| Nettoinventarwert am: | | | | |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | EUR | 106,53 | 100,23 | 101,42 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | EUR | 107,30 | 101,00 | 102,14 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | GBP | 112,45 | 105,23 | 105,70 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | CHF | 109,27 | 102,60 | 103,28 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 119,24 | 109,30 | 104,28 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | EUR | 110,58 | 103,76 | 104,21 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | USD | 119,06 | 110,80 | 110,36 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | GBP | 116,71 | 108,60 | 108,32 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 109,49 | 101,57 | 98,15 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | EUR | 104,11 | 98,06 | 99,69 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | EUR | 108,24 | 101,33 | 101,60 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | JPY | 11.423,48 | 10.637,96 | 10.616,54 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | USD | 116,41 | 108,08 | 107,41 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | GBP | 126,99 | 115,40 | 113,89 |

⁽¹⁾ Auflegung einer neuen Anteilsklasse, nähere Informationen sind Anhang I zu entnehmen.

⁽²⁾ Der Fonds wurde aufgelöst, Näheres hierzu siehe Anmerkung 1.

⁽³⁾ Nähere Informationen zum NIW pro Anteil zum Bewertungszeitpunkt Close sind Anmerkung 2 zu entnehmen.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr

| Anmerkung | BlackRock | BlackRock Americas | BlackRock Asia | BlackRock Asia |
|---|-------------------------------|---|---------------------------------|---|
| | Strategic Funds Kombiniert | Diversified Equity Absolute Return Fund | Pacific Absolute Return Fund | Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund |
| | USD | USD | USD | USD |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 27.312.673.506 | 687.136.883 | 34.677.165 | 35.205.475 |
| Erträge | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 3.636.877 | 571.318 | 24.309 |
| Anleihezinsen | 2(c) | 211.667.810 | 1.650.101 | 68.749 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | 1.074.372 | — | 149 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | 27.663.395 | — | — |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) | 89.057.843 | — | 7.847 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | 109.731.424 | 36.178.770 | 2.702.826 |
| Wertpapierleihe | 2(c),12 | 3.395.270 | — | 3.605 |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 | 4.328.480 | — | — |
| Sonstige Erträge | | 68.759 | — | — |
| Gesamt Erträge | 450.624.230 | 38.400.189 | 722.517 | 2.803.880 |
| Aufwendungen | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 7.177.108 | 6.834 | 3.268 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | 45.665.405 | 11.188.050 | 1.365.234 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | 79.770.268 | — | 50.424 |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) | 10.831.378 | — | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | 122.145.168 | 54.984.546 | 2.189.111 |
| Jährliche Servicegebühr | 5 | 35.380.902 | 1.285.754 | 49.281 |
| Verwahrstellengebühren | 2(i),6 | 8.069.461 | 992.322 | 213.434 |
| Steuern | 8 | 12.478.315 | 220.723 | 8.353 |
| Performancegebühren | 7 | 20.170.296 | 1.450.076 | 690 |
| Vertriebsgebühren | 4 | 6.892.414 | 25.169 | 4.505 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 | 240.348 | 7.540 | 294 |
| Managementgebühren und Gebühren der Untieranlageberater | 4 | 207.187.727 | 8.881.532 | 73.616 |
| Sonstige Aufwendungen | | 204.834 | — | — |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | 556.213.624 | 79.042.546 | 1.458.639 | 3.958.210 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 | 1.902.555 | — | 185.774 |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | 554.311.069 | 79.042.546 | 1.458.639 | 3.772.436 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | | (103.686.839) | (40.642.357) | (968.556) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) | 203.702.093 | (1.171.529) | (39.130) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | 2.920.813 | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 247.683.963 | 97.500.272 | 1.123.097 |
| Terminkontrakte | 2(d) | 469.642.280 | — | 719 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | (947.117.002) | (103.261.807) | (1.318.001) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | 11.278.698 | — | (428.516) |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | (10.678.976) | — | — |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | | (22.568.131) | (6.933.064) | (661.831) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) | (1.737.960.175) | (2.064.299) | 79.850 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | 165.242 | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | (11.223.688) | 439.853 | 43.272 |
| Terminkontrakte | 2(d) | 126.137.142 | — | (63.240) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | 4.615.604 | 3.808.194 | (56.493) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | (136.758.214) | — | 179.540 |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | 2.994.795 | — | — |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | | (1.752.029.294) | 2.183.748 | 182.929 |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | | (1.878.284.264) | (45.391.673) | (1.447.458) |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | | 8.849.770.829 | 445.610.729 | 2.112.312 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | | (9.916.331.528) | (302.116.174) | (1.428.993) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | | (1.066.560.699) | 143.494.555 | 683.319 |
| Angekündigte Dividenden | 11 | (45.071.827) | — | — |
| Wechselkursanpassung | 2(f) | (1.916.568.943) ⁽¹⁾ | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | | 22.406.187.773 | 785.239.765 | 34.441.336 |

⁽¹⁾ Die konsolidierten Angaben wurden unter Anwendung der durchschnittlichen Wechselkurse im abgeschlossenen Geschäftsjahr berechnet. Die daraus resultierende Wechselkursberichtigung von (1.916.568.943) USD reflektiert die Wechselkursschwankungen zwischen dem 1. Juni 2021 und 31. Mai 2022. Hierbei handelt es sich um einen Nominalbetrag, der keine Auswirkungen auf das Nettovermögen der einzelnen Fonds hat.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| Anmerkung | BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund |
|---|--|---|---|--|
| | EUR | GBP | USD | USD |
| Nettobondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.229.637.507 | 820.997.763 | 12.621.637 | 905.434.827 |
| Erträge | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) — | 329.993 | 62 | 1.513 |
| Anleihezinsen | 2(c) 210.588 | 1.094.904 | 1.831 | — |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | 63.033 | — | 3.958 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) 443.668 | — | — | — |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) 8.920.040 | 808.539 | 164.841 | 14.214.162 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | 10.066.398 | 19.483 | 7.756.044 |
| Wertpapierleihe | 2(c),12 163.178 | 47.763 | 2.744 | 239.017 |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 370.544 | — | — | — |
| Sonstige Erträge | — | — | — | — |
| Gesamt Erträge | 10.108.018 | 12.410.630 | 188.961 | 22.214.694 |
| Aufwendungen | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) 319.800 | 85.527 | — | 28.799 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | 3.720.918 | 80.897 | 2.607.344 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) 1.398.173 | — | — | — |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) 18.156 | — | — | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | 8.952.565 | 169.920 | 4.090.937 |
| Jährliche Servicegebühr | 5 1.185.070 | 1.406.387 | 18.558 | 1.189.676 |
| Verwahrstellegebühren | 2(i),6 175.898 | 138.196 | 17.307 | 420.930 |
| Steuern | 8 155.874 | 236.579 | 2.696 | 4.839.486 |
| Performancegebühren | 7 — | 1.376.176 | — | — |
| Vertriebsgebühren | 4 790.807 | — | 6.918 | 204.155 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 9.735 | 7.688 | 111 | 5.928 |
| Managementgebühren und Gebühren der Unteranlageberater | 4 7.915.201 | 7.863.081 | 116.224 | 5.369.736 |
| Sonstige Aufwendungen | 96.049 | — | 18.440 | — |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | 12.064.763 | 23.787.117 | 431.071 | 18.756.991 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 — | — | 114 | — |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | 12.064.763 | 23.787.117 | 430.957 | 18.756.991 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | (1.956.745) | (11.376.487) | (241.996) | 3.457.703 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) 16.320.140 | 426.622 | (2.811.499) | 18.100.191 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | (63.881.326) | 1.679.678 | (1.734.291) |
| Terminkontrakte | 2(d) 6.393.774 | (25.667.897) | 77.782 | (2.965.319) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) (29.321.429) | 8.180.497 | (597.971) | 393.796 |
| Swap-Transaktionen | 2(d) 1.923.469 | — | — | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) (1.602.725) | — | — | — |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | (6.286.771) | (80.942.104) | (1.652.010) | 13.794.377 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) (52.652.881) | (29.039.014) | (33.330) | (157.176.917) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | (10.980.524) | 255.211 | 8.373.006 |
| Terminkontrakte | 2(d) (5.974.888) | 12.935.251 | 13.218 | (832.981) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) (4.640.387) | 1.520.831 | (45.948) | (393.585) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) (11.232.539) | — | — | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) 2.071.703 | — | — | — |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | (72.428.992) | (25.563.456) | 189.151 | (150.030.477) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | (80.672.508) | (117.882.047) | (1.704.855) | (132.778.397) |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | 222.031.373 | 302.142.360 | 1.616.468 | 112.069.098 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | (242.000.541) | (405.960.203) | (12.533.250) | (528.404.731) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | (19.969.168) | (103.817.843) | (10.916.782) | (416.335.633) |
| Angekündigte Dividenden | 11 — | — | — | (57) |
| Wechselkursanpassung | 2(f) — | — | — | — |
| Nettobondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | 1.128.995.831 | 599.297.873 | — | 356.320.740 |

⁽¹⁾Der Fonds wurde aufgelöst, Näheres hierzu siehe Anmerkung 1.

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| Anmerkung | BlackRock | BlackRock | BlackRock | BlackRock |
|---|--|---|---------------------------------|--|
| | Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | Emerging Markets Short Duration Bond Fund | BlackRock ESG Euro Bond Fund | BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund |
| | USD | USD | EUR | EUR |
| Nettobondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.532.287.129 | 77.615.734 | 642.499.599 | 271.817.140 |
| Erträge | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) 134.857 | 920 | 3.069 | 3.797 |
| Anleihezinsen | 2(c) 81.149.758 | 5.098.269 | 3.014.065 | 2.524.640 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | — | — | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) 9.708.886 | 277.135 | 314.946 | 254.548 |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) 617.042 | — | — | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | — | — | — |
| Wertpapierleihe | 2(c),12 136.347 | 21.674 | 44.967 | 42.246 |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 142.042 | — | — | — |
| Sonstige Erträge | — | — | — | — |
| Gesamt Erträge | 91.888.932 | 5.397.998 | 3.377.047 | 2.825.231 |
| Aufwendungen | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) 2.063.561 | 22.880 | 18.421 | 12.454 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | — | — | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) 41.612.571 | 614.533 | 246.865 | 301.000 |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) 3.211.898 | 243.492 | 702.535 | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | — | — | — |
| Jährliche Servicegebühr | 5 767.373 | 55.354 | 494.000 | 154.350 |
| Verwahrstellengebühren | 2(i),6 321.844 | 39.449 | 179.391 | 97.760 |
| Steuern | 8 380.434 | 21.762 | 150.662 | 33.522 |
| Performancegebühren | 7 — | — | — | — |
| Vertriebsgebühren | 4 133.671 | 29.627 | 183.656 | 26.544 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 14.471 | 777 | 5.771 | 2.591 |
| Managementgebühren und Gebühren der Untereinlageberater | 4 2.645.303 | 218.706 | 1.527.866 | 968.947 |
| Sonstige Aufwendungen | — | — | — | — |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | 51.151.126 | 1.246.580 | 3.509.167 | 1.597.168 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 — | — | — | 40.692 |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | 51.151.126 | 1.246.580 | 3.509.167 | 1.556.476 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | 40.737.806 | 4.151.418 | (132.120) | 1.268.755 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) (86.439.129) | (439.047) | (10.170.492) | (4.981.940) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Terminkontrakte | 2(d) 140.738 | 1.325.337 | 6.384.568 | 1.670.682 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) (91.976.789) | (3.771.298) | (838.103) | (203.139) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) 41.309.711 | (468.768) | (3.538.186) | (216.689) |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) (4.911.770) | (54.367) | 109.304 | (14.752) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | (141.877.239) | (3.408.143) | (8.052.909) | (3.745.838) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) (153.317.671) | (15.099.494) | (51.220.959) | (23.759.564) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Terminkontrakte | 2(d) 5.429.656 | 586.320 | 414.611 | 1.125.739 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) 3.969.375 | (362.077) | 138.041 | (279.268) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) 24.409.379 | 106.591 | (3.184.524) | (1.882.426) |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) (265.414) | 11.460 | (10.988) | 56.323 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | (119.774.675) | (14.757.200) | (53.863.819) | (24.739.196) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | (220.914.108) | (14.013.925) | (62.048.848) | (27.216.279) |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | 118.940.393 | 47.219.573 | 256.161.271 | 67.137.707 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | (291.591.446) | (14.442.412) | (318.425.705) | (53.586.654) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | (172.651.053) | 32.777.161 | (62.264.434) | 13.551.053 |
| Angekündigte Dividenden | 11 (810.417) | (83.126) | (2.785) | (11) |
| Wechselkursanpassung | 2(f) — | — | — | — |
| Nettobondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | 1.137.911.551 | 96.295.844 | 518.183.532 | 258.151.903 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| Anmerkung | BlackRock ESG | BlackRock | BlackRock | BlackRock |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|---|------------------------------------|
| | Euro Short Duration Bond Fund | European Absolute Return Fund | European Opportunities Extension Fund | European Select Strategies Fund |
| | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 238.040.560 | 1.528.371.943 | 660.042.096 | 485.703.169 |
| Erträge | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) 389 | — | — | 5.450 |
| Anleihezinsen | 2(c) 490.335 | — | — | 2.639.235 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | 121.512 | 143.834 | 1.821 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) 55.523 | — | — | 207.314 |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) — | 5.755.965 | 7.092.771 | 6.412.927 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | 3.829.624 | 3.209.680 | — |
| Wertpapierleihe | 2(c),12 632 | 89.886 | 32.929 | 47.934 |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 — | — | — | 2.733 |
| Sonstige Erträge | — | — | — | — |
| Gesamt Erträge | 546.879 | 9.796.987 | 10.479.214 | 9.317.414 |
| Aufwendungen | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) 15.351 | 43.737 | 29.836 | 80.657 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | 6.371.726 | 1.350.731 | 9.202 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) 34.255 | — | — | 220.528 |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) 560.173 | 5.087.933 | 11.326 | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | 19.802.397 | 3.277.891 | 220.490 |
| Jährliche Servicegebühr | 5 171.595 | 2.974.346 | 1.898.950 | 496.242 |
| Verwahrestellengebühren | 2(i),6 96.728 | 253.516 | 120.723 | 280.531 |
| Steuern | 8 48.013 | 534.674 | 330.497 | 118.781 |
| Performancegebühren | 7 — | 10.609.258 | 810.528 | — |
| Vertriebsgebühren | 4 90 | 175.066 | 468.741 | 623.958 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 811 | 18.632 | 7.597 | 4.956 |
| Managementgebühren und Gebühren der Unteranlageberater | 4 329.940 | 18.287.840 | 8.515.712 | 3.944.945 |
| Sonstige Aufwendungen | — | 4.514 | 8.140 | 1.444 |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | 1.256.956 | 64.163.639 | 16.830.672 | 6.001.734 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 218.878 | — | — | — |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | 1.038.078 | 64.163.639 | 16.830.672 | 6.001.734 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | (491.199) | (54.366.652) | (6.351.458) | 3.315.680 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) (1.462.212) | 99.678.539 | 103.890.641 | 7.071.068 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | 109.931.332 | 28.203.936 | 816.441 |
| Terminkontrakte | 2(d) 1.955.261 | — | — | 6.158.465 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) (317.818) | 2.382.092 | 2.303.530 | (2.910.621) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) (964.066) | — | — | (2.073.604) |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) 8.718 | — | — | 65 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | (780.117) | 211.991.963 | 134.398.107 | 9.061.814 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) (5.159.811) | (88.350.954) | (132.487.473) | (43.444.353) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | (19.029.916) | (1.975.611) | (170.061) |
| Terminkontrakte | 2(d) 1.317.836 | — | — | 1.988.565 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) 65.126 | (1.225.889) | 143.826 | 1.321.964 |
| Swap-Transaktionen | 2(d) (1.034.624) | — | — | (2.976.444) |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) (1.154) | — | — | (47.296) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | (4.812.627) | (108.606.759) | (134.319.258) | (43.327.625) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | (6.083.943) | 49.018.552 | (6.272.609) | (30.950.131) |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | 47.428.522 | 570.213.347 | 54.001.709 | 88.163.926 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | (120.572.314) | (617.719.940) | (102.525.159) | (160.978.969) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | (73.143.792) | (47.506.593) | (48.523.450) | (72.815.043) |
| Angekündigte Dividenden | 11 — | — | (890.286) | (26.606) |
| Wechselkursanpassung | 2(f) — | — | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | 158.812.825 | 1.529.883.902 | 604.355.751 | 381.911.389 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| Anmerkung | BlackRock | BlackRock Fixed | BlackRock Fixed | BlackRock Global |
|---|--|----------------------------------|---------------------------|------------------------------|
| | European Unconstrained Equity Fund | Income Credit Strategies Fund | Income Strategies Fund | Absolute Return Bond Fund |
| | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 46.793.755 | 385.400.409 | 5.676.286.758 | 159.454.244 |
| Erträge | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | — | 3.807 | 17.617 |
| Anleihezinsen | 2(c) | — | 4.541.829 | 3.257.322 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | — | — | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | — | 373.176 | 1.075.547 |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) | 598.498 | 86.126 | 990.002 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | — | — | — |
| Wertpapierleihe | 2(c),12 | 2.714 | 51.478 | 575.847 |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 | — | 11.188 | 17.702 |
| Sonstige Erträge | | — | — | 58.593 |
| Gesamt Erträge | | 601.212 | 5.067.604 | 72.150.935 |
| Aufwendungen | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 1.000 | 154.955 | 3.149.834 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | — | 3.190 | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | — | 1.119.655 | 18.219.325 |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) | — | — | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | — | 57.412 | — |
| Jährliche Servicegebühr | 5 | 88.102 | 244.465 | 7.029.402 |
| Verwahrstellengebühren | 2(i),6 | 20.907 | 169.974 | 1.007.659 |
| Steuern | 8 | 15.844 | 52.858 | 1.750.139 |
| Performancegebühren | 7 | 45.657 | — | — |
| Vertriebsgebühren | 4 | 11.084 | 40.812 | 1.675.569 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 | 820 | 3.349 | 53.790 |
| Managementgebühren und Gebühren der Unteranlageberater | 4 | 167.660 | 329.654 | 36.035.680 |
| Sonstige Aufwendungen | | — | — | — |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | | 351.074 | 2.176.324 | 68.921.398 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 | — | 52.944 | — |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | | 351.074 | 2.123.380 | 68.921.398 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | | 250.138 | 2.944.224 | 3.229.537 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) | 1.154.853 | (7.547.904) | (108.105.649) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | 143.772 | — |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | 15.843.103 | 413.891.348 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | 663.203 | (92.538) | (21.773.496) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | — | (1.141.936) | (39.137.949) |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | — | (5.834) | 1.582.710 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | | 1.818.056 | 7.198.663 | 246.456.964 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) | (3.240.141) | (38.074.185) | (282.858.584) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | (28.701) | — |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | 12.006.061 | 51.409.283 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | (13.605) | (109.536) | 5.857.889 |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | — | (1.038.779) | (121.640.749) |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | — | (332.990) | (731.637) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | | (3.253.746) | (27.578.130) | (347.963.798) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | | (1.185.552) | (17.435.243) | (98.277.297) |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | | 20.675.143 | 132.655.436 | 1.206.016.679 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | | (7.212.303) | (132.847.758) | (2.442.673.460) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | | 13.462.840 | (192.322) | (1.236.656.781) |
| Angekündigte Dividenden | 11 | — | (4) | (2.744.908) |
| Wechselkursanpassung | 2(f) | — | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | | 59.071.043 | 367.772.840 | 4.338.607.772 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Anmerkung | BlackRock Global | BlackRock Global | BlackRock Global | BlackRock |
|---|----------------|--------------------------------|----------------------|-------------------------------|---|
| | | Equity Absolute Return Fund | Event Driven Fund | Real Asset Securities Fund | Managed Index Portfolios – Conservative |
| | | USD | USD | USD | EUR |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | | 70.551.611 | 6.020.440.310 | 315.221.465 | 101.728.225 |
| Erträge | | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 74 | 2.062.910 | 24.798 | 2.487 |
| Anleihezinsen | 2(c) | 3.244 | 36.350.497 | — | — |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | 14.804 | 639.354 | 1.218 | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | — | 4.200 | — | — |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) | 763.830 | 7.081.634 | 13.472.893 | 666.938 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | 198.522 | 28.214.641 | 3.536 | — |
| Wertpapierleihe | 2(c),12 | — | 1.299.904 | 53.322 | 13.056 |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 | — | — | — | 199.221 |
| Sonstige Erträge | | — | — | — | — |
| Gesamt Erträge | | 980.474 | 75.653.140 | 13.555.767 | 881.702 |
| Aufwendungen | | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 4.679 | 57.597 | 8.654 | — |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | 151.786 | 13.388.255 | 201 | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | — | 10.617.410 | — | — |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) | — | — | — | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | 1.049.070 | 12.934.502 | — | — |
| Jährliche Servicegebühr | 5 | 46.362 | 9.989.953 | 1.318.433 | 57.967 |
| Verwahrestellengebühren | 2(i),6 | 29.069 | 638.078 | 118.730 | 35.553 |
| Steuern | 8 | 8.851 | 1.688.330 | 300.231 | 47.597 |
| Performancegebühren | 7 | — | 24.861 | — | — |
| Vertriebsgebühren | 4 | 2.059 | 1.571.533 | 33.530 | 286 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 | 391 | 48.420 | 2.648 | 1.214 |
| Managementgebühren und Gebühren der Untereinlageberater | 4 | 25.482 | 68.182.783 | 4.706.220 | 834.864 |
| Sonstige Aufwendungen | | — | 369 | — | — |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | | 1.317.749 | 119.142.091 | 6.488.647 | 977.481 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 | — | — | — | 16.076 |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | | 1.317.749 | 119.142.091 | 6.488.647 | 961.405 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | | (337.275) | (43.488.951) | 7.067.120 | (79.703) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) | (7.277.568) | 37.680.170 | 16.925.869 | 4.307.239 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 2.775.744 | 37.287.452 | (10.346) | — |
| Terminkontrakte | 2(d) | (1.791.052) | (5.979.626) | (7.968) | — |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | 970.057 | (613.120.709) | (11.666.771) | (3.837.349) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | — | 16.830.759 | — | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | — | — | (5.237.846) | — |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | | (5.322.819) | (527.301.954) | 2.938 | 469.890 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) | (13.381.623) | (307.059.292) | (67.987.180) | (2.804.907) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 26.577 | 2.995.190 | 442.712 | — |
| Terminkontrakte | 2(d) | 368.731 | 36.534.648 | — | — |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | (236.721) | (2.717.094) | 475.152 | (313.830) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | — | 4.315.556 | — | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | — | — | 2.089.436 | — |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | | (13.223.036) | (265.930.992) | (64.979.880) | (3.118.737) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | | (18.883.130) | (836.721.897) | (57.909.822) | (2.728.550) |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | | 16.753.476 | 2.825.480.315 | 744.493.110 | 18.893.700 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | | (2.407.956) | (2.499.139.271) | (136.997.361) | (25.073.869) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | | 14.345.520 | 326.341.044 | 607.495.749 | (6.180.169) |
| Angekündigte Dividenden | 11 | — | — | (39.528.661) | (7.402) |
| Wechselkursanpassung | 2(f) | — | — | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | | 66.014.001 | 5.510.059.457 | 825.278.731 | 92.812.104 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| Anmerkung | BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | BlackRock Style Advantage Fund |
|---|---|--|--|-----------------------------------|
| | EUR | EUR | EUR | USD |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 159.169.033 | 369.847.480 | 695.253.941 | 176.150.611 |
| Erträge | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) — | — | — | 9.015 |
| Anleihezinsen | 2(c) — | — | — | 262.578 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | — | — | 18.111 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) — | — | — | 447.395 |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) 1.282.887 | 1.461.210 | 2.972.304 | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | — | — | 3.776.246 |
| Wertpapierleihe | 2(c),12 32.136 | 148.084 | 43.605 | — |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 332.210 | 927.099 | 1.660.054 | — |
| Sonstige Erträge | — | — | — | — |
| Gesamt Erträge | 1.647.233 | 2.536.393 | 4.675.963 | 4.513.345 |
| Aufwendungen | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) 16.345 | 10.596 | 10.637 | 337.552 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | — | — | 767.875 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) — | — | — | 164.488 |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) — | — | — | 44.996 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | — | — | 3.073.075 |
| Jährliche Servicegebühr | 5 94.355 | 255.375 | 447.981 | 89.799 |
| Verwahrstellengebühren | 2(i),6 53.418 | 106.162 | 151.834 | 191.813 |
| Steuern | 8 77.209 | 219.139 | 372.711 | 17.962 |
| Performancegebühren | 7 — | — | — | — |
| Vertriebsgebühren | 4 84 | 1.393 | 432 | 2.281 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 1.721 | 3.525 | 6.814 | 3.857 |
| Managementgebühren und Gebühren der Unteranlageberater | 4 1.049.312 | 3.176.010 | 5.468.202 | 713.240 |
| Sonstige Aufwendungen | — | — | — | — |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | 1.292.444 | 3.772.200 | 6.458.611 | 5.406.938 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 22.915 | 23.960 | 2.233 | — |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | 1.269.529 | 3.748.240 | 6.456.378 | 5.406.938 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | 377.704 | (1.211.847) | (1.780.415) | (893.593) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) 4.553.311 | 28.442.671 | 43.006.027 | (110.500) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | — | — | 11.401.184 |
| Terminkontrakte | 2(d) — | — | — | (5.988.522) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) 178.615 | (11.382.506) | (13.891.275) | (13.324.627) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) — | — | — | 4.902.102 |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | 4.731.926 | 17.060.165 | 29.114.752 | (3.120.363) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) (3.695.855) | (27.399.199) | (31.568.015) | (98.446) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | — | — | (256.533) |
| Terminkontrakte | 2(d) — | — | — | (1.086.623) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) (12.627) | 543.737 | 107.585 | (2.963.509) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) — | — | — | (789.575) |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | (3.708.482) | (26.855.462) | (31.460.430) | (5.194.686) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | 1.401.148 | (11.007.144) | (4.126.093) | (9.208.642) |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | 40.739.262 | 173.001.116 | 252.985.874 | 46.822.484 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | (43.098.431) | (86.944.298) | (161.010.018) | (92.766.416) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | (2.359.169) | 86.056.818 | 91.975.856 | (45.943.932) |
| Angekündigte Dividenden | 11 (154.012) | (93.398) | (156.303) | — |
| Wechselkursanpassung | 2(f) — | — | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | 158.057.000 | 444.803.756 | 782.947.401 | 120.998.037 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Anmerkung | BlackRock Style | BlackRock | BlackRock | BlackRock |
|---|----------------|------------------------------|---------------------|---------------------|------------------------|
| | | Advantage | Systematic ESG | Systematic Global | Systematic Global |
| | | Screened Fund ⁽¹⁾ | World Equity Fund | Equity Fund | Long/Short Equity Fund |
| | | USD | USD | USD | USD |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | | 27.052.932 | 358.338.671 | 185.067.316 | 47.865.656 |
| Erträge | | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 2.981 | 168 | 57 | 8.121 |
| Anleihezinsen | 2(c) | 30.419 | — | — | 46.862 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | — | — | — | 733 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | 49.694 | — | — | — |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) | — | 6.515.816 | 3.040.145 | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | 306.523 | — | — | 1.771.533 |
| Wertpapierleihe | 2(c),12 | — | 47.950 | 17.188 | — |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 | — | — | — | — |
| Sonstige Erträge | | — | — | — | — |
| Gesamt Erträge | | 389.617 | 6.563.934 | 3.057.390 | 1.827.249 |
| Aufwendungen | | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 12.663 | 2.475 | 519 | 393 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | 75.497 | — | — | 480.570 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | — | — | — | — |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) | 42.561 | — | — | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | 266.919 | — | — | 1.911.288 |
| Jährliche Servicegebühr | 5 | 11.306 | 342.589 | 100.172 | 143.839 |
| Verwahrstellengebühren | 2(i),6 | 91.884 | 91.087 | 80.688 | 913.336 |
| Steuern | 8 | 2.498 | 103.955 | 20.120 | 22.331 |
| Performancegebühren | 7 | — | — | — | — |
| Vertriebsgebühren | 4 | 118 | 241.589 | 12.699 | 48.827 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 | 243 | 897 | 1.808 | 504 |
| Managementgebühren und Gebühren der Untereinlageberater | 4 | 484 | 1.000.034 | 457.505 | 727.564 |
| Sonstige Aufwendungen | | 24.162 | 1.049 | 2.090 | 22.665 |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | | 528.335 | 1.783.675 | 675.601 | 4.271.317 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 | 89.635 | — | — | 870.032 |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | | 438.700 | 1.783.675 | 675.601 | 3.401.285 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | | (49.083) | 4.780.259 | 2.381.789 | (1.574.036) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) | (17.078) | 24.271.855 | 11.063.541 | (21.603) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 1.604.861 | — | — | (928.988) |
| Terminkontrakte | 2(d) | (1.087.854) | (519.559) | 406.004 | 267.632 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | 481.674 | (5.305.480) | (2.652.538) | (5.716.028) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | 219.339 | — | — | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | — | — | — | (160.645) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | | 1.200.942 | 18.446.816 | 8.817.007 | (6.559.632) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) | (615.306) | (51.522.908) | (23.366.580) | (123.008) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 23.802 | — | — | (46.985) |
| Terminkontrakte | 2(d) | (60.102) | 156.478 | 24.528 | (163.022) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | 184.383 | 102.676 | (17.931) | 75.147 |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | (118.948) | — | — | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | | (586.171) | (51.263.754) | (23.359.983) | (257.868) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | | 565.688 | (28.036.679) | (12.161.187) | (8.391.536) |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | | 11.643 | 233.207.799 | 28.232.042 | 44.529.436 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | | (27.630.263) | (123.138.636) | (56.031.445) | (31.522.212) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | | (27.618.620) | 110.069.163 | (27.799.403) | 13.007.224 |
| Angekündigte Dividenden | 11 | — | — | — | — |
| Wechselkursanpassung | 2(f) | — | — | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | | — | 440.371.155 | 145.106.726 | 52.481.344 |

⁽¹⁾Der Fonds wurde aufgelöst, Näheres hierzu siehe Anmerkung 1.

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Anmerkung | BlackRock Total Advantage Fund ⁽¹⁾ EUR | BlackRock UK Equity Absolute Return Fund GBP |
|---|----------------|---|---|
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | | 17.698.528 | 141.963.933 |
| Erträge | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 8 | 98.995 |
| Anleihezinsen | 2(c) | 21.295 | 357.010 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | — | 5.090 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | 17 | — |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) | — | 85.817 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | 26.409 | 5.320.397 |
| Wertpapierleihe | 2(c),12 | — | — |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 | — | — |
| Sonstige Erträge | | 1.754 | — |
| Gesamt Erträge | | 49.483 | 5.867.309 |
| Aufwendungen | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 6.207 | 22.529 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | 8.823 | 914.793 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | — | — |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) | 16.684 | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | 20.136 | 1.561.475 |
| Jährliche Servicegebühr | 5 | 2.221 | 94.273 |
| Verwahrstellengebühren | 2(i),6 | 3.212 | 42.541 |
| Steuern | 8 | 159 | 19.773 |
| Performancegebühren | 7 | — | 2.755.931 |
| Vertriebsgebühren | 4 | 320 | 986 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 | 55 | 1.392 |
| Managementgebühren und Gebühren der Untereinlagegeberater | 4 | 370 | 1.396.761 |
| Sonstige Aufwendungen | | — | 7.924 |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | | 58.187 | 6.818.378 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 | — | — |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | | 58.187 | 6.818.378 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | | (8.704) | (951.069) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) | 128.301 | 25.831 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 5.367 | 10.796.726 |
| Terminkontrakte | 2(d) | 528.242 | (3.133.551) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | 463.647 | (9.671.765) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | 266.034 | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | — | — |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | | 1.391.591 | (1.982.759) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/ (-verlusts) aus: | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) | (67.014) | (924.535) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 65.740 | 11.928.052 |
| Terminkontrakte | 2(d) | (133.544) | (2.940.761) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | (260.457) | 1.267.884 |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | (193.094) | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | — | — |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | | (588.369) | 9.330.640 |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | | 794.518 | 6.396.812 |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | | 35.410 | 84.698.523 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | | (18.528.456) | (19.087.890) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | | (18.493.046) | 65.610.633 |
| Angekündigte Dividenden | 11 | — | — |
| Wechselkursanpassung | 2(f) | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | | — | 213.971.378 |

⁽¹⁾Der Fonds wurde aufgelöst, Näheres hierzu siehe Anmerkung 1.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|--|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund | | | | |
| Auf AUD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A | 149 | — | — | 149 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A | 45 | 213 | — | 258 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1.554.898 | 7.049.679 | 3.947.480 | 4.657.097 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 217.571 | 39.852 | 73.473 | 183.950 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 1.475.258 | 514.283 | 768.053 | 1.221.488 |
| Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 460 | — | 427 | 33 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 247.383 | 73.317 | 177.277 | 143.423 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 4.404 | 704 | 3.040 | 2.068 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 387.030 | 251.251 | 160.833 | 477.448 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 146 | 132 | 145 | 133 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 53.248 | 12.896 | 18.720 | 47.424 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 373.164 | 566.900 | 365.293 | 574.771 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1.976.602 | 1.519.711 | 46.979 | 3.449.334 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1.350.876 | 31.168 | 105.048 | 1.276.996 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 765.056 | 157.660 | 278.388 | 644.328 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 91.982 | 22.711 | 21.325 | 93.368 |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | | | | |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | 44 | — | — | 44 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1.356 | 1.465 | — | 2.821 |
| Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 41 | — | — | 41 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 3.057 | 10.000 | — | 13.057 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | 45 | 544 | — | 589 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 45 | 3 | — | 48 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 3.848 | 162 | 195 | 3.815 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 14.129 | 16.125 | 7.113 | 23.141 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 4.861 | 2.111 | 417 | 6.555 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 199.650 | 73.169 | — | 272.819 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 44.532 | — | 600 | 43.932 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 3.238 | — | — | 3.238 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 339 | — | — | 339 |
| BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 100 | — | — | 100 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 94 | 90 | 90 | 94 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 4.156 | 12 | 4.068 | 100 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 47 | 139 | 139 | 47 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 7.339 | 2.816 | 2.941 | 7.214 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | 156.180 | 8.645 | 190 | 164.635 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | — | 37 | — | 37 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 94 | — | — | 94 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 8.592 | 1.551 | — | 10.143 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 64.799 | 2.361 | 3.197 | 63.963 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 446.909 | 86.725 | 395.345 | 138.289 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1.476.300 | 47.255 | 201.172 | 1.322.383 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 533.365 | 493.200 | 235.784 | 790.781 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 53.607 | 541 | 4.753 | 49.395 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1.203.579 | 464.954 | 426.617 | 1.241.916 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 5.345.692 | 545.793 | 666.667 | 5.224.818 |
| Auf CAD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 68 | — | — | 68 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 381.500 | 255 | — | 381.755 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 3.823 | — | — | 3.823 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 50 | — | — | 50 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 821.302 | 121.610 | 77.697 | 865.215 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | | | | |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 10.739 | 816 | 5.124 | 6.431 |
| CNH-Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 33 | — | — | 33 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 16.438 | 61.982 | 7.683 | 70.737 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 175.871 | 184.679 | 66.730 | 293.820 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 123.149 | 29.272 | 26.095 | 126.326 |
| Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D ⁽¹⁾ | — | 160.109 | 7.244 | 152.865 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 54.671 | 7.868 | 14.570 | 47.969 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 465.382 | 160.989 | 333.277 | 293.094 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1.043.773 | 332.559 | 571.755 | 804.577 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 235.624 | 85.219 | 91.110 | 229.733 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 239.928 | 133.676 | 27.641 | 345.963 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 173.082 | 24.568 | 122.711 | 74.939 |
| Auf JPY lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I ⁽¹⁾ | — | 46.561 | 290 | 46.271 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I ⁽¹⁾ | — | 2.220 | — | 2.220 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 66.719 | 15.211 | 41.331 | 40.599 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 2.895.717 | 617.356 | 1.642.187 | 1.870.886 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 601.007 | 834.070 | 401.633 | 1.033.444 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status | 922.641 | 167.189 | 353.926 | 735.904 |
| Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X ⁽¹⁾ | — | 151.613 | — | 151.613 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | 45 | — | — | 45 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 111.189 | — | 66.290 | 44.899 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 112.689 | — | 34.979 | 77.710 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 93.904 | — | 65.909 | 27.995 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 66.755 | — | 22.000 | 44.755 |
| BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund⁽²⁾ | | | | |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 182 | — | 182 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 11.140 | 6.495 | 17.635 | — |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 24.292 | 175 | 24.467 | — |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 43 | — | 43 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 14.627 | 3.646 | 18.273 | — |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 107 | — | 107 | — |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 16.381 | 1.630 | 18.011 | — |
| Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 33 | — | 33 | — |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 39 | — | 39 | — |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | 35 | — | 35 | — |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1 | — | 1 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 56.057 | — | 56.057 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 2.037 | 3.374 | 5.411 | — |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 917.894 | 267.103 | 872.472 | 312.525 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 5.469 | 400 | 2.005 | 3.864 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | 50 | — | — | 50 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 29.155 | 9.570 | 12.591 | 26.134 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 166.300 | 34.423 | 90.225 | 110.498 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 484.379 | 67.542 | 158.080 | 393.841 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 123.252 | 46.214 | 37.190 | 132.276 |
| Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 225.582 | 44.971 | 76.431 | 194.122 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 249.301 | 38.596 | 77.738 | 210.159 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 2.821.654 | 80.143 | 2.537.040 | 364.757 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | 384.654 | 51.825 | 135.022 | 301.457 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 22.770 | 3.261 | 3.767 | 22.264 |
| Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 1.758 | — | 1.317 | 441 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 309.259 | — | 34.054 | 275.205 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | | | | |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 398 | — | 368 | 30 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 52.691 | 1.810 | 12.810 | 41.691 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 36.931 | 2.065 | 29.488 | 9.508 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 6.005 | 4.950 | 7.453 | 3.502 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 51 | — | — | 51 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 45 | — | — | 45 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 75.114 | 8.537 | 3.003 | 80.648 |
| Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 41 | — | — | 41 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 18.352 | — | 18.310 | 42 |
| Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 23.463 | 8 | 13.468 | 10.003 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 58.186 | 8.348 | 49.901 | 16.633 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 47.427 | 804 | 20.927 | 27.304 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 901 | — | 850 | 51 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 89.454 | 12.659 | 40.406 | 61.707 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 40.773 | 5.573 | 10.358 | 35.988 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 221.388 | 2.627 | 45.476 | 178.539 |
| Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse I | 39.793 | — | 29.741 | 10.052 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I | 229.833 | 17.921 | 92.817 | 154.937 |
| Auf EUR lautender Hedged ausschüttender Anteil (G) der Klasse I | 196.043 | 453 | 194.836 | 1.660 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 530 | — | — | 530 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 910 | 850 | 1.716 | 44 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 2.118.385 | 21.904 | 390.159 | 1.750.130 |
| Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse X | 44 | — | — | 44 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 1.945.470 | 812 | 1.425.426 | 520.856 |
| Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 7.184.515 | 1.270.448 | — | 8.454.963 |
| Auf CAD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 2.370.126 | — | — | 2.370.126 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 3.503 | 17.202 | 1.864 | 18.841 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse AI | 45 | — | — | 45 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 45 | 322 | — | 367 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 51.747 | 129.450 | 14.980 | 166.217 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 24.809 | 9.400 | 24.736 | 9.473 |
| Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse E | 3.748 | 9.717 | 1.029 | 12.436 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse E | 9.592 | 9.219 | 5.654 | 13.157 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 20.149 | 13.054 | 9.660 | 23.543 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2.568 | 3.075 | 533 | 5.110 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 238.043 | — | 56.000 | 182.043 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 249.750 | 199.740 | 4.053 | 445.437 |
| BlackRock ESG Euro Bond Fund | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | 207.828 | 78.855 | 125.734 | 160.949 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 48.254 | 25.111 | 22.433 | 50.932 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 47 | 920 | 382 | 585 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 254.204 | 343.610 | 64.002 | 533.812 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 403.087 | 81.952 | 161.868 | 323.171 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1.700.628 | 1.354.737 | 1.003.154 | 2.052.211 |
| Ausschüttungsanteile (G) der Klasse X | 5.171 | 7.563 | 329 | 12.405 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 2.412.970 | 288.000 | 1.166.423 | 1.534.547 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 967.874 | 91.366 | 300.944 | 758.296 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 46 | 243 | 242 | 47 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A ⁽¹⁾ | — | 41.697 | 14.244 | 27.453 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 3.189 | — | 1.449 | 1.740 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | 41 | — | — | 41 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 43.353 | 17.930 | 18.311 | 42.972 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 54.464 | 17.922 | 23.673 | 48.713 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 2.069.516 | 490.517 | 445.013 | 2.115.020 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I ⁽¹⁾ | — | 44 | — | 44 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 449.310 | 94.503 | 45.410 | 498.403 |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 34.333 | — | 34.291 | 42 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 42 | — | — | 42 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 42 | 35.924 | 20 | 35.946 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 42 | 197 | — | 239 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 933.064 | 302.507 | 1.000.010 | 235.561 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 700.347 | 136.886 | 183.729 | 653.504 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 717.502 | 4.720 | 1.450 | 720.772 |
| BlackRock European Absolute Return Fund | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | 139.914 | 57.430 | 17.646 | 179.698 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 3.423.530 | 1.040.694 | 1.590.607 | 2.873.617 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | 77.799 | 40.734 | 11.295 | 107.238 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 197.305 | 41.283 | 85.696 | 152.892 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1.548.225 | 515.588 | 567.708 | 1.496.105 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 36.208 | 20.053 | 10.482 | 45.779 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 135.538 | 34.606 | 59.964 | 110.180 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 242.886 | 52.731 | 49.101 | 246.516 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 4.358.777 | 1.661.833 | 1.539.188 | 4.481.422 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse S | 88.594 | 84.192 | 26.948 | 145.838 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 173.543 | 123.651 | 71.567 | 225.627 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | | | | |
| Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 4.958 | 1.300 | 69 | 6.189 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 390.013 | 31.217 | 35.996 | 385.234 |
| Ausschüttungsanteile (G) der Klasse D | 473.018 | — | — | 473.018 |
| Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 12.872 | 73 | 5.295 | 7.650 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 367.316 | 28.534 | 121.018 | 274.832 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 172.115 | 6.700 | 12.472 | 166.343 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 217.927 | 52.587 | 8.252 | 262.262 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 37 | — | — | 37 |
| BlackRock European Select Strategies Fund | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | 62.884 | 18.073 | 29.104 | 51.853 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 183.132 | 12.288 | 83.212 | 112.208 |
| Auf CZK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 36.450 | 257 | 2.883 | 33.824 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 102.453 | 5.458 | 51.881 | 56.030 |
| Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D | 4.987 | — | 2.285 | 2.702 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 150.014 | 43.035 | 48.750 | 144.299 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse E | 452.873 | 20.660 | 161.822 | 311.711 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 882.848 | 38.345 | 262.982 | 658.211 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse I | 6.461 | 186.668 | 192.985 | 144 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 2.437.502 | 448.523 | 613.437 | 2.272.588 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 43 | — | — | 43 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 462 | 2.548 | 340 | 2.670 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 86.925 | 46.255 | 18.496 | 114.684 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 10.617 | 5.662 | 6.230 | 10.049 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 10.702 | 8.054 | 2.100 | 16.656 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 25.236 | 4.327 | — | 29.563 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 19.453 | 8.505 | 5.203 | 22.755 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 45 | — | — | 45 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | 119.789 | 33.093 | 4.168 | 148.714 |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | 50 | — | — | 50 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 50 | — | — | 50 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 93.200 | 200.561 | 46.418 | 247.343 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | 50 | — | — | 50 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1.050 | — | — | 1.050 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 51.968 | 60.595 | 22.672 | 89.891 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 2.013 | — | 1.963 | 50 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 3.499.792 | 1.012.560 | 1.200.326 | 3.312.026 |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | 2.643.768 | 201.610 | 695.404 | 2.149.974 |
| Auf CHF lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | 90.916 | 6.524 | 17.003 | 80.437 |
| Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | 18.162 | 2.166 | 2.103 | 18.225 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 771.533 | 39.205 | 220.609 | 590.129 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 4.874 | — | 4.818 | 56 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 462.584 | 34.180 | 112.204 | 384.560 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 12.068.523 | 3.295.662 | 4.421.582 | 10.942.603 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 42.906 | 221 | 14.472 | 28.655 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 9.406 | 18.708 | 3.405 | 24.709 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | 1.369.805 | 204.351 | 505.295 | 1.068.861 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 12.363 | 488 | 1.690 | 11.161 |
| Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 12.022 | 5.263 | 760 | 16.525 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 451.163 | 42.069 | 123.330 | 369.902 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 346.085 | 63.244 | 95.014 | 314.315 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 5.696.980 | 1.966.485 | 2.588.450 | 5.075.015 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 17.814 | 1.828 | 6.975 | 12.667 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 3.341.351 | 110.761 | 911.511 | 2.540.601 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse I | 1.550.902 | 71.323 | 1.329.651 | 292.574 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 12.914.391 | 2.636.707 | 7.937.765 | 7.613.333 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 747.023 | 97.650 | 220.582 | 624.091 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse S ⁽¹⁾ | — | 46 | — | 46 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S ⁽¹⁾ | — | 50 | — | 50 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse X | 1.487.937 | 721.084 | — | 2.209.021 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 1.939.875 | 276.094 | 476.608 | 1.739.361 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 58.503 | 37.290 | 94.003 | 1.790 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 5.023 | 34 | 2.647 | 2.410 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 4.633 | 55.309 | 1.182 | 58.760 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D | 36 | 6.324 | 125 | 6.235 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 92.581 | 159.195 | 25.100 | 226.676 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 2 | — | — | 2 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 6.894 | 8.555 | 2.505 | 12.944 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 755.949 | 57.660 | 197.927 | 615.682 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 23.532 | 707 | 3.090 | 21.149 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 18.857 | 5.500 | 13.180 | 11.177 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 472.193 | 148.762 | 136.981 | 483.974 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|--|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | | | | |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | 44 | — | — | 44 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1.250 | 1.458 | 300 | 2.408 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | 44 | — | — | 44 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2.457 | 2.134 | 986 | 3.605 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | 45 | 4.395 | — | 4.440 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 387.485 | 19.768 | 13.326 | 393.927 |
| Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 196.927 | 179.425 | 6.004 | 370.348 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 2.874 | — | — | 2.874 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 4.723 | — | 3.000 | 1.723 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 44 | — | — | 44 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | | | | |
| mit UK Reporting Fund Status | 12.879 | — | — | 12.879 |
| BlackRock Global Event Driven Fund | | | | |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | 20.503 | 35.805 | 13.683 | 42.625 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1.304.823 | 1.089.500 | 588.289 | 1.806.034 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 67.373 | 38.957 | 11.267 | 95.063 |
| HKD-Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 39 | — | — | 39 |
| SGD-Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 30.151 | 5.428 | 900 | 34.679 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | | | | |
| mit UK Reporting Fund Status | 6.523.618 | 1.705.019 | 3.295.129 | 4.933.508 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 45 | — | — | 45 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D | | | | |
| mit UK Reporting Fund Status | 5.121 | 5.978 | 128 | 10.971 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 298.695 | 39.140 | 17.824 | 320.011 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 2.433.970 | 1.452.994 | 1.196.984 | 2.689.980 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | | | | |
| mit UK Reporting Fund Status | 2.114.081 | 1.416.545 | 1.039.145 | 2.491.481 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | | | | |
| mit UK Reporting Fund Status | 2.795.785 | 1.018.417 | 1.864.905 | 1.949.297 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 524.034 | 426.627 | 164.767 | 785.894 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1.341.284 | 790.328 | 335.104 | 1.796.508 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 173.175 | 67.158 | 63.022 | 177.311 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I | | | | |
| mit UK Reporting Fund Status | 250.708 | 882.603 | 325.032 | 808.279 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I | | | | |
| mit UK Reporting Fund Status | 4.381.693 | 1.589.577 | 666.568 | 5.304.702 |
| Auf BRL lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1.208.671 | 578.815 | 715.173 | 1.072.313 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 744.465 | 1.280 | 264 | 745.481 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 3.731.568 | 1.748.034 | 1.429.229 | 4.050.373 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | | | | |
| mit UK Reporting Fund Status | 143.575 | 221.052 | 176.344 | 188.283 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | | | | |
| mit UK Reporting Fund Status | 11.356.865 | 6.676.747 | 6.372.345 | 11.661.267 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse IA | 531.483 | 63.543 | 90.188 | 504.838 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse IA | 362.197 | 592.970 | 115.607 | 839.560 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse S | 10.522 | 7.552 | 4.116 | 13.958 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S | 421.682 | 231.859 | 138.392 | 515.149 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 93.684 | 65.868 | 9.405 | 150.147 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 52.432 | — | — | 52.432 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 122.359 | — | 21.897 | 100.462 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | | | | |
| mit UK Reporting Fund Status | 153.271 | — | 4.917 | 148.354 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | | | | |
| mit UK Reporting Fund Status | 221.876 | — | 22.037 | 199.839 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | | | | |
| Auf CHF lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A ⁽¹⁾ | — | 12.791 | — | 12.791 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 855.554 | 2.447.329 | 240.035 | 3.062.848 |
| Auf AUD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | — | 68 | — | 68 |
| Auf CAD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | — | 63 | — | 63 |
| Auf CNH lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | — | 32 | — | 32 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 33.511 | 171.994 | 14.293 | 191.212 |
| Auf HKD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 112.142 | 121.158 | — | 233.300 |
| Auf SGD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 38.844 | 359.087 | 6.184 | 391.747 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 137.979 | 240.748 | 42.443 | 336.284 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A ⁽¹⁾ | — | 1.594 | 260 | 1.334 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A ⁽¹⁾ | — | 14.688 | — | 14.688 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | 1.082.778 | 3.519.990 | 260.753 | 4.342.015 |
| Auf SGD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | — | 70.615 | 3.651 | 66.964 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 141.985 | 81.293 | 117.812 | 105.466 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 20.371 | 79.302 | 39.614 | 60.059 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I ⁽¹⁾ | — | 99.931 | — | 99.931 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | — | 59.123 | 1.448 | 57.675 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | — | 35.009 | — | 35.009 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | — | 27.013 | — | 27.013 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status ⁽¹⁾ | — | 486 | — | 486 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | 383.674 | 112.590 | 383.093 | 113.171 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 51.212 | 13.895 | — | 65.107 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | 7.773 | 3.511 | 811 | 10.473 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 20.499 | 24.296 | 6.820 | 37.975 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 4.178 | 27.348 | 1.752 | 29.774 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | 15.444 | 1.496 | 822 | 16.118 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 38.318 | 17.223 | 10.583 | 44.958 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 121.782 | 5.897 | 5.785 | 121.894 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 4.490 | 9.180 | 1.193 | 12.477 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 84 | 992 | 88 | 988 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 3.792 | 53.730 | 1.975 | 55.547 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Balance | 722.885 | 25.814 | 196.797 | 551.902 |
| Vermögensstrategie Moderat - Ausgewogen ausschüttender Anteil | 45 | 1.205 | — | 1.250 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | 295.614 | 18.138 | 115.861 | 197.891 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 11.665 | 6.609 | 4.127 | 14.147 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 136.353 | 26.637 | 46.859 | 116.131 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 103.512 | 19.309 | 28.091 | 94.730 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 110.760 | 24.243 | 17.177 | 117.826 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 3.422 | 2.125 | 594 | 4.953 |
| Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 172.116 | 73.493 | 24.667 | 220.942 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 16.366 | 710 | 80 | 16.996 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 257.442 | 47.618 | 51.527 | 253.533 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 35.832 | 29.079 | 12.667 | 52.244 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 73.593 | 54.504 | 25.753 | 102.344 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 144 | 47 | — | 191 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 3.338 | 42.821 | 5.106 | 41.053 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 56.828 | 6.449 | 6.061 | 57.216 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Substanz | 210.227 | 408 | 49.839 | 160.796 |
| Vermögensstrategie Defensiv ausschüttender Anteil | 4.645 | 4.400 | — | 9.045 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 50 | — | — | 50 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | 652.175 | 128.607 | 76.126 | 704.656 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 9.663 | 8.732 | 1.966 | 16.429 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 149.852 | 103.209 | 43.977 | 209.084 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 289.567 | 187.136 | 67.125 | 409.578 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 304.463 | 83.802 | 41.380 | 346.885 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 2.799 | 1.128 | 90 | 3.837 |
| Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 29.808 | 21.019 | 21.568 | 29.259 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 14.143 | 2.269 | 2.024 | 14.388 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 127.207 | 54.747 | 58.432 | 123.522 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 178.410 | 187.802 | 78.446 | 287.766 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 195.703 | 196.353 | 49.585 | 342.471 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1.510 | 1.933 | 226 | 3.217 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 5.485 | 67.356 | 985 | 71.856 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 25.251 | 8.749 | 12.143 | 21.857 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Chance | 547.909 | 28.797 | 105.757 | 470.949 |
| Vermögensstrategie Wachstum ausschüttender Anteil | 29.415 | 9.545 | 9.510 | 29.450 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 43 | — | — | 43 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | 852.947 | 72.989 | 127.691 | 798.245 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 17.098 | 5.459 | 3.343 | 19.214 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 265.137 | 133.581 | 70.881 | 327.837 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 907.455 | 710.049 | 109.031 | 1.508.473 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 278.326 | 74.173 | 29.975 | 322.524 |
| Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1.583 | 9.973 | 230 | 11.326 |
| Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 165.290 | 35.539 | 29.990 | 170.839 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 26.137 | 2.173 | 5.677 | 22.633 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 506.144 | 196.849 | 196.349 | 506.644 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 285.410 | 172.838 | 65.483 | 392.765 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 667.321 | 266.031 | 155.588 | 777.764 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 654 | 194 | — | 848 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse I | 357.252 | 1.975 | 147.000 | 212.227 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 5.576 | 87.735 | 462 | 92.849 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 185.683 | 54.830 | 26.595 | 213.918 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Wachstum | 949.110 | 24.117 | 226.103 | 747.124 |
| IndexInvest Wachstum, auf CHF lautender, abgesicherter ausschüttender Anteil | 15.858 | 988 | 2.481 | 14.365 |
| Vermögensstrategie Ausgewogen ausschüttender Anteil | 37.395 | 10.335 | 30.000 | 17.730 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 50 | — | — | 50 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 2.519 | 5.597 | 1.308 | 6.808 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 10.604 | 19.633 | 6.932 | 23.305 |
| BlackRock Style Advantage Fund | | | | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse A | 463 | 868 | 709 | 622 |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | 1.769 | 87 | 88 | 1.768 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 4.859 | 5.575 | 2.969 | 7.465 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 45 | — | — | 45 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 440 | — | — | 440 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 5.369 | — | 70 | 5.299 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | 46 | 434 | — | 480 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 11.477 | 9.545 | 14.740 | 6.282 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 29.800 | 959 | 5.155 | 25.604 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 2.680 | 183 | 641 | 2.222 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 3.564 | 2.114 | 2.230 | 3.448 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1.875 | 890 | 617 | 2.148 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil PF der Klasse I | 50 | — | — | 50 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil PF der Klasse I | 2.601 | — | 2.556 | 45 |
| Auf BRL lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 50 | — | — | 50 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 48 | — | — | 48 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 467.037 | — | 466.987 | 50 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 145.625 | — | 145.440 | 185 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 161.198 | 171 | 157.265 | 4.104 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 1.135.933 | 254.235 | 123.936 | 1.266.232 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 659 | 2.259 | 247 | 2.671 |
| Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 348.139 | 346.263 | 204.533 | 489.869 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 42 | — | — | 42 |
| Auf NZD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 2 | — | — | 2 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | 35 | — | — | 35 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 50 | — | — | 50 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 46 | — | — | 46 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Style Advantage Screened Fund⁽²⁾ | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 50 | — | 50 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 50 | — | 50 | — |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 44 | — | 44 | — |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 39 | — | 39 | — |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 219 | 112 | 331 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 50 | — | 50 | — |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | 44 | — | 44 | — |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 44 | — | 44 | — |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 39 | — | 39 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 249.650 | — | 249.650 | — |
| Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 64.284 | — | 64.284 | — |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 44.529 | 46.951 | 21.628 | 69.852 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | 332.183 | 566.015 | 306.281 | 591.917 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 126.168 | 253.565 | 70.145 | 309.588 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 49 | — | — | 49 |
| Auf JPY lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | 143.681 | 205.758 | 5.709 | 343.730 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 54.779 | 11.737 | 12.604 | 53.912 |
| Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | 651.971 | — | 89.079 | 562.892 |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1.618 | 1.188 | 357 | 2.449 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1.142 | — | 916 | 226 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 8.841 | 3.325 | 1.830 | 10.336 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 3.408 | 1.071 | 1.438 | 3.041 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 609.891 | 156.235 | 141.260 | 624.866 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | 925 | 50 | 50 | 925 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 3.436 | 435 | 257 | 3.614 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X | 227.932 | — | 20.347 | 207.585 |
| Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X | 45.110 | 3.912 | 6.077 | 42.945 |
| Auf JPY lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X | 207.966 | — | 207.910 | 56 |
| BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 38.547 | 330 | 23.228 | 15.649 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 42.815 | — | 2.001 | 40.814 |
| Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 589 | 1.365 | 1.199 | 755 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 45 | — | — | 45 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse C | 1.038 | — | 509 | 529 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 7.322 | 46.927 | 15.701 | 38.548 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 148.443 | 333.860 | 190.602 | 291.701 |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 3.659 | 1.155 | 1.834 | 2.980 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 102.173 | 8.022 | 31.012 | 79.183 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 8.894 | 585 | 9.435 | 44 |
| Ausschüttungsanteil der Klasse J | 32.496 | — | 4.992 | 27.504 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 7.690 | 795 | 3.226 | 5.259 |
| BlackRock Total Advantage Fund⁽²⁾ | | | | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | 50 | — | 50 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D | 50 | — | 50 | — |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 60 | — | 60 | — |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 45 | — | 45 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2.555 | 372 | 2.927 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse I | 50 | — | 50 | — |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 183.699 | — | 183.699 | — |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|--|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | | | | |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | 49 | — | 4 | 45 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 45 | — | — | 45 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 39 | 14 | — | 53 |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 49 | — | — | 49 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | 49 | 70 | — | 119 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 2.677 | 518 | 3.104 | 91 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 50 | — | — | 50 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 567 | — | 528 | 39 |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 573 | 1.363 | — | 1.936 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 960 | 997 | 242 | 1.715 |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 244.776 | 223.149 | 143.478 | 324.447 |
| Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1.551.857 | 913.580 | — | 2.465.437 |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 168.871 | — | 71.046 | 97.825 |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | 8.704 | 2.542 | 3.991 | 7.255 |

⁽¹⁾ Auflegung einer neuen Anteilsklasse, nähere Informationen sind Anhang I zu entnehmen.

⁽²⁾ Der Fonds wurde aufgelöst, Näheres hierzu siehe Anmerkung 1.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|---------------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| STAMMAKTIEN | | | | Gesamt Einlagezertifikate | | | |
| | Kanada | | | | | | |
| 78.623 | Bausch + Lomb Corp | 1.360.964 | 0,17 | | | | |
| | | 1.360.964 | 0,17 | | | | |
| | Kaimaninseln | | | | | | |
| 152.274 | Apollo Strategic Growth Capital II (Unit) | 1.504.467 | 0,19 | | | | |
| | | 1.504.467 | 0,19 | | | | |
| | Israel | | | | | | |
| 617 | Monday.com Ltd | 70.171 | 0,01 | | | | |
| | | 70.171 | 0,01 | | | | |
| | Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | |
| 3.908 | Excelerate Energy Inc 'A' | 101.999 | 0,01 | | | | |
| 8.587 | Marqeta Inc 'A' | 92.482 | 0,01 | | | | |
| 58.873 | Samsara Inc 'A' | 659.378 | 0,09 | | | | |
| 2.922 | SentinelOne Inc 'A' | 74.832 | 0,01 | | | | |
| | | 928.691 | 0,12 | | | | |
| | Gesamt Stammaktien | | | | | | |
| | | 3.864.293 | 0,49 | | | | |
| ANLEIHEN | | | | KURZFRISTIGE TITEL | | | |
| | Vereinigte Staaten von Amerika | | | | Australien | | |
| USD 20.900.000 | United States Treasury Bill 16/6/2022 (Zero Coupon) | 20.895.380 | 2,66 | USD 18.000.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd 7/7/2022 (Zero Coupon) | 17.982.000 | 2,29 |
| USD 6.750.000 | United States Treasury Bill 3/11/2022 (Zero Coupon) | 6.725.515 | 0,86 | USD 6.000.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd 28/7/2022 (Zero Coupon) | 5.997.720 | 0,76 |
| USD 5.500.000 | United States Treasury Bill 29/12/2022 (Zero Coupon) | 5.458.963 | 0,69 | USD 4.250.000 | National Australia Bank Ltd 24/2/2023 (Zero Coupon) | 4.205.705 | 0,53 |
| USD 5.000.000 | United States Treasury Bill 23/3/2023 (Zero Coupon) | 4.928.504 | 0,63 | USD 5.000.000 | Westpac Banking Corp 20/10/2022 (Zero Coupon) | 4.993.342 | 0,64 |
| USD 11.000.000 | United States Treasury Bill 20/4/2023 (Zero Coupon) | 10.808.533 | 1,38 | | | 33.178.767 | 4,22 |
| USD 6.500.000 | United States Treasury Note/Bond 0,125% 31/1/2023 | 6.428.864 | 0,82 | | | | |
| | | 55.245.759 | 7,04 | | | | |
| | Gesamt Anleihen | | | | | | |
| | | 55.245.759 | 7,04 | | | | |
| EINLAGENZERTIFIKATE | | | | | Kanada | | |
| USD 6.400.000 | Bank Of Montreal 1,28% 5/5/2023 | 6.400.000 | 0,82 | USD 8.000.000 | CDP Financial Inc 5/7/2022 (Zero Coupon) | 7.997.582 | 1,02 |
| USD 11.000.000 | Royal Bank of Canada FRN 20/10/2022 | 10.930.604 | 1,39 | USD 3.000.000 | CDP Financial Inc 2/8/2022 (Zero Coupon) | 2.996.797 | 0,38 |
| USD 5.500.000 | Toronto-Dominion Bank FRN 21/4/2023 | 5.500.000 | 0,70 | USD 7.000.000 | National Bank of Canada 0,94% 28/7/2022 | 7.000.000 | 0,89 |
| USD 3.000.000 | Toronto-Dominion Bank FRN 28/4/2023 | 3.000.000 | 0,38 | USD 5.000.000 | National Bank of Canada 1,18% 13/1/2023 | 5.000.000 | 0,64 |
| | | 25.830.604 | 3,29 | USD 10.000.000 | National Bank Of Canada 10/11/2022 (Zero Coupon) | 10.000.000 | 1,27 |
| | Japan | | | USD 7.150.000 | Toronto-Dominion Bank 11/10/2022 (Zero Coupon) | 7.122.472 | 0,91 |
| USD 15.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp 1,23% 22/7/2022 | 15.000.000 | 1,91 | USD 5.250.000 | Toronto-Dominion Bank FRN 2/3/2023 | 5.190.063 | 0,66 |
| USD 9.750.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp 1,15% 19/10/2022 | 9.750.138 | 1,24 | | | 45.306.914 | 5,77 |
| | | 24.750.138 | 3,15 | | | | |
| | Spanien | | | | | | |
| USD 14.500.000 | Banco Santander SA 1,23% 28/10/2022 | 14.500.000 | 1,85 | | | | |
| | | 14.500.000 | 1,85 | | | | |
| | | | | | Frankreich | | |
| | | | | USD 15.000.000 | Antalis SA 1/6/2022 (Zero Coupon) | 15.000.000 | 1,91 |
| | | | | USD 8.000.000 | BPCE SA 1/7/2022 (Zero Coupon) | 7.997.666 | 1,02 |
| | | | | USD 1.650.000 | BPCE SA 8/11/2022 (Zero Coupon) | 1.635.187 | 0,21 |
| | | | | USD 5.000.000 | BPCE SA 22/2/2023 (Zero Coupon) | 4.948.278 | 0,63 |
| | | | | USD 7.000.000 | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 27/6/2022 (Zero Coupon) | 6.995.248 | 0,89 |
| | | | | | | 36.576.379 | 4,66 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|----------------|---|------------------------|--------------------|----------------|---|------------------------|--------------------|
| | Irland | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | |
| USD 16.000.000 | Glencore Funding LLC 27/6/2022 (Zero Coupon) | 15.988.098 | 2,03 | USD 6.000.000 | Bedford Row Funding Corp FRN 25/8/2022 | 6.000.000 | 0,76 |
| USD 7.000.000 | Glencore Funding LLC 23/8/2022 (Zero Coupon) | 6.975.146 | 0,89 | USD 12.500.000 | Bennington Stark Capital Co 10/6/2022 (Zero Coupon) | 12.497.187 | 1,59 |
| | | 22.963.244 | 2,92 | USD 9.000.000 | BNP Paribas SA 16/6/2022 (Zero Coupon) | 8.996.738 | 1,15 |
| | Japan | | | USD 5.000.000 | BNZ International Funding Ltd FRN 19/8/2022 | 5.000.000 | 0,64 |
| USD 13.390.000 | Mizuho Bank Ltd 15/6/2022 (Zero Coupon) | 13.385.730 | 1,70 | USD 10.000.000 | Britannia Funding Company LLC 6/6/2022 (Zero Coupon) | 9.998.722 | 1,27 |
| | | 13.385.730 | 1,70 | USD 10.000.000 | Charta LLC 2/6/2022 (Zero Coupon) | 9.999.789 | 1,27 |
| | Jersey | | | USD 9.000.000 | Commonwealth Bank of Australia 1/9/2022 (Zero Coupon) | 9.000.000 | 1,15 |
| USD 7.800.000 | Cancara Asset Securitisation LLC 23/8/2022 (Zero Coupon) | 7.773.025 | 0,99 | USD 12.500.000 | Goldman Sachs International 6/6/2022 (Zero Coupon) | 12.498.559 | 1,59 |
| | | 7.773.025 | 0,99 | USD 2.000.000 | Gotham Funding 6/6/2022 (Zero Coupon) | 1.999.794 | 0,25 |
| | Neuseeland | | | USD 11.000.000 | GTA Funding LLC 21/6/2022 (Zero Coupon) | 10.994.378 | 1,40 |
| USD 5.000.000 | ASB Finance Ltd 2/8/2022 (Zero Coupon) | 4.998.278 | 0,64 | USD 14.150.000 | ING US Funding LLC 7/6/2022 (Zero Coupon) | 14.147.877 | 1,80 |
| | | 4.998.278 | 0,64 | USD 7.500.000 | ING US Funding LLC 8/8/2022 (Zero Coupon) | 7.491.075 | 0,95 |
| | Norwegen | | | USD 11.000.000 | JP Morgan Securities LLC 2/11/2022 (Zero Coupon) | 10.948.239 | 1,39 |
| USD 6.500.000 | DNB Bank ASA 2/3/2023 (Zero Coupon) | 6.425.792 | 0,82 | USD 15.000.000 | Lime Funding LLC 24/6/2022 (Zero Coupon) | 14.990.992 | 1,91 |
| | | 6.425.792 | 0,82 | USD 1.000.000 | LMA SA 28/7/2022 (Zero Coupon) | 998.781 | 0,13 |
| | Spanien | | | USD 8.850.000 | Mackinac Funding Co LLC 16/8/2022 (Zero Coupon) | 8.833.559 | 1,12 |
| USD 12.500.000 | Banco Santander SA FRN 6/6/2022 | 12.498.524 | 1,59 | USD 13.538.000 | Macquarie Bank Ltd 24/8/2022 (Zero Coupon) | 13.487.142 | 1,72 |
| USD 8.000.000 | Banco Santander SA 1/7/2022 (Zero Coupon) | 7.993.733 | 1,02 | USD 9.750.000 | National Australia Bank Ltd 25/10/2022 (Zero Coupon) | 9.750.000 | 1,24 |
| | | 20.492.257 | 2,61 | USD 17.850.000 | Nieuw Amsterdam Receivables Corp 23/6/2022 (Zero Coupon) | 17.840.533 | 2,27 |
| | Schweden | | | USD 1.950.000 | Old Line Funding LLC 4/8/2022 (Zero Coupon) | 1.947.088 | 0,25 |
| USD 6.500.000 | Nordea Bank Abp 21/10/2022 (Zero Coupon) | 6.492.180 | 0,83 | USD 8.725.000 | Old Line Funding LLC 15/8/2022 (Zero Coupon) | 8.709.004 | 1,11 |
| USD 4.300.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB 21/6/2022 (Zero Coupon) | 4.299.427 | 0,55 | USD 17.050.000 | Old Line Funding LLC 16/8/2022 (Zero Coupon) | 17.003.927 | 2,17 |
| USD 7.000.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB 6/9/2022 (Zero Coupon) | 6.996.322 | 0,89 | USD 6.935.000 | Ontario Teachers' Finance Trust 6/7/2022 (Zero Coupon) | 6.932.640 | 0,88 |
| USD 4.000.000 | Svenska Handelsbanken AB 27/10/2022 (Zero Coupon) | 3.994.409 | 0,51 | USD 4.000.000 | Regatta Funding Co LLC 1/8/2022 (Zero Coupon) | 3.997.424 | 0,51 |
| USD 2.500.000 | Svenska Handelsbanken AB FRN 14/2/2023 | 2.475.992 | 0,31 | USD 5.500.000 | Salisbury Receivables Company LLC 14/7/2022 (Zero Coupon) | 5.500.000 | 0,70 |
| USD 14.000.000 | Swedbank AB 30/6/2022 (Zero Coupon) | 13.990.526 | 1,78 | USD 5.250.000 | Siemens Capital Co LLC 28/6/2022 (Zero Coupon) | 5.246.417 | 0,67 |
| USD 5.000.000 | Swedbank AB 1,13% 13/10/2022 | 5.000.000 | 0,64 | USD 6.000.000 | Societe Generale SA 24/6/2022 (Zero Coupon) | 5.996.512 | 0,76 |
| | | 43.248.856 | 5,51 | USD 3.000.000 | Societe Generale SA 13/10/2022 (Zero Coupon) | 2.996.818 | 0,38 |
| | Großbritannien | | | USD 1.400.000 | Societe Generale SA 4/1/2023 (Zero Coupon) | 1.388.186 | 0,18 |
| USD 18.000.000 | Lloyds Bank Plc 15/6/2022 (Zero Coupon) | 17.993.630 | 2,29 | USD 11.650.000 | ST Engineering North America Inc 17/6/2022 (Zero Coupon) | 11.645.340 | 1,48 |
| | | 17.993.630 | 2,29 | USD 7.000.000 | Starbird Funding Corp 1,23% 8/7/2022 | 7.000.000 | 0,89 |
| | Vereinigte Staaten von Amerika | | | USD 5.000.000 | Swedbank AB FRN 23/11/2022 | 5.000.000 | 0,64 |
| USD 9.350.000 | Alinghi Funding Co LLC 17/8/2022 (Zero Coupon) | 9.333.475 | 1,19 | USD 2.500.000 | Thunder Bay Funding LLC 1/7/2022 (Zero Coupon) | 2.498.333 | 0,32 |
| USD 9.600.000 | Amazon.com Inc 30/11/2022 (Zero Coupon) | 9.553.893 | 1,22 | | | | |
| USD 5.000.000 | ASB Bank Ltd FRN 8/9/2022 | 5.000.000 | 0,64 | | | | |
| USD 9.000.000 | Atlantic Asset Securitization LLC 11/7/2022 (Zero Coupon) | 8.992.500 | 1,15 | | | | |
| USD 5.400.000 | Atlantic Asset Securitization LLC 11/8/2022 (Zero Coupon) | 5.384.558 | 0,69 | | | | |
| USD 5.000.000 | Bedford Row Funding Corp 14/7/2022 (Zero Coupon) | 5.000.000 | 0,64 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| USD 2.000.000 | Thunder Bay Funding LLC 22/7/2022 (Zero Coupon) | 1.996.458 | 0,25 |
| USD 8.000.000 | Thunder Bay Funding LLC 7/11/2022 (Zero Coupon) | 7.928.627 | 1,01 |
| USD 6.000.000 | United Overseas Bank Ltd FRN 27/10/2022 | 6.000.000 | 0,76 |
| USD 8.000.000 | Versailles Commercial Paper LLC 12/7/2022 (Zero Coupon) | 7.990.251 | 1,02 |
| USD 10.750.000 | Walmart Inc 13/6/2022 (Zero Coupon) | 10.747.026 | 1,37 |
| | | 349.261.842 | 44,48 |
| Gesamt kurzfristige Titel | | 601.604.714 | 76,61 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 782.741.746 | 99,68 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 782.741.746 | 99,68 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 2.498.019 | 0,32 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | 785.239.765 | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------------------|--|-----------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (11.610) | 3M Co | Bank of America | |
| Brasilien | | | | (13.748) | 3M Co | Merrill Lynch | 35.747 |
| 13.100 | Agrenco Ltd ¹ | Morgan Stanley | (437) | (8.960) | 3M Co | Barclays Bank | (31.620) |
| (3) | Banco ABC Brasil SA (Pref) ¹ | Morgan Stanley | — | (10.324) | 3M Co | Goldman Sachs | 21.702 |
| 13.700 | Laep Investments Ltd ¹ | Goldman Sachs | (759) | (20.806) | 3M Co | HSBC | 47.346 |
| 24.300 | Laep Investments Ltd ¹ | Morgan Stanley | (1.418) | 7.309 | 4D Molecular Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (47.854) |
| | | | (2.614) | 4.473 | 89bio Inc | Barclays Bank | (512) |
| Kanada | | | | 5.241 | 8x8 Inc | Bank of America | |
| 2.976 | Perpetua Resources Corp | Bank of America | | 1.926 | 8x8 Inc | Merrill Lynch | 1.521 |
| | | Merrill Lynch | 1.607 | 5.244 | 8x8 Inc | Bank of America | |
| 17.929 | Perpetua Resources Corp | Barclays Bank | 6.454 | 87.174 | 8x8 Inc | Merrill Lynch | (2.647) |
| 10.152 | Perpetua Resources Corp | Goldman Sachs | 5.482 | 4.711 | 8x8 Inc | Barclays Bank | (703) |
| 7.931 | Perpetua Resources Corp | HSBC | 1.983 | (10.511) | 908 Devices Inc | Goldman Sachs | (2.648) |
| 12.710 | Perpetua Resources Corp | Morgan Stanley | 4.576 | (5.406) | 908 Devices Inc | HSBC | (64.507) |
| (26.058) | Poseidon Concepts Corp ¹ | Morgan Stanley | 5.473 | (3.229) | 908 Devices Inc | Morgan Stanley | (1.720) |
| 12.100 | Sears Canada Inc ¹ | Morgan Stanley | (5.833) | (14.505) | A O Smith Corp | Barclays Bank | (6.622) |
| | | | 19.742 | (8.456) | A O Smith Corp | HSBC | 2.919 |
| Mexiko | | | | (15.638) | A O Smith Corp | Morgan Stanley | (2.034) |
| 12.916 | Prologis Property Mexico SA de CV (REIT) | Goldman Sachs | — | (1.425) | A O Smith Corp | Bank of America | |
| | | | — | (6.310) | A O Smith Corp | Merrill Lynch | (12.184) |
| Panama | | | | (3.153) | A10 Networks Inc | Barclays Bank | (12.261) |
| (6.456) | Copa Holdings SA 'A' | Barclays Bank | (11.040) | (20.847) | A10 Networks Inc | Goldman Sachs | (10.488) |
| (3.195) | Copa Holdings SA 'A' | Goldman Sachs | (6.486) | (17.398) | A10 Networks Inc | HSBC | (2.798) |
| | | | (17.526) | (2.174) | A10 Networks Inc | Morgan Stanley | (9.332) |
| Peru | | | | (13.837) | A10 Networks Inc | Bank of America | |
| 7.452 | Tahoe Resources Inc | Morgan Stanley | 74 | (3.994) | AAON Inc | Merrill Lynch | (1.091) |
| | | | 74 | (18.080) | AAON Inc | Barclays Bank | (21.264) |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | (12.287) | AAON Inc | Goldman Sachs | (11.657) |
| (3.958) | 10X Genomics Inc 'A' | Bank of America | | 12.491 | AAR Corp | HSBC | (3.978) |
| | | Merrill Lynch | (21.373) | 7.986 | AAR Corp | Morgan Stanley | (14.347) |
| (12.099) | 10X Genomics Inc 'A' | Barclays Bank | (23.472) | (3.394) | AAON Inc | Barclays Bank | (3.666) |
| (4.436) | 10X Genomics Inc 'A' | Goldman Sachs | (23.954) | (18.080) | AAON Inc | Goldman Sachs | (25.131) |
| (6.967) | 10X Genomics Inc 'A' | HSBC | (29.958) | (12.287) | AAON Inc | HSBC | 19.905 |
| (10.837) | 10X Genomics Inc 'A' | Morgan Stanley | (21.024) | 12.491 | AAR Corp | Barclays Bank | 22.734 |
| 2.300 | 1-800-Flowers.com Inc 'A' | Bank of America | | 7.986 | AAR Corp | Goldman Sachs | 24.517 |
| | | Merrill Lynch | (2.116) | 20.166 | AAR Corp | HSBC | 64.733 |
| 6.078 | 1-800-Flowers.com Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.611) | 3.391 | Aaron's Co Inc | Bank of America | |
| 8.066 | 1-800-Flowers.com Inc 'A' | HSBC | (9.679) | 12.351 | Aaron's Co Inc | Merrill Lynch | (4.001) |
| 17.317 | 1-800-Flowers.com Inc 'A' | Morgan Stanley | 3.983 | 19.457 | Aaron's Co Inc | Barclays Bank | 8.893 |
| 2.406 | 1Life Healthcare Inc | Bank of America | | 16.259 | Aaron's Co Inc | Goldman Sachs | (22.959) |
| | | Merrill Lynch | 1.300 | 6.620 | Aaron's Co Inc | HSBC | (22.437) |
| 22.171 | 1Life Healthcare Inc | Barclays Bank | (5.764) | 2.266 | Abbott Laboratories | Morgan Stanley | 4.766 |
| 46.722 | 1Life Healthcare Inc | Goldman Sachs | 25.230 | 11.538 | Abbott Laboratories | Bank of America | |
| 29.873 | 1Life Healthcare Inc | HSBC | 55.310 | 10.768 | Abbott Laboratories | Merrill Lynch | 12.599 |
| 11.255 | 1Life Healthcare Inc | Morgan Stanley | (2.926) | (2.775) | Abbott Laboratories | Barclays Bank | 2.769 |
| (9.382) | 1st Source Corp | Barclays Bank | (6.661) | 696 | Abbott Laboratories | Goldman Sachs | 54.583 |
| (32.887) | 1st Source Corp | Goldman Sachs | (73.009) | (2.783) | Abbott Laboratories | HSBC | (15.429) |
| (2.621) | 1stdibs.com Inc | Bank of America | | 7.330 | Abbott Laboratories | HSBC | 2.105 |
| | | Merrill Lynch | (1.389) | (4.436) | Abbott Laboratories | Morgan Stanley | (2.315) |
| (1.493) | 1stdibs.com Inc | Barclays Bank | (523) | (1.938) | AbbVie Inc | Morgan Stanley | (1.065) |
| (1.086) | 1stdibs.com Inc | Goldman Sachs | (576) | (5.327) | AbbVie Inc | Bank of America | |
| (1.575) | 1stdibs.com Inc | HSBC | 1.402 | (7.103) | AbbVie Inc | Merrill Lynch | 15.291 |
| (971) | 2seventy bio Inc | Barclays Bank | 87 | (6.559) | AbbVie Inc | Barclays Bank | 2.397 |
| (8.577) | 2seventy bio Inc | Goldman Sachs | (2.487) | (1.248) | AbbVie Inc | Goldman Sachs | 56.043 |
| (1.496) | 2seventy bio Inc | HSBC | (583) | (20.449) | Abercrombie & Fitch Co 'A' | HSBC | 22.169 |
| 4.292 | 2U Inc | Bank of America | | (3.307) | Abercrombie & Fitch Co 'A' | Morgan Stanley | 562 |
| | | Merrill Lynch | (2.446) | (604) | ABIOMED Inc | Barclays Bank | 123.307 |
| 19.818 | 2U Inc | Barclays Bank | (22.989) | (771) | ABIOMED Inc | HSBC | 42.391 |
| 455 | 2U Inc | Goldman Sachs | (259) | (525) | ABIOMED Inc | Bank of America | |
| 388 | 2U Inc | HSBC | (54) | (3.460) | ABIOMED Inc | Merrill Lynch | (12.075) |
| (6.112) | 3D Systems Corp | Barclays Bank | (4.645) | (222) | ABIOMED Inc | Barclays Bank | (8.242) |
| (19.008) | 3D Systems Corp | Goldman Sachs | (17.488) | (2.231) | ABM Industries Inc | Goldman Sachs | (3.213) |
| (17.666) | 3D Systems Corp | HSBC | (13.779) | (1.587) | ABM Industries Inc | HSBC | (89.187) |
| (7.609) | 3D Systems Corp | Morgan Stanley | (5.783) | (20.992) | ABM Industries Inc | Morgan Stanley | (2.373) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|----------------------------------|---|---|-------------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 6.251 | Absci Corp | Barclays Bank | 2.375 | 3.716 | Aclaris Therapeutics Inc | Barclays Bank | 2.081 |
| (23.628) | Acacia Research Corp | Bank of America Merrill Lynch | (6.130) | 1.456 | Aclaris Therapeutics Inc | HSBC | 2.417 |
| (32.199) | Acacia Research Corp | Barclays Bank | (13.041) | 2.373 | Aclaris Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.329 |
| (23.898) | Acacia Research Corp | Goldman Sachs | (7.767) | (18.000) | ACNB Corp | Barclays Bank | (12.600) |
| (47.759) | Acacia Research Corp | HSBC | (11.892) | (14.089) | ACNB Corp | Goldman Sachs | (7.326) |
| (46.109) | Acacia Research Corp | Morgan Stanley | (18.674) | (1.173) | ACNB Corp | HSBC | 774 |
| 814 | Academy Sports & Outdoors Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.739 | 1.323 | Actua Corp* | Bank of America Merrill Lynch | (1.244) |
| 16.755 | Academy Sports & Outdoors Inc | Barclays Bank | 46.244 | (6.239) | Acuity Brands Inc | Barclays Bank | (44.359) |
| 4.442 | Academy Sports & Outdoors Inc | Goldman Sachs | (13.726) | (7.449) | Acuity Brands Inc | Goldman Sachs | (56.911) |
| 7.125 | Academy Sports & Outdoors Inc | HSBC | 20.586 | (405) | Acuity Brands Inc | Morgan Stanley | (2.880) |
| 5.475 | Academy Sports & Outdoors Inc | Morgan Stanley | 15.111 | 5.695 | Acumen Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.822 |
| (3.268) | Acadia Healthcare Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.778) | 6.724 | Acumen Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 672 |
| (10.614) | Acadia Healthcare Co Inc | Barclays Bank | (15.285) | 4.817 | Acumen Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 1.541 |
| (5.328) | Acadia Healthcare Co Inc | Goldman Sachs | (4.884) | 3.177 | Acumen Pharmaceuticals Inc | HSBC | 762 |
| (13.645) | Acadia Healthcare Co Inc | HSBC | (74.502) | 4.166 | Acumen Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 417 |
| (5.205) | Acadia Healthcare Co Inc | Morgan Stanley | (7.495) | (2.026) | Acushnet Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 177 |
| (16.267) | ACADIA Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.789) | (25.732) | Acushnet Holdings Corp | Barclays Bank | (23.673) |
| (11.032) | ACADIA Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (1.214) | (9.571) | Acushnet Holdings Corp | Goldman Sachs | 15.461 |
| 7.211 | Acadia Realty Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 288 | (9.551) | Acushnet Holdings Corp | HSBC | 12.261 |
| 41.400 | Acadia Realty Trust (REIT) | Barclays Bank | 65.826 | (6.205) | Acushnet Holdings Corp | Morgan Stanley | (6.610) |
| 32.707 | Acadia Realty Trust (REIT) | Goldman Sachs | 1.308 | 1.134 | Adams Resources & Energy Inc | Barclays Bank | 2.835 |
| 87.502 | Acadia Realty Trust (REIT) | HSBC | 40.251 | 1.166 | Adams Resources & Energy Inc | Goldman Sachs | 2.927 |
| 14.498 | Acadia Realty Trust (REIT) | Morgan Stanley | 23.052 | 7.206 | Adams Resources & Energy Inc | HSBC | 7.206 |
| 4.969 | Accel Entertainment Inc | Bank of America Merrill Lynch | 795 | 3.951 | Adams Resources & Energy Inc | Morgan Stanley | 9.877 |
| 41.867 | Accel Entertainment Inc | Barclays Bank | 12.979 | (3.999) | AdaptHealth Corp | Bank of America Merrill Lynch | (6.198) |
| 21.191 | Accel Entertainment Inc | Goldman Sachs | 3.391 | (20.522) | AdaptHealth Corp | Goldman Sachs | (31.809) |
| 15.519 | Accel Entertainment Inc | HSBC | 6.052 | (2.176) | AdaptHealth Corp | HSBC | (14.449) |
| 14.818 | Accel Entertainment Inc | Morgan Stanley | 4.594 | (7.370) | AdaptHealth Corp | Morgan Stanley | (3.611) |
| (2.843) | Accelerate Diagnostics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 42 | 27.190 | Adaptive Biotechnologies Corp | Bank of America Merrill Lynch | 35 |
| (25.872) | Accelerate Diagnostics Inc | Barclays Bank | (380) | 60.962 | Adaptive Biotechnologies Corp | Barclays Bank | 4.267 |
| (245) | Accelerate Diagnostics Inc | Goldman Sachs | 4 | 58.463 | Adaptive Biotechnologies Corp | Goldman Sachs | (7.069) |
| 581 | Accenture Plc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 8.134 | 42.720 | Adaptive Biotechnologies Corp | HSBC | 31.613 |
| (823) | Accenture Plc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (16.812) | 42.230 | Adaptive Biotechnologies Corp | Morgan Stanley | 2.956 |
| 1.503 | Accenture Plc 'A' | Barclays Bank | 32.017 | 1.634 | Addus HomeCare Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.127 |
| 2.617 | Accenture Plc 'A' | Goldman Sachs | 34.605 | 6.604 | Addus HomeCare Corp | Barclays Bank | (5.944) |
| 1.143 | Accenture Plc 'A' | HSBC | 13.500 | 3.323 | Addus HomeCare Corp | Goldman Sachs | 2.293 |
| 2.113 | Accenture Plc 'A' | Morgan Stanley | 35.456 | 1.010 | Addus HomeCare Corp | HSBC | 3.554 |
| 22.208 | ACCO Brands Corp | Barclays Bank | 5.552 | (6.507) | Adicet Bio Inc | Bank of America Merrill Lynch | 10.802 |
| 84.979 | ACCO Brands Corp | Goldman Sachs | 850 | (4.398) | Adicet Bio Inc | Barclays Bank | (1.935) |
| 84.545 | ACCO Brands Corp | HSBC | 17.754 | (2.881) | Adicet Bio Inc | Goldman Sachs | 4.782 |
| 10.389 | Accolade Inc | Barclays Bank | 831 | (1.941) | Adicet Bio Inc | HSBC | 2.504 |
| 11.003 | Accolade Inc | Goldman Sachs | 2.311 | (38.622) | Adient Plc | Barclays Bank | (97.714) |
| 3.604 | Accolade Inc | HSBC | 2.883 | (11.238) | Adient Plc | Goldman Sachs | (43.154) |
| 21.376 | Accuray Inc | Barclays Bank | (1.176) | (12.444) | Adient Plc | HSBC | (40.412) |
| 53.767 | Accuray Inc | Goldman Sachs | (5.108) | (6.609) | Adient Plc | Morgan Stanley | (16.875) |
| 9.542 | Accuray Inc | HSBC | 716 | 103.095 | ADMA Biologics Inc | Barclays Bank | 1.546 |
| 97.795 | Accuray Inc | Morgan Stanley | (5.379) | 77.870 | ADMA Biologics Inc | Goldman Sachs | 16.742 |
| (80.572) | AcelRx Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 2.264 | 5.933 | ADMA Biologics Inc | HSBC | 3.233 |
| (7.890) | AcelRx Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (161) | 794 | Adobe Inc | Barclays Bank | 8.178 |
| (11.355) | AcelRx Pharmaceuticals Inc | HSBC | (204) | 71 | Adobe Inc | Goldman Sachs | 1.008 |
| 75.838 | ACI Worldwide Inc | Barclays Bank | 7.584 | 383 | Adobe Inc | HSBC | 5.407 |
| 22.380 | ACI Worldwide Inc | Goldman Sachs | 19.023 | | | | |
| 5.496 | ACI Worldwide Inc | HSBC | 5.184 | | | | |
| 3.269 | ACI Worldwide Inc | Morgan Stanley | 327 | | | | |
| 1.947 | Aclaris Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.466 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.504 | Adobe Inc | Morgan Stanley | 15.491 | 20.199 | AECOM | Goldman Sachs | 55.755 |
| (3.805) | ADT Inc | Bank of America | | 7.945 | AECOM | HSBC | 38.043 |
| | | Merrill Lynch | (1.826) | 7.792 | AECOM | Morgan Stanley | 13.402 |
| 36.345 | ADT Inc | Barclays Bank | 12.357 | 8.659 | Aeglea BioTherapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.039 |
| (16.422) | ADT Inc | Barclays Bank | (5.583) | 19.844 | Aeglea BioTherapeutics Inc | Morgan Stanley | 992 |
| 29.655 | ADT Inc | Goldman Sachs | 14.234 | (1.724) | Aehr Test Systems | Bank of America | |
| (18.899) | ADT Inc | Goldman Sachs | (9.072) | | | Merrill Lynch | (724) |
| 17.080 | ADT Inc | HSBC | 12.639 | (14.935) | Aehr Test Systems | HSBC | (16.621) |
| (23.110) | ADT Inc | Morgan Stanley | (7.857) | (6.117) | Aehr Test Systems | Morgan Stanley | (2.141) |
| (12.011) | Adtalem Global Education Inc | | | (1.422) | Aemetis Inc | Bank of America | |
| (6.853) | Adtalem Global Education Inc | Barclays Bank | (5.165) | | | Merrill Lynch | (1.180) |
| | | Goldman Sachs | (11.239) | (2.425) | Aemetis Inc | Barclays Bank | (1.916) |
| (27.451) | ADTRAN Inc | Barclays Bank | (15.373) | (8.268) | Aemetis Inc | HSBC | (165) |
| (15.581) | ADTRAN Inc | Goldman Sachs | (21.034) | (7.415) | Aemetis Inc | Morgan Stanley | (5.858) |
| (9.757) | ADTRAN Inc | HSBC | (11.318) | (4.647) | AerCap Holdings NV | Morgan Stanley | (2.556) |
| 1.840 | Aduro Biotech Holdings Europe BV | | | 2.486 | Aerie Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (2.697) |
| 4.665 | Aduro Biotech Holdings Europe BV | Barclays Bank | 4.672 | 7.640 | Aerie Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (11.422) |
| 1.716 | Advance Auto Parts Inc | Morgan Stanley | 11.844 | 16.019 | Aerie Pharmaceuticals Inc | HSBC | (6.488) |
| | | Bank of America | | 3.563 | Aerovate Therapeutics Inc | Barclays Bank | 3.937 |
| 4.199 | Advance Auto Parts Inc | Merrill Lynch | (6.711) | 1.315 | Aerovate Therapeutics Inc | HSBC | 2.978 |
| 4.057 | Advance Auto Parts Inc | Barclays Bank | 31.241 | 889 | Aerovate Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 982 |
| 4.426 | Advance Auto Parts Inc | Goldman Sachs | (93.351) | (5.491) | AeroVironment Inc | Goldman Sachs | (81.267) |
| 586 | Advance Auto Parts Inc | HSBC | (52.935) | (1.271) | AerSale Corp | Bank of America | |
| (1.127) | Advanced Drainage Systems Inc | Merrill Lynch | (7.585) | | | Merrill Lynch | — |
| (20.450) | Advanced Drainage Systems Inc | | | (8.569) | AerSale Corp | Barclays Bank | 1.285 |
| (7.811) | Advanced Drainage Systems Inc | Barclays Bank | 20.859 | (1.961) | AerSale Corp | Goldman Sachs | — |
| (8.150) | Advanced Drainage Systems Inc | Goldman Sachs | (52.568) | (1.776) | AES Corp | Bank of America | |
| (10.628) | Advanced Emissions Solutions Inc | HSBC | (105.054) | | | Merrill Lynch | (2.849) |
| (5.462) | Advanced Emissions Solutions Inc | Barclays Bank | 2.126 | (31.494) | AES Corp | Barclays Bank | (34.643) |
| (15.235) | Advanced Emissions Solutions Inc | HSBC | 2.840 | 12.249 | AES Corp | Barclays Bank | 13.474 |
| (384) | Advanced Energy Industries Inc | Morgan Stanley | 3.047 | (58.440) | AES Corp | Goldman Sachs | (124.883) |
| (25.256) | Advanced Energy Industries Inc | Bank of America | (118.956) | 35.906 | AES Corp | Goldman Sachs | 77.916 |
| (17.490) | Advanced Energy Industries Inc | Merrill Lynch | (1.225) | (20.765) | AES Corp | Morgan Stanley | (22.842) |
| (4.370) | Advanced Energy Industries Inc | Barclays Bank | (22.743) | 5.708 | AES Corp | Morgan Stanley | 6.279 |
| (6.396) | Advanced Micro Devices Inc | HSBC | (43.307) | (11.522) | AEye Inc | HSBC | (12.559) |
| 6.765 | Advanced Micro Devices Inc | Barclays Bank | 48.573 | (23.595) | AEye Inc | Morgan Stanley | (15.573) |
| (2.169) | AdvanSix Inc | Goldman Sachs | (3.523) | (1.136) | Affiliated Managers Group Inc | Bank of America | |
| (7.619) | AdvanSix Inc | Barclays Bank | (1.067) | 3.144 | Affiliated Managers Group Inc | Merrill Lynch | (10.690) |
| (2.020) | AdvanSix Inc | Goldman Sachs | (2.002) | (5.244) | Affiliated Managers Group Inc | Barclays Bank | 18.109 |
| (1.449) | AdvanSix Inc | HSBC | (2.492) | 766 | Affiliated Managers Group Inc | Barclays Bank | (30.205) |
| 4.610 | Advantage Solutions Inc | Merrill Lynch | (115) | (1.438) | Affiliated Managers Group Inc | HSBC | 5.921 |
| 17.540 | Advantage Solutions Inc | Barclays Bank | (263) | (724) | Affiliated Managers Group Inc | HSBC | (11.116) |
| 8.149 | Advantage Solutions Inc | Goldman Sachs | (204) | | | Morgan Stanley | (4.170) |
| 24.889 | Advantage Solutions Inc | HSBC | (15.307) | 8.639 | Affirmed NV | Barclays Bank | (950) |
| (13.221) | Advent Technologies Holdings Inc | | | 24.812 | Affirmed NV | Goldman Sachs | (2.977) |
| (30.239) | Advent Technologies Holdings Inc | Barclays Bank | (264) | 9.086 | Affirmed NV | HSBC | 1.090 |
| (15.253) | Advent Technologies Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.931 | (3.030) | Affirm Holdings Inc | Bank of America | |
| (47.868) | Adverum Biotechnologies Inc | Morgan Stanley | (305) | (1.731) | Affirm Holdings Inc | Merrill Lynch | (20.301) |
| 26.976 | AECOM | Goldman Sachs | (3.839) | (9.117) | Affirm Holdings Inc | Barclays Bank | (8.880) |
| | | Bank of America | | (2.333) | Affirm Holdings Inc | Goldman Sachs | (59.077) |
| 6.794 | AECOM | Merrill Lynch | 80.068 | 2.010 | Aflac Inc | Morgan Stanley | (11.968) |
| | | Barclays Bank | 11.686 | | | Bank of America | |
| | | | | (57.650) | Aflac Inc | Merrill Lynch | 5.002 |
| | | | | 2.635 | Aflac Inc | Barclays Bank | (184.480) |
| | | | | (102.204) | Aflac Inc | Barclays Bank | 8.432 |
| | | | | 6.007 | Aflac Inc | Goldman Sachs | (361.802) |
| | | | | 16.879 | Aflac Inc | Goldman Sachs | 21.265 |
| | | | | 41.328 | AG Mortgage Investment Trust Inc (REIT) | HSBC | 33.696 |
| | | | | 11.758 | AG Mortgage Investment Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 13.225 |
| | | | | 11.172 | AG Mortgage Investment Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 3.175 |
| | | | | | | HSBC | 8.379 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|-----------------|---|---|----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (1.389) | AGCO Corp | Bank of America | | (9.937) | Air Lease Corp | Morgan Stanley | (8.049) |
| | | Merrill Lynch | (6.357) | (4.143) | Air Products | | |
| (2.265) | AGCO Corp | Barclays Bank | (18.800) | | & Chemicals Inc | Barclays Bank | (38.240) |
| 4.137 | AGCO Corp | Goldman Sachs | 20.106 | (6.645) | Air Products | | |
| (912) | AGCO Corp | Goldman Sachs | (4.432) | | & Chemicals Inc | Goldman Sachs | (93.624) |
| 3.705 | AGCO Corp | HSBC | 23.416 | (4.640) | Air Products | | |
| (4.703) | AGCO Corp | HSBC | (24.041) | | & Chemicals Inc | HSBC | (60.987) |
| 7.204 | AGCO Corp | Morgan Stanley | 59.793 | (1.703) | Air Products | | |
| (5.229) | AgEagle Aerial Systems Inc | Barclays Bank | 33 | | & Chemicals Inc | Morgan Stanley | (15.719) |
| (28.647) | AgEagle Aerial Systems Inc | Goldman Sachs | (2.398) | (745) | Air Transport Services | Bank of America | |
| (7.981) | AgEagle Aerial Systems Inc | Morgan Stanley | 50 | | Group Inc | Merrill Lynch | 363 |
| 33.689 | Agenus Inc | Bank of America | | (6.050) | Air Transport Services | | |
| | | Merrill Lynch | 3.874 | | Group Inc | Barclays Bank | (7.502) |
| 32.365 | Agenus Inc | Barclays Bank | 4.046 | (11.856) | Air Transport Services | | |
| 20.058 | Agenus Inc | Goldman Sachs | 2.307 | | Group Inc | Goldman Sachs | (8.916) |
| 15.371 | Agenus Inc | HSBC | 1.350 | (22.738) | Air Transport Services | | |
| 15.144 | Agilent Technologies Inc | Barclays Bank | 47.855 | | Group Inc | HSBC | (9.550) |
| 22.970 | Agilent Technologies Inc | Goldman Sachs | 201.368 | (1.290) | Air Transport Services | | |
| 18.661 | Agilent Technologies Inc | HSBC | 299.136 | | Group Inc | Morgan Stanley | (1.600) |
| (5.833) | Agiliti Inc | Bank of America | | (4.807) | Airbnb Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (5.716) | | | Merrill Lynch | (18.363) |
| (13.192) | Agiliti Inc | Barclays Bank | (6.860) | (592) | Airbnb Inc 'A' | Barclays Bank | (2.948) |
| (5.263) | Agiliti Inc | Goldman Sachs | (5.158) | (3.108) | Airbnb Inc 'A' | Goldman Sachs | (11.873) |
| (1.360) | Agiliti Inc | HSBC | (435) | (3.532) | Airbnb Inc 'A' | HSBC | (670) |
| (1.658) | agilon health Inc | Bank of America | | (1.193) | Airbnb Inc 'A' | Morgan Stanley | (5.941) |
| | | Merrill Lynch | (796) | (6.303) | Airgain Inc | Bank of America | |
| (28.367) | agilon health Inc | Barclays Bank | (13.616) | | | Merrill Lynch | 252 |
| (11.045) | agilon health Inc | Goldman Sachs | (4.531) | (4.677) | Airgain Inc | Barclays Bank | 702 |
| (4.779) | agilon health Inc | HSBC | (14.528) | (30.288) | Airgain Inc | Goldman Sachs | 1.212 |
| (932) | agilon health Inc | Morgan Stanley | (447) | 13.330 | AirSculpt Technologies Inc | Barclays Bank | 8.531 |
| (8.009) | Agilysys Inc | Barclays Bank | (13.695) | 5.191 | AirSculpt Technologies Inc | Goldman Sachs | 7.475 |
| (3.714) | Agilysys Inc | Goldman Sachs | (16.416) | 1.290 | AirSculpt Technologies Inc | Morgan Stanley | 826 |
| (1.359) | Agilysys Inc | HSBC | (9.472) | 9.393 | aka Brands Holding Corp | HSBC | 3.851 |
| (12.916) | Agilysys Inc | Morgan Stanley | (22.086) | 11.588 | aka Brands Holding Corp | Morgan Stanley | 4.751 |
| 2.604 | Agios Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | (374) | Akamai Technologies Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (6.276) | | | Merrill Lynch | 41 |
| 2.510 | Agios Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 149 | (3.657) | Akamai Technologies Inc | Barclays Bank | (6.034) |
| 10.984 | Agios Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (22.057) | (10.038) | Akamai Technologies Inc | Goldman Sachs | (18.028) |
| 9.999 | Agios Pharmaceuticals Inc | HSBC | (6.143) | (4.769) | Akamai Technologies Inc | HSBC | (11.226) |
| 3.295 | Agios Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (4.481) | (7.379) | Akamai Technologies Inc | Morgan Stanley | (12.175) |
| (41.204) | AGNC Investment Corp (REIT) | Bank of America | | 4.700 | Akazoo SA' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (684) | | | Merrill Lynch | (5.452) |
| (139.287) | AGNC Investment Corp (REIT) | Barclays Bank | (37.608) | 5.417 | Akazoo SA' | Barclays Bank | (6.284) |
| (136.050) | AGNC Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 2.721 | 11.200 | Akazoo SA' | Goldman Sachs | (12.992) |
| (69.691) | AGNC Investment Corp (REIT) | HSBC | (697) | 7.099 | Akazoo SA' | Morgan Stanley | (71) |
| (7.865) | AGNC Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (2.124) | 807 | Akero Therapeutics Inc | Bank of America | |
| (7.689) | Agree Realty Corp (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (428) |
| | | Merrill Lynch | (6) | 5.993 | Akero Therapeutics Inc | Barclays Bank | 1.618 |
| 1.085 | Agree Realty Corp (REIT) | Bank of America | | 9.378 | Akero Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (2.384) |
| | | Merrill Lynch | 873 | 10.805 | Akero Therapeutics Inc | HSBC | (13.722) |
| (38.012) | Agree Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | (5.522) | 5.927 | Akero Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 2.178 |
| 16.448 | Agree Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | 4.441 | 5.236 | Akouos Inc | Bank of America | |
| (2.457) | Agree Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | (1.042) | | | Merrill Lynch | (2.147) |
| (14.798) | Agree Realty Corp (REIT) | HSBC | (4.324) | 12.743 | Akouos Inc | Barclays Bank | (382) |
| 38.798 | Agree Realty Corp (REIT) | HSBC | 68.147 | 5.559 | Akouos Inc | HSBC | (56) |
| (8.702) | Agree Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | 79 | 1.501 | Akouos Inc | Morgan Stanley | (45) |
| 17.625 | AgroFresh Solutions Inc | Bank of America | | (18.182) | Akoustis Technologies Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.996 | | | Merrill Lynch | (6.546) |
| 13.542 | AgroFresh Solutions Inc | Barclays Bank | (677) | (70.854) | Akoustis Technologies Inc | Barclays Bank | (41.804) |
| 15.968 | AgroFresh Solutions Inc | Goldman Sachs | 2.715 | (4.969) | Akoustis Technologies Inc | HSBC | (1.391) |
| 27.665 | AgroFresh Solutions Inc | Morgan Stanley | (1.383) | (9.494) | Akoustis Technologies Inc | Morgan Stanley | (5.601) |
| (7.509) | Air Lease Corp | Bank of America | | 5.762 | Akoya Biosciences Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (12.248) | | | Merrill Lynch | 13.656 |
| (1.448) | Air Lease Corp | Barclays Bank | (1.173) | 5.860 | Akoya Biosciences Inc | Barclays Bank | 5.508 |
| (29.897) | Air Lease Corp | Goldman Sachs | (50.227) | 7.363 | Akoya Biosciences Inc | Goldman Sachs | 17.450 |
| (674) | Air Lease Corp | HSBC | (1.534) | 7.034 | Akoya Biosciences Inc | Morgan Stanley | 6.612 |
| | | | | (3.453) | Alamo Group Inc | Barclays Bank | (14.844) |
| | | | | (6.110) | Alamo Group Inc | Goldman Sachs | (20.215) |
| | | | | (118) | Alamo Group Inc | HSBC | (214) |
| | | | | (434) | Alamo Group Inc | Morgan Stanley | (1.669) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 5.913 | Alarm.com Holdings Inc | Barclays Bank | 10.525 | 16.217 | Alexandria Real Estate | | |
| 10.216 | Alarm.com Holdings Inc | Goldman Sachs | 67.732 | | Equities Inc (REIT) | Goldman Sachs | 31.584 |
| 6.879 | Alarm.com Holdings Inc | HSBC | 54.550 | 5.980 | Alexandria Real Estate | | |
| 26.863 | Alaska Air Group Inc | Bank of America | | | Equities Inc (REIT) | HSBC | (629) |
| | | Merrill Lynch | 47.796 | 3.319 | Alexandria Real Estate | | |
| 15.178 | Alaska Air Group Inc | Barclays Bank | 15.785 | | Equities Inc (REIT) | Morgan Stanley | 19.914 |
| (11.624) | Alaska Air Group Inc | Barclays Bank | (12.089) | 1.835 | Alico Inc | Bank of America | |
| 26.242 | Alaska Air Group Inc | Goldman Sachs | 46.281 | | Merrill Lynch | | 514 |
| (12.855) | Alaska Air Group Inc | Goldman Sachs | (24.425) | 5.732 | Alico Inc | Barclays Bank | 2.809 |
| 210 | Alaska Air Group Inc | HSBC | 16 | 14.348 | Alico Inc | Goldman Sachs | 4.017 |
| (9.111) | Alaska Air Group Inc | HSBC | (2.096) | 8.371 | Alico Inc | HSBC | 27.624 |
| 2.658 | Alaska Air Group Inc | Morgan Stanley | 2.764 | (46.897) | Alight Inc 'A' | Barclays Bank | (8.910) |
| (216.181) | Alaunos Therapeutics Inc | Barclays Bank | (9.771) | (106.336) | Alight Inc 'A' | Goldman Sachs | 27.648 |
| (7.158) | Albany International Corp 'A' | Bank of America | | 3 | Align Technology Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (20.202) | | Merrill Lynch | | 11 |
| (9.287) | Albany International Corp 'A' | Barclays Bank | (17.181) | (1.018) | Align Technology Inc | Barclays Bank | 1.028 |
| (3.221) | Albany International Corp 'A' | Goldman Sachs | (9.019) | 1.351 | Align Technology Inc | Goldman Sachs | 4.729 |
| (2.302) | Albany International Corp 'A' | HSBC | (10.709) | (172) | Align Technology Inc | Goldman Sachs | (1.165) |
| (2.432) | Albany International Corp 'A' | Morgan Stanley | (4.499) | 1.866 | Align Technology Inc | HSBC | 16.309 |
| (4.649) | Albemarle Corp | Barclays Bank | (78.243) | 507 | Align Technology Inc | Morgan Stanley | (512) |
| (1.476) | Albemarle Corp | Goldman Sachs | (49.372) | (968) | Align Technology Inc | Morgan Stanley | 978 |
| 5.786 | Albertsons Cos Inc | Bank of America | | 4.269 | Alignment Healthcare Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 6.317 | | Merrill Lynch | | 7.684 |
| 11.545 | Albertsons Cos Inc | Barclays Bank | 23.436 | 21.985 | Alignment Healthcare Inc | Barclays Bank | 9.673 |
| 19.421 | Albertsons Cos Inc | Goldman Sachs | 7.963 | 7.229 | Alignment Healthcare Inc | Goldman Sachs | 13.012 |
| 1.610 | Albertsons Cos Inc | Morgan Stanley | 3.268 | 4.797 | Alignment Healthcare Inc | Morgan Stanley | 2.111 |
| (996) | Albireo Pharma Inc | Barclays Bank | 1.325 | 3.141 | Aligos Therapeutics Inc | Bank of America | |
| (6.425) | Albireo Pharma Inc | Goldman Sachs | 41.177 | | Merrill Lynch | | 471 |
| (4.690) | Albireo Pharma Inc | HSBC | 43.289 | 2.933 | Aligos Therapeutics Inc | Barclays Bank | 205 |
| (2.246) | Alcoa Corp | Bank of America | | 1.408 | Aligos Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 211 |
| | | Merrill Lynch | (4.590) | 1.489 | Aligos Therapeutics Inc | HSBC | 208 |
| (6.537) | Alcoa Corp | Goldman Sachs | (14.764) | 7.717 | Aligos Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 540 |
| (2.986) | Alcoa Corp | Morgan Stanley | (4.509) | (13.477) | Alkami Technology Inc | Barclays Bank | (26.145) |
| (5.444) | Aldeyra Therapeutics Inc | Bank of America | | (1.770) | Alkami Technology Inc | Goldman Sachs | (1.649) |
| | | Merrill Lynch | (2.994) | 2.494 | Alkermes Plc | Bank of America | |
| (30.075) | Aldeyra Therapeutics Inc | Barclays Bank | (6.617) | | Merrill Lynch | | 3.417 |
| (25.214) | Aldeyra Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (13.868) | (13.745) | Alkermes Plc | Barclays Bank | (13.745) |
| (6.996) | Aldeyra Therapeutics Inc | HSBC | (4.058) | 17.219 | Alkermes Plc | Barclays Bank | 17.219 |
| 16.589 | Alector Inc | Bank of America | | 23.067 | Allakos Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 6.347 | | Merrill Lynch | | (7.381) |
| 12.867 | Alector Inc | Barclays Bank | (2.316) | 10.573 | Allakos Inc | Barclays Bank | (529) |
| 12.126 | Alector Inc | Goldman Sachs | 5.214 | 23.174 | Allakos Inc | Goldman Sachs | (7.416) |
| 4.389 | Alector Inc | HSBC | 4.916 | 55.813 | Allakos Inc | HSBC | (18.697) |
| 3.137 | Alector Inc | Morgan Stanley | (565) | 37.213 | Allakos Inc | Morgan Stanley | (1.861) |
| 18.311 | Alerus Financial Corp | Barclays Bank | (6.592) | 7.128 | Allbirds Inc | Bank of America | |
| 15.325 | Alerus Financial Corp | Goldman Sachs | 9.808 | | Merrill Lynch | | 3.555 |
| 24.447 | Alerus Financial Corp | HSBC | (16.379) | 36.478 | Allbirds Inc | Barclays Bank | 22.870 |
| 15.657 | Alerus Financial Corp | Morgan Stanley | (5.637) | 15.205 | Allbirds Inc | Goldman Sachs | 12.012 |
| 8.122 | Alexander & Baldwin Inc (REIT) | Bank of America | | 11.859 | Allbirds Inc | Morgan Stanley | 7.590 |
| | | Merrill Lynch | (5.442) | 4.553 | Allegheny Technologies Inc | Barclays Bank | 4.325 |
| 41.930 | Alexander & Baldwin Inc (REIT) | Barclays Bank | 1.766 | 4.946 | Allegheny Technologies Inc | HSBC | 7.518 |
| 31.541 | Alexander & Baldwin Inc (REIT) | Goldman Sachs | (20.565) | 1.463 | Allegheny Technologies Inc | Morgan Stanley | 1.390 |
| 12.920 | Alexander & Baldwin Inc (REIT) | HSBC | (6.041) | (3.547) | Allegiance Bancshares Inc | Bank of America | |
| 14.008 | Alexander & Baldwin Inc (REIT) | Morgan Stanley | 700 | | Merrill Lynch | | (3.607) |
| (2.550) | Alexander's Inc (REIT) | Bank of America | | (3.272) | Allegiance Bancshares Inc | Barclays Bank | (3.108) |
| | | Merrill Lynch | (27.489) | (7.054) | Allegiance Bancshares Inc | Goldman Sachs | (8.656) |
| (6.906) | Alexander's Inc (REIT) | Barclays Bank | (82.734) | (1.784) | Allegiance Bancshares Inc | HSBC | 990 |
| (5.334) | Alexander's Inc (REIT) | Goldman Sachs | (57.501) | (2.165) | Allegiance Bancshares Inc | Morgan Stanley | (2.057) |
| (2.048) | Alexander's Inc (REIT) | HSBC | (14.973) | (519) | Allegiant Travel Co | Bank of America | |
| (3.280) | Alexander's Inc (REIT) | Morgan Stanley | (39.294) | | Merrill Lynch | | (2.714) |
| 2.156 | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | Barclays Bank | 12.936 | (4.183) | Allegiant Travel Co | Barclays Bank | (20.037) |
| | | | | (14.750) | Allegiant Travel Co | Goldman Sachs | (77.143) |
| | | | | (9.792) | Allegiant Travel Co | HSBC | (53.857) |
| | | | | (778) | Allegion Plc | Bank of America | |
| | | | | | Merrill Lynch | | (2.469) |
| | | | | 1.246 | Allegion Plc | Barclays Bank | 3.551 |
| | | | | (1.439) | Allegion Plc | Barclays Bank | (4.101) |
| | | | | 10.281 | Allegion Plc | Goldman Sachs | 3.041 |
| | | | | (3.113) | Allegion Plc | Goldman Sachs | (2.026) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------|---|-----------------|---|----------|---|-----------------|---|
| | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | |
| 81 | Allegion Plc | HSBC | 24 | (10.054) | Alpha & Omega | | |
| (6.722) | Allegion Plc | HSBC | 14.257 | | Semiconductor Ltd | HSBC | (98.062) |
| 3.121 | Allegion Plc | Morgan Stanley | 8.895 | (1.408) | Alpha Metallurgical | | |
| (4.602) | Allegion Plc | Morgan Stanley | (13.116) | | Resources Inc | Morgan Stanley | (6.547) |
| 7.006 | Allegro MicroSystems Inc | Bank of America | | (17.768) | Alpha Pro Tech Ltd | Barclays Bank | 3.198 |
| | | Merrill Lynch | 9.673 | 893 | Alpha Teknova Inc | HSBC | (1.018) |
| 29.004 | Allegro MicroSystems Inc | Barclays Bank | 25.524 | 136 | Alphabet Inc 'A' | Bank of America | |
| 18.972 | Allegro MicroSystems Inc | Goldman Sachs | 30.355 | | Merrill Lynch | | 1.110 |
| 2.969 | Allegro MicroSystems Inc | HSBC | 3.369 | 751 | Alphabet Inc 'A' | Goldman Sachs | (11.083) |
| 17.927 | Allegro MicroSystems Inc | Morgan Stanley | 15.776 | 203 | Alphabet Inc 'A' | HSBC | 15.588 |
| (10.426) | ALLETE Inc | Bank of America | | 219 | Alphabet Inc 'A' | Morgan Stanley | 4.461 |
| | | Merrill Lynch | (5.654) | (18.542) | Alphatec Holdings Inc | Bank of America | |
| (20.820) | ALLETE Inc | Barclays Bank | (14.566) | | Merrill Lynch | | 3.152 |
| (2.382) | ALLETE Inc | Goldman Sachs | (477) | (15.528) | Alphatec Holdings Inc | Barclays Bank | (3.261) |
| (1.666) | ALLETE Inc | Morgan Stanley | (823) | (23.645) | Alphatec Holdings Inc | Goldman Sachs | 4.020 |
| 23.201 | Alliant Energy Corp | Barclays Bank | 86.772 | (11.792) | Alphatec Holdings Inc | HSBC | 3.508 |
| (26.762) | Alliant Energy Corp | Barclays Bank | (100.090) | (868) | Alpine Immune Sciences Inc | Bank of America | |
| 38.118 | Alliant Energy Corp | Goldman Sachs | 147.898 | | Merrill Lynch | | (1.207) |
| (6.652) | Alliant Energy Corp | Goldman Sachs | (25.810) | (7.503) | Alpine Immune Sciences Inc | Barclays Bank | (7.353) |
| 28.054 | Alliant Energy Corp | HSBC | 112.821 | 8.994 | Alta Equipment Group Inc | Bank of America | |
| 14.316 | Alliant Energy Corp | Morgan Stanley | 47.412 | | Merrill Lynch | | 630 |
| 11.123 | Allied Motion | | | 9.005 | Alta Equipment Group Inc | Barclays Bank | 360 |
| | Technologies Inc | Barclays Bank | 21.579 | 11.958 | Alta Equipment Group Inc | Goldman Sachs | 837 |
| 2.524 | Allied Motion | | | 3.934 | Alta Equipment Group Inc | HSBC | (3.332) |
| | Technologies Inc | Goldman Sachs | 1.540 | 10.045 | Alta Equipment Group Inc | Morgan Stanley | 402 |
| 7.388 | Allied Motion | | | 1.840 | Altair Engineering Inc 'A' | Bank of America | |
| | Technologies Inc | Morgan Stanley | 14.333 | | Merrill Lynch | | 3.717 |
| 36.929 | Allison Transmission | | | 14.874 | Altair Engineering Inc 'A' | Barclays Bank | 29.302 |
| | Holdings Inc | Barclays Bank | 49.485 | 7.788 | Altair Engineering Inc 'A' | Goldman Sachs | 15.732 |
| 28.064 | Allison Transmission | | | 1.418 | Altair Engineering Inc 'A' | HSBC | 6.650 |
| | Holdings Inc | Goldman Sachs | 34.484 | 1.307 | Altair Engineering Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.575 |
| 12.893 | Allison Transmission | | | (3.405) | Alteryx Inc 'A' | Bank of America | |
| | Holdings Inc | HSBC | 9.752 | | Merrill Lynch | | (2.656) |
| 28.975 | Allogene Therapeutics Inc | Barclays Bank | 14.343 | (6.263) | Alteryx Inc 'A' | Barclays Bank | (7.014) |
| 16.869 | Allogene Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 14.760 | (7.357) | Alteryx Inc 'A' | Goldman Sachs | (5.738) |
| 11.355 | Allogene Therapeutics Inc | HSBC | 7.097 | (4.357) | Alteryx Inc 'A' | HSBC | 2.745 |
| 13.069 | Allovir Inc | Bank of America | | (14.775) | Alteryx Inc 'A' | Morgan Stanley | (16.548) |
| | | Merrill Lynch | (9.410) | 139.939 | Altice USA Inc 'A' | Barclays Bank | 113.351 |
| 19.860 | Allovir Inc | Barclays Bank | (7.547) | (1.002) | Altimmune Inc | Bank of America | |
| 8.348 | Allovir Inc | Goldman Sachs | (6.011) | | Merrill Lynch | | (230) |
| 14.744 | Allovir Inc | HSBC | (7.077) | (30.152) | Altimmune Inc | Barclays Bank | (5.729) |
| 54.608 | Allscripts Healthcare | | | (12.452) | Altimmune Inc | Goldman Sachs | (2.864) |
| | Solutions Inc | Barclays Bank | 8.191 | 11.733 | Altisource Portfolio | | |
| 23.810 | Allstate Corp | Goldman Sachs | 183.337 | | Solutions SA | Goldman Sachs | 11.264 |
| (4.620) | Allstate Corp | Goldman Sachs | (35.574) | 16.929 | Alto Ingredients Inc | Bank of America | |
| 6.615 | Allstate Corp | HSBC | 41.399 | | Merrill Lynch | | (4.232) |
| (4.582) | Allstate Corp | HSBC | (30.978) | 14.571 | Alto Ingredients Inc | Barclays Bank | 1.603 |
| 2.907 | Allstate Corp | Morgan Stanley | 27.006 | 6.117 | Alto Ingredients Inc | Goldman Sachs | (1.529) |
| (40) | Allstate Corp | Morgan Stanley | (372) | 25.853 | Alto Ingredients Inc | HSBC | (9.307) |
| 7.292 | Ally Financial Inc | Barclays Bank | 20.928 | 6.186 | Altra Industrial Motion Corp | Bank of America | |
| (5.383) | Ally Financial Inc | Barclays Bank | (15.449) | | Merrill Lynch | | 8.784 |
| 30.990 | Ally Financial Inc | Goldman Sachs | 140.385 | 18.112 | Altra Industrial Motion Corp | Barclays Bank | 47.635 |
| (20.299) | Ally Financial Inc | Goldman Sachs | (91.954) | 9.327 | Altra Industrial Motion Corp | Goldman Sachs | 13.866 |
| 19.403 | Ally Financial Inc | HSBC | 51.612 | 6.145 | Altra Industrial Motion Corp | HSBC | 5.162 |
| (82) | Ally Financial Inc | HSBC | (180) | 1.410 | Altra Industrial Motion Corp | Morgan Stanley | 3.708 |
| (341) | Alnylam Pharmaceuticals | Bank of America | | 7.387 | Altria Group Inc | Barclays Bank | 12.041 |
| | Inc | Merrill Lynch | 286 | (12.087) | Altria Group Inc | Goldman Sachs | (121) |
| (3.034) | Alnylam Pharmaceuticals | | | 6.589 | Altria Group Inc | HSBC | 4.830 |
| | Inc | Barclays Bank | 16.839 | 18.329 | Altria Group Inc | Morgan Stanley | 29.876 |
| (1.818) | Alnylam Pharmaceuticals | | | 1.946 | Altus Midstream Co 'A' | Barclays Bank | 10.294 |
| | Inc | Goldman Sachs | 2.500 | 1.935 | Altus Midstream Co 'A' | Goldman Sachs | 18.886 |
| (294) | Alnylam Pharmaceuticals | | | 1.261 | Altus Midstream Co 'A' | HSBC | 25.220 |
| | Inc | HSBC | (444) | 54.501 | Altus Power Inc | Barclays Bank | 14.170 |
| (591) | Alnylam Pharmaceuticals | | | 4.050 | Altus Power Inc | Goldman Sachs | 7.007 |
| | Inc | Morgan Stanley | 3.280 | 2.822 | Altus Power Inc | HSBC | 5.898 |
| (4.750) | Alpha & Omega | | | (3.540) | ALX Oncology Holdings Inc | Barclays Bank | 2.797 |
| | Semiconductor Ltd | Barclays Bank | (25.603) | (1.564) | ALX Oncology Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.987 |
| (6.816) | Alpha & Omega | | | (5.168) | ALX Oncology Holdings Inc | HSBC | 6.723 |
| | Semiconductor Ltd | Goldman Sachs | (44.100) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (33.825) | Amalgamated Financial Corp | Barclays Bank | (9.809) | 27.079 | American Assets Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 36.827 |
| (1.747) | Amalgamated Financial Corp | Goldman Sachs | (1.467) | 11.759 | American Assets Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 9.407 |
| (577) | Amalgamated Financial Corp | Morgan Stanley | (167) | 36.339 | American Assets Trust Inc (REIT) | HSBC | 17.079 |
| (816) | A-Mark Precious Metals Inc | Barclays Bank | (6.740) | 38.632 | American Assets Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 52.540 |
| (4.364) | A-Mark Precious Metals Inc | Goldman Sachs | (62.814) | (3.203) | American Axle & Manufacturing Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.045) |
| (1.214) | A-Mark Precious Metals Inc | Morgan Stanley | (10.028) | (17.502) | American Axle & Manufacturing Holdings Inc | HSBC | (21.352) |
| (224) | Amazon.com Inc | Barclays Bank | (41.438) | (20.966) | American Axle & Manufacturing Holdings Inc | Morgan Stanley | (14.467) |
| (1.166) | Amazon.com Inc | Goldman Sachs | (222.626) | 67.410 | American Eagle Outfitters Inc | Bank of America Merrill Lynch | (152.010) |
| (184) | Amazon.com Inc | HSBC | (27.883) | 47.180 | American Eagle Outfitters Inc | Barclays Bank | (50.718) |
| (57) | Amazon.com Inc | Morgan Stanley | (10.544) | 63.565 | American Eagle Outfitters Inc | Goldman Sachs | (143.339) |
| (9.211) | Ambac Financial Group Inc | Barclays Bank | (6.632) | 51.297 | American Eagle Outfitters Inc | HSBC | (110.374) |
| (3.779) | Ambac Financial Group Inc | Morgan Stanley | (2.721) | 19.248 | American Eagle Outfitters Inc | Morgan Stanley | (20.691) |
| 100 | Ambarella Inc | Bank of America Merrill Lynch | 942 | (42.046) | American Electric Power Co Inc | Barclays Bank | (63.069) |
| 2.581 | Ambarella Inc | Barclays Bank | 21.990 | (15.974) | American Electric Power Co Inc | Goldman Sachs | (38.019) |
| 4.173 | Ambarella Inc | Goldman Sachs | 39.309 | (31.764) | American Electric Power Co Inc | HSBC | (66.070) |
| 4.411 | Ambarella Inc | HSBC | 75.737 | (9.654) | American Electric Power Co Inc | Morgan Stanley | (14.481) |
| 1.445 | Ambarella Inc | Morgan Stanley | 12.311 | (2.250) | American Equity Investment Life Holding Co | Bank of America Merrill Lynch | (11.318) |
| (14.502) | AMC Entertainment Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (41.041) | (32.629) | American Equity Investment Life Holding Co | Barclays Bank | (53.838) |
| 24.416 | AMC Entertainment Holdings Inc 'A' | HSBC | 78.800 | (18.448) | American Equity Investment Life Holding Co | Goldman Sachs | (92.793) |
| 5.090 | AMC Networks Inc 'A' | Goldman Sachs | 16.110 | (8.369) | American Equity Investment Life Holding Co | HSBC | (44.774) |
| 5.154 | AMC Networks Inc 'A' | HSBC | 39.248 | (2.899) | American Equity Investment Life Holding Co | Morgan Stanley | (4.783) |
| (23.212) | Ancor Plc | Barclays Bank | (1.161) | 6.009 | American Express Co | Barclays Bank | 61.472 |
| 84.773 | Ancor Plc | Goldman Sachs | 13.564 | 13.664 | American Express Co | Goldman Sachs | 175.446 |
| (108.312) | Ancor Plc | Goldman Sachs | (12.755) | 2.829 | American Express Co | HSBC | 23.339 |
| 17.439 | Ancor Plc | HSBC | 8.545 | 4.067 | American Express Co | Morgan Stanley | 41.605 |
| (23.171) | Ancor Plc | HSBC | (12.753) | 4.386 | American Finance Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 2.719 |
| (4.729) | Amdocs Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (4.448) | 70.255 | American Finance Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 20.374 |
| (10.574) | Amdocs Ltd | Barclays Bank | (12.251) | 40.436 | American Finance Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 25.070 |
| (9.072) | Amdocs Ltd | Goldman Sachs | (19.006) | 11.097 | American Finance Trust Inc (REIT) | HSBC | 8.878 |
| (6.172) | Amdocs Ltd | HSBC | (38.646) | (306) | American Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.282 |
| (3.830) | Amdocs Ltd | Morgan Stanley | (3.923) | (2.325) | American Financial Group Inc | Barclays Bank | (11.741) |
| 363 | Amedisys Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.334) | (800) | American Financial Group Inc | Goldman Sachs | 3.511 |
| (903) | Amedisys Inc | Barclays Bank | 6.809 | (8.997) | American Financial Group Inc | HSBC | 25.370 |
| 259 | Amedisys Inc | Barclays Bank | (1.953) | (3.127) | American Financial Group Inc | Morgan Stanley | (14.112) |
| (4.272) | Amedisys Inc | HSBC | (854) | 96.808 | American Homes 4 Rent 'A' (REIT) | Barclays Bank | 64.861 |
| 977 | Amedisys Inc | HSBC | (6.692) | 55.550 | American Homes 4 Rent 'A' (REIT) | Goldman Sachs | 29.997 |
| 1.954 | Amedisys Inc | Morgan Stanley | (14.733) | (17.429) | American Homes 4 Rent 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (9.412) |
| (22.188) | Amerant Bancorp Inc | Barclays Bank | (17.085) | | | | |
| (14.740) | Amerant Bancorp Inc | Goldman Sachs | (7.135) | | | | |
| (12.429) | Amerant Bancorp Inc | HSBC | (13.608) | | | | |
| (3.431) | AMERCO | Barclays Bank | 76.854 | | | | |
| (3.851) | AMERCO | Goldman Sachs | 112.796 | | | | |
| (3.930) | AMERCO | HSBC | 143.681 | | | | |
| (319) | AMERCO | Morgan Stanley | 7.146 | | | | |
| 6.067 | Ameren Corp | Bank of America Merrill Lynch | 12.801 | | | | |
| 12.966 | Ameren Corp | Barclays Bank | 24.117 | | | | |
| 39.310 | Ameren Corp | Goldman Sachs | 86.756 | | | | |
| 7.409 | Ameren Corp | HSBC | 11.596 | | | | |
| 58.480 | Ameren Corp | Morgan Stanley | 94.203 | | | | |
| 1.814 | Ameresco Inc 'A' | Barclays Bank | 10.485 | | | | |
| 3.689 | Ameresco Inc 'A' | Goldman Sachs | 42.239 | | | | |
| (23.053) | America First Multifamily Investors LP | Goldman Sachs | (20.131) | | | | |
| 2.413 | American Airlines Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.652 | | | | |
| 106.584 | American Airlines Group Inc | Barclays Bank | 107.223 | | | | |
| 29.480 | American Airlines Group Inc | Goldman Sachs | 36.555 | | | | |
| 60.357 | American Airlines Group Inc | HSBC | 88.724 | | | | |
| 64.691 | American Airlines Group Inc | Morgan Stanley | 67.279 | | | | |
| 10.789 | American Assets Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 8.631 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 13.152 | American Homes 4 Rent 'A' (REIT) | HSBC | 27.225 | 34.868 | American Well Corp 'A' | Morgan Stanley | 17.957 |
| 1.610 | American Homes 4 Rent 'A' (REIT) | Morgan Stanley | 1.079 | (5.591) | American Woodmark Corp | Barclays Bank | (16.382) |
| (14.878) | American International Group Inc | Bank of America | | (16.672) | American Woodmark Corp | Goldman Sachs | (62.187) |
| (48.540) | American International Group Inc | Merrill Lynch | 1.041 | (2.878) | American Woodmark Corp | HSBC | (10.390) |
| (38.797) | American International Group Inc | Barclays Bank | (80.701) | (1.363) | America's Car-Mart Inc | Bank of America | |
| (4.985) | American International Group Inc | Goldman Sachs | 2.715 | (3.633) | America's Car-Mart Inc | Merrill Lynch | (39.036) |
| (10.396) | American International Group Inc | HSBC | 382 | (2.362) | America's Car-Mart Inc | Barclays Bank | (117.387) |
| 2.168 | American National Bankshares Inc | Morgan Stanley | (17.049) | (1.341) | America's Car-Mart Inc | Goldman Sachs | (69.040) |
| 1.779 | American National Bankshares Inc | Bank of America | 2.558 | (360) | America's Car-Mart Inc | HSBC | (37.969) |
| 1.779 | American National Bankshares Inc | Merrill Lynch | 2.558 | (51.255) | Americold Realty Trust Inc | Morgan Stanley | (12.229) |
| 7.358 | American National Bankshares Inc | Barclays Bank | 1.245 | (86.589) | Americold Realty Trust Inc | Barclays Bank | (115.836) |
| 906 | American National Bankshares Inc | Goldman Sachs | 8.682 | (67.805) | Americold Realty Trust Inc | Goldman Sachs | (140.921) |
| (6.099) | American Outdoor Brands Inc | HSBC | 308 | 1.955 | Ameriprise Financial Inc | HSBC | (147.565) |
| (6.459) | American Public Education Inc | Morgan Stanley | (17.049) | 1.955 | Ameriprise Financial Inc | Bank of America | |
| (20.108) | American Public Education Inc | Bank of America | (12.668) | 1.513 | Ameriprise Financial Inc | Merrill Lynch | 25.483 |
| (4.830) | American Public Education Inc | Merrill Lynch | 19.127 | 6.674 | Ameriprise Financial Inc | Barclays Bank | 19.412 |
| (2.026) | American Realty Investors Inc | Barclays Bank | 912 | 4.056 | Ameriprise Financial Inc | Goldman Sachs | 102.179 |
| (38.523) | American Software Inc 'A' | HSBC | (19.647) | 4.498 | Ameriprise Financial Inc | HSBC | 67.425 |
| (20.249) | American Software Inc 'A' | Goldman Sachs | (25.716) | (6.303) | Ameris Bancorp | Morgan Stanley | 57.710 |
| (3.228) | American States Water Co | Bank of America | (2.356) | (8.803) | Ameris Bancorp | Bank of America | |
| (6.500) | American States Water Co | Merrill Lynch | 4.355 | (5.584) | Ameris Bancorp | Merrill Lynch | (11.426) |
| (15.891) | American States Water Co | Barclays Bank | (11.600) | (8.496) | Ameris Bancorp | Barclays Bank | (15.053) |
| (14.443) | American States Water Co | Goldman Sachs | (30.186) | (3.877) | AMERISAFE Inc | Goldman Sachs | (8.386) |
| (9.544) | American Superconductor Corp | HSBC | (2.004) | (19.985) | AMERISAFE Inc | HSBC | (19.576) |
| 1.616 | American Tower Corp (REIT) | Morgan Stanley | (2.004) | (5.040) | AMERISAFE Inc | Morgan Stanley | (6.630) |
| 11.767 | American Tower Corp (REIT) | Barclays Bank | 13.542 | (3.708) | AMERISAFE Inc | Barclays Bank | (29.578) |
| 1.556 | American Tower Corp (REIT) | HSBC | 38.714 | 7.142 | AmerisourceBergen Corp | Goldman Sachs | (9.576) |
| 1.756 | American Tower Corp (REIT) | Bank of America | 14.715 | 20.821 | AmerisourceBergen Corp | HSBC | (4.264) |
| 5.851 | American Vanguard Corp | Merrill Lynch | 15.004 | 21.988 | AmerisourceBergen Corp | Merrill Lynch | 1.499 |
| 6.147 | American Vanguard Corp | Barclays Bank | 9.341 | 5.292 | AmerisourceBergen Corp | Barclays Bank | 36.645 |
| 17.188 | American Vanguard Corp | Goldman Sachs | 47.783 | 17.844 | Ames National Corp | Goldman Sachs | 8.682 |
| 7.266 | American Vanguard Corp | HSBC | 25.109 | (7.958) | Ames National Corp | HSBC | (15.135) |
| 2.186 | American Vanguard Corp | Morgan Stanley | 3.235 | (12.370) | Ames National Corp | Merrill Lynch | 3.342 |
| 19.593 | American Water Works Co Inc | Bank of America | 60.814 | (17.733) | Ames National Corp | Barclays Bank | 3.093 |
| 3.474 | American Water Works Co Inc | Merrill Lynch | 60.814 | (635) | Ames National Corp | Goldman Sachs | 7.448 |
| 18.913 | American Water Works Co Inc | Barclays Bank | 2.536 | (4.150) | AMETEK Inc | HSBC | 445 |
| 5.272 | American Water Works Co Inc | HSBC | 17.398 | 13.416 | AMETEK Inc | Morgan Stanley | 1.038 |
| 5.453 | American Water Works Co Inc | Goldman Sachs | 3.981 | 22.349 | AMETEK Inc | Barclays Bank | 14.109 |
| 49.562 | American Well Corp 'A' | Barclays Bank | 30.481 | 22.137 | AMETEK Inc | Goldman Sachs | 1.988 |
| 61.204 | American Well Corp 'A' | HSBC | 31.520 | 6.432 | AMETEK Inc | HSBC | (38.961) |
| 41.552 | American Well Corp 'A' | Morgan Stanley | 25.554 | 11.792 | Amgen Inc | Morgan Stanley | 6.046 |
| 30.791 | American Well Corp 'A' | Barclays Bank | 30.021 | (385) | Amgen Inc | Goldman Sachs | 87.968 |
| | | Goldman Sachs | | (295) | Amgen Inc | HSBC | (2.872) |
| | | HSBC | | (407) | Amgen Inc | HSBC | (3.567) |
| | | | | (21.893) | Amicus Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (932) |
| | | | | (12.195) | Amicus Therapeutics Inc | Barclays Bank | 2.299 |
| | | | | (12.400) | Amicus Therapeutics Inc | HSBC | (14.903) |
| | | | | 5.978 | Amkor Technology Inc | Morgan Stanley | 1.302 |
| | | | | 17.049 | Amkor Technology Inc | Bank of America | |
| | | | | (1.613) | Amkor Technology Inc | Merrill Lynch | 7.668 |
| | | | | 36.039 | Amkor Technology Inc | Barclays Bank | 18.072 |
| | | | | (9.642) | Amkor Technology Inc | Barclays Bank | (1.710) |
| | | | | 26.254 | Amkor Technology Inc | Goldman Sachs | 38.372 |
| | | | | 8.217 | Amkor Technology Inc | Goldman Sachs | (7.166) |
| | | | | (2.681) | Amkor Technology Inc | HSBC | 42.489 |
| | | | | (52.634) | AMMO Inc | Morgan Stanley | 8.710 |
| | | | | (59.140) | AMMO Inc | Morgan Stanley | (2.842) |
| | | | | (52.952) | AMMO Inc | Bank of America | |
| | | | | 2.726 | AMN Healthcare Services Inc | Merrill Lynch | (32.107) |
| | | | | 18.154 | AMN Healthcare Services Inc | Barclays Bank | (27.796) |
| | | | | | AMN Healthcare Services Inc | Morgan Stanley | (24.887) |
| | | | | | AMN Healthcare Services Inc | Barclays Bank | 87.502 |
| | | | | | AMN Healthcare Services Inc | Merrill Lynch | 7.818 |
| | | | | | AMN Healthcare Services Inc | Barclays Bank | 87.502 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------|---|-------------------------------|---|-----------|---|-------------------------------|---|
| | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | |
| 968 | AMN Healthcare Services Inc | Goldman Sachs | 3.311 | (9.659) | Anika Therapeutics Inc | Barclays Bank | (6.568) |
| 1.241 | AMN Healthcare Services Inc | HSBC | 5.125 | (5.944) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 357 |
| 4.510 | AMN Healthcare Services Inc | Morgan Stanley | 21.837 | (211.359) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | Barclays Bank | (40.158) |
| 34.890 | Amneal Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 5.582 | (128.322) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | Goldman Sachs | 7.700 |
| 37.569 | Amneal Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 3.006 | (124.057) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | HSBC | (4.962) |
| 48.107 | Amneal Pharmaceuticals Inc | HSBC | 18.762 | (67.818) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | Morgan Stanley | (12.885) |
| 5.256 | Amneal Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 841 | 7.036 | Annexon Inc | Barclays Bank | (352) |
| 8.782 | Amphastar Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 27.663 | 6.160 | Annexon Inc | Goldman Sachs | (431) |
| 14.503 | Amphastar Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 37.418 | 1.636 | Annexon Inc | HSBC | 1.031 |
| 3.626 | Amphastar Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 11.422 | 1.796 | Annexon Inc | Morgan Stanley | (90) |
| (21.929) | Amphenol Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (20.808) | 1.173 | ANSYS Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12.586 |
| (29.660) | Amphenol Corp 'A' | Barclays Bank | (31.440) | 8.406 | ANSYS Inc | Barclays Bank | 19.334 |
| 38.607 | Amphenol Corp 'A' | Barclays Bank | 40.923 | 2.934 | ANSYS Inc | Goldman Sachs | 25.729 |
| (1.051) | Amphenol Corp 'A' | Goldman Sachs | (967) | 1.149 | ANSYS Inc | HSBC | 4.497 |
| 16.481 | Amphenol Corp 'A' | Goldman Sachs | 15.163 | 3.834 | ANSYS Inc | Morgan Stanley | 8.818 |
| (3.032) | Amphenol Corp 'A' | HSBC | (2.674) | (501) | Anterix Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.893 |
| (39.381) | Amphenol Corp 'A' | Morgan Stanley | (44.815) | (3.462) | Anterix Inc | Barclays Bank | 11.148 |
| 4.205 | Amphenol Corp 'A' | Morgan Stanley | 4.457 | (6.873) | Anterix Inc | Goldman Sachs | 53.403 |
| (10.021) | Ampio Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 94 | (4.022) | Anterix Inc | HSBC | 30.085 |
| 53.416 | Amplify Energy Corp | Barclays Bank | 75.317 | (4.878) | Anterix Inc | Morgan Stanley | 15.707 |
| (5.680) | Amplitude Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (11.587) | (10.453) | Antero Midstream Corp | Bank of America Merrill Lynch | (8.602) |
| (24.081) | Amyris Inc | Bank of America Merrill Lynch | (9.873) | (56.264) | Antero Midstream Corp | Barclays Bank | (33.758) |
| 25.498 | Amyris Inc | Barclays Bank | 7.904 | (4.074) | Antero Midstream Corp | Goldman Sachs | (3.000) |
| (25.410) | Amyris Inc | Barclays Bank | (7.877) | (66.417) | Antero Midstream Corp | HSBC | (69.738) |
| 15.817 | Amyris Inc | Goldman Sachs | 6.485 | 2.835 | Antero Resources Corp | Bank of America Merrill Lynch | 30.193 |
| (38.124) | Amyris Inc | Goldman Sachs | (15.631) | (1.658) | Antero Resources Corp | Barclays Bank | (2.023) |
| 23.847 | Amyris Inc | HSBC | 1.192 | 7.161 | Antero Resources Corp | Barclays Bank | 37.380 |
| 4.573 | Analog Devices Inc | Barclays Bank | 16.920 | (3.638) | Antero Resources Corp | Goldman Sachs | (38.745) |
| 9.850 | Analog Devices Inc | Goldman Sachs | 73.123 | (11.428) | Antero Resources Corp | HSBC | (131.818) |
| (6.357) | Analog Devices Inc | Goldman Sachs | (43.457) | (18.486) | Antero Resources Corp | Morgan Stanley | (96.497) |
| 2.092 | Analog Devices Inc | HSBC | (3.041) | 576 | Anthem Inc | Barclays Bank | 12.914 |
| (1.231) | Analog Devices Inc | HSBC | (11.172) | 6.834 | Anthem Inc | Goldman Sachs | 161.829 |
| (3.229) | AnaptysBio Inc | Barclays Bank | 4.521 | 4.663 | Anthem Inc | HSBC | 123.057 |
| (10.376) | AnaptysBio Inc | Goldman Sachs | 18.353 | 1.512 | Anthem Inc | Morgan Stanley | 33.899 |
| (7.792) | AnaptysBio Inc | HSBC | 22.363 | (5.789) | Aon Plc 'A' | Barclays Bank | (51.201) |
| (4.541) | Anavex Life Sciences Corp | Bank of America Merrill Lynch | (4.359) | (1.754) | Aon Plc 'A' | Goldman Sachs | (8.163) |
| (10.227) | Anavex Life Sciences Corp | Barclays Bank | (4.193) | (444) | Aon Plc 'A' | HSBC | 654 |
| (13.653) | Anavex Life Sciences Corp | Goldman Sachs | (13.107) | (2.508) | Aon Plc 'A' | Morgan Stanley | (21.994) |
| (13.761) | Anavex Life Sciences Corp | HSBC | (28.423) | 9.577 | APA Corp | Bank of America Merrill Lynch | 64.932 |
| (5.388) | Anavex Life Sciences Corp | Morgan Stanley | (2.209) | 8.395 | APA Corp | Barclays Bank | 42.311 |
| 12.558 | Andersons Inc | Barclays Bank | 6.781 | (30.169) | APA Corp | Goldman Sachs | (204.546) |
| 4.420 | Andersons Inc | Goldman Sachs | (1.591) | 3.751 | APA Corp | HSBC | 30.463 |
| (10.449) | ANGI Homeservices Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (7.941) | 6.466 | APA Corp | Morgan Stanley | 32.589 |
| (18.590) | ANGI Homeservices Inc 'A' | Barclays Bank | (10.039) | (63.549) | Apartment Income Corp (REIT) | Barclays Bank | (74.988) |
| (19.520) | ANGI Homeservices Inc 'A' | Goldman Sachs | (14.835) | (59.079) | Apartment Income Corp (REIT) | Goldman Sachs | (74.033) |
| (13.902) | AngioDynamics Inc | Barclays Bank | (5.561) | (35.743) | Apartment Income Corp (REIT) | HSBC | (73.988) |
| (14.442) | AngioDynamics Inc | HSBC | (21.374) | (12.486) | Apartment Income Corp (REIT) | Morgan Stanley | (14.733) |
| 8.900 | Angion Biomedica Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.424 | 5.505 | Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 2.697 |
| 3.617 | Angion Biomedica Corp | Barclays Bank | 796 | 35.888 | Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT) | Barclays Bank | 12.202 |
| 2.845 | Angion Biomedica Corp | Morgan Stanley | 626 | 39.225 | Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT) | Goldman Sachs | 19.220 |
| (8.222) | ANI Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 7.893 | | | | |
| (10.793) | ANI Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (13.707) | | | | |
| (1.463) | Anika Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 322 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|-------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 54.507 | Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT) | HSBC | 31.614 | (2.771) | Appian Corp | Morgan Stanley | (693) |
| 5.146 | Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT) | Morgan Stanley | 1.750 | (7.243) | Apple Hospitality Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (2.390) |
| 3.586 | Apellis Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 11.690 | (42.781) | Apple Hospitality Inc (REIT) | Barclays Bank | (44.064) |
| 694 | Apellis Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (1.610) | (21.269) | Apple Hospitality Inc (REIT) | Goldman Sachs | (7.019) |
| (2.735) | Apellis Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (8.916) | (58.929) | Apple Hospitality Inc (REIT) | HSBC | (40.326) |
| 8.586 | Apellis Pharmaceuticals Inc | HSBC | 45.245 | (13.877) | Apple Hospitality Inc (REIT) | Morgan Stanley | (14.293) |
| 2.315 | Apellis Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (4.001) | (4.324) | Apple Inc | Bank of America Merrill Lynch | (9.067) |
| 5.384 | Apergy Corp | Bank of America Merrill Lynch | 10.983 | (21.136) | Apple Inc | Barclays Bank | (101.453) |
| (3.947) | Apergy Corp | Bank of America Merrill Lynch | (7.414) | (7.699) | Apple Inc | Goldman Sachs | (42.563) |
| (24.412) | Apergy Corp | Barclays Bank | (49.801) | (10.838) | Apple Inc | HSBC | 19.966 |
| 3.156 | Apergy Corp | Barclays Bank | 6.438 | (9.578) | Apple Inc | Morgan Stanley | (52.861) |
| (18.871) | Apergy Corp | Goldman Sachs | (38.497) | 9.616 | Applied Industrial Technologies Inc | Barclays Bank | 16.059 |
| 1.523 | Apergy Corp | Goldman Sachs | 3.107 | 18.879 | Applied Industrial Technologies Inc | Goldman Sachs | (88.165) |
| (26.470) | Apergy Corp | HSBC | (92.030) | 7.457 | Applied Industrial Technologies Inc | HSBC | (32.587) |
| 3.242 | Apergy Corp | HSBC | 5.310 | (5.580) | Applied Materials Inc | Bank of America Merrill Lynch | (34.111) |
| (30.351) | Apergy Corp | Morgan Stanley | (61.916) | 4.064 | Applied Materials Inc | Bank of America Merrill Lynch | 26.599 |
| 4.292 | Apergy Corp | Morgan Stanley | 7.545 | (2.638) | Applied Materials Inc | Barclays Bank | (18.717) |
| (2.264) | API Group Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.604) | (12.392) | Applied Materials Inc | Goldman Sachs | (77.591) |
| (59.931) | API Group Corp | Barclays Bank | (1.798) | 6.631 | Applied Materials Inc | Goldman Sachs | 39.945 |
| (76.932) | API Group Corp | Goldman Sachs | (88.472) | (8.930) | Applied Materials Inc | HSBC | (98.166) |
| (25.006) | API Group Corp | Morgan Stanley | (750) | 12.136 | Applied Materials Inc | HSBC | 87.678 |
| (632) | Apogee Enterprises Inc | Bank of America Merrill Lynch | (841) | (13.122) | Applied Materials Inc | Morgan Stanley | (96.138) |
| (10.645) | Apogee Enterprises Inc | Barclays Bank | (15.252) | 25.755 | Applied Molecular Transport Inc | Bank of America Merrill Lynch | (18.286) |
| (13.796) | Apogee Enterprises Inc | Goldman Sachs | (17.716) | 10.154 | Applied Molecular Transport Inc | Barclays Bank | 305 |
| (2.000) | Apogee Enterprises Inc | HSBC | (2.649) | 7.264 | Applied Molecular Transport Inc | Goldman Sachs | (5.157) |
| (17.501) | Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (5.863) | 1.757 | Applied Molecular Transport Inc | HSBC | (1.915) |
| (28.852) | Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT) | Barclays Bank | (17.167) | 8.398 | Applied Molecular Transport Inc | Morgan Stanley | 252 |
| (90.251) | Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT) | Goldman Sachs | (31.140) | 39.848 | Applied Optoelectronics Inc | Barclays Bank | 3.985 |
| (33.396) | Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT) | HSBC | (28.197) | 29.363 | Applied Optoelectronics Inc | Goldman Sachs | 294 |
| (14.704) | Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT) | Morgan Stanley | (8.749) | 22.186 | Applied Optoelectronics Inc | HSBC | 2.884 |
| 3.131 | Apollo Endosurgery Inc | HSBC | (1.127) | 15.491 | Applied Optoelectronics Inc | Morgan Stanley | 1.549 |
| (9.077) | Apollo Global Management Inc | Barclays Bank | (33.494) | 4.034 | Applied Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (605) |
| (42.426) | Apollo Global Management Inc | Goldman Sachs | (222.739) | 5.010 | Applied Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (752) |
| (17.612) | Apollo Global Management Inc | HSBC | (164.848) | 7.069 | Applied Therapeutics Inc | HSBC | (1.484) |
| (1.564) | Apollo Medical Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.238) | 1.713 | Applied Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 17 |
| (1.778) | Apollo Medical Holdings Inc | Barclays Bank | (2.311) | (3.619) | AppLovin Corp 'A' | Barclays Bank | (3.004) |
| (7.352) | Apollo Medical Holdings Inc | Goldman Sachs | (19.924) | (735) | AppLovin Corp 'A' | Goldman Sachs | (1.058) |
| (712) | Apollo Medical Holdings Inc | HSBC | (3.759) | (24.440) | AppLovin Corp 'A' | HSBC | (210.429) |
| (1.069) | Apollo Medical Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.390) | (680) | AppLovin Corp 'A' | Morgan Stanley | (564) |
| 1.008 | Appfolio Inc 'A' | Barclays Bank | 6.199 | 633 | AptarGroup Inc | Bank of America Merrill Lynch | (639) |
| 4.940 | Appfolio Inc 'A' | Goldman Sachs | 75.286 | 9.457 | AptarGroup Inc | Barclays Bank | 29.167 |
| 3.605 | Appfolio Inc 'A' | HSBC | 18.926 | 5.211 | AptarGroup Inc | Goldman Sachs | (5.263) |
| (2.291) | Appian Corp | Bank of America Merrill Lynch | 9.154 | 8.185 | AptarGroup Inc | HSBC | 2.537 |
| 36 | Appian Corp | Bank of America Merrill Lynch | (193) | 9.613 | AptarGroup Inc | Morgan Stanley | 28.630 |
| (7.888) | Appian Corp | Barclays Bank | (1.973) | 13.170 | Aptinix Inc | Goldman Sachs | (1.297) |
| 1.970 | Appian Corp | Barclays Bank | 493 | 37.647 | Aptinix Inc | HSBC | (7.311) |
| (6.109) | Appian Corp | Goldman Sachs | 25.879 | 56.912 | Aptinix Inc | Morgan Stanley | (2.766) |
| (4.729) | Appian Corp | HSBC | (3.119) | 6.790 | Aptiv Plc | Barclays Bank | 63.554 |
| 2.766 | Appian Corp | HSBC | 13.581 | (1.029) | Aptiv Plc | Barclays Bank | (12.579) |
| | | | | 2.671 | Aptiv Plc | Goldman Sachs | 22.009 |
| | | | | (4.414) | Aptiv Plc | Goldman Sachs | (47.328) |
| | | | | 7.292 | Aptiv Plc | Morgan Stanley | 68.253 |
| | | | | (6.122) | Apyx Medical Corp | Barclays Bank | (16.591) |
| | | | | (8.089) | Apyx Medical Corp | Goldman Sachs | (21.355) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------------|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (6.394) | Aqua Metals Inc | Bank of America | | (3.324) | Arcus Biosciences Inc | Barclays Bank | 299 |
| | | Merrill Lynch | (243) | (4.734) | Arcus Biosciences Inc | Goldman Sachs | 3.787 |
| (63.743) | Aqua Metals Inc | Morgan Stanley | (4.137) | (5.621) | Arcus Biosciences Inc | HSBC | 14.109 |
| (17.538) | AquaBounty Technologies Inc | Barclays Bank | (3.420) | 4.166 | Arcutis Biotherapeutics Inc | Barclays Bank | (1.833) |
| 1.046 | Aquestive Therapeutics Inc | Bank of America | | 4.140 | Arcutis Biotherapeutics Inc | Goldman Sachs | 10.888 |
| | | Merrill Lynch | (251) | 10.222 | Arcutis Biotherapeutics Inc | HSBC | 20.853 |
| 24.829 | Aquestive Therapeutics Inc | Barclays Bank | (745) | 788 | Arcutis Biotherapeutics Inc | Morgan Stanley | (347) |
| 5.281 | Aquestive Therapeutics Inc | HSBC | (106) | (5.094) | Ardagh Group SA* | Barclays Bank | 65.560 |
| 11.002 | Aquestive Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (330) | (10.777) | Ardagh Group SA* | Goldman Sachs | 138.700 |
| (13.872) | Aramark | Bank of America | | (13.020) | Ardagh Group SA* | HSBC | 167.567 |
| | | Merrill Lynch | (7.504) | 12.263 | Ardagh Metal Packaging SA | Bank of America | |
| (21.120) | Aramark | Barclays Bank | (35.494) | | | Merrill Lynch | (2.207) |
| (28.098) | Aramark | Goldman Sachs | (18.879) | 52.262 | Ardagh Metal Packaging SA | Barclays Bank | 21.427 |
| (30.321) | Aramark | HSBC | (35.133) | 62.265 | Ardagh Metal Packaging SA | Goldman Sachs | (11.208) |
| (4.706) | Aramark | Morgan Stanley | (6.946) | 42.341 | Ardagh Metal Packaging SA | HSBC | (9.315) |
| 59.129 | Arbor Realty Trust Inc (REIT) | | | 32.489 | Ardagh Metal Packaging SA | Morgan Stanley | 13.320 |
| | | Barclays Bank | 26.017 | (175.847) | Ardelyx Inc | Goldman Sachs | 193 |
| 85.681 | Arbor Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (51.409) | 7.082 | Ardmore Shipping Corp | Barclays Bank | (212) |
| (9.807) | Arbutus Biopharma Corp | Barclays Bank | (49) | 57.120 | Ardmore Shipping Corp | Goldman Sachs | 9.710 |
| (13.043) | Arbutus Biopharma Corp | HSBC | (2.283) | (4.629) | Ares Commercial Real Estate Corp (REIT) | Bank of America | |
| 46.017 | ARC Document Solutions Inc | Bank of America | | (42.824) | Ares Commercial Real Estate Corp (REIT) | Merrill Lynch | 2.407 |
| | | Merrill Lynch | 5.522 | | | Barclays Bank | (14.988) |
| (2.686) | ArcBest Corp | Goldman Sachs | (1.585) | (63.881) | Ares Commercial Real Estate Corp (REIT) | | |
| 1.654 | Arcellx Inc | Goldman Sachs | 6.831 | (30.871) | Ares Commercial Real Estate Corp (REIT) | Goldman Sachs | 33.218 |
| (27.615) | Arch Capital Group Ltd | Bank of America | | (10.129) | Ares Commercial Real Estate Corp (REIT) | HSBC | (1.849) |
| | | Merrill Lynch | (25.897) | | | Bank of America | |
| 4.837 | Arch Capital Group Ltd | Bank of America | | (10.718) | Ares Management Corp 'A' | Merrill Lynch | (39.503) |
| | | Merrill Lynch | 3.340 | 2.336 | Ares Management Corp 'A' | Barclays Bank | (32.092) |
| (1.364) | Arch Capital Group Ltd | Barclays Bank | (1.009) | (8.449) | Ares Management Corp 'A' | Barclays Bank | 6.938 |
| 10.896 | Arch Capital Group Ltd | Barclays Bank | 8.063 | (6.707) | Ares Management Corp 'A' | Goldman Sachs | (31.346) |
| (29.569) | Arch Capital Group Ltd | Goldman Sachs | (28.023) | 6.401 | Argan Inc | HSBC | (52.934) |
| (7.534) | Arch Capital Group Ltd | HSBC | (10.063) | 10.507 | Argan Inc | Barclays Bank | 11.074 |
| 8.877 | Arch Capital Group Ltd | HSBC | 16.245 | 9.973 | Argan Inc | Goldman Sachs | 39.296 |
| (32.848) | Arch Capital Group Ltd | Morgan Stanley | (23.229) | 3.019 | Argan Inc | HSBC | 47.272 |
| 13.081 | Archaea Energy Inc | Barclays Bank | 28.255 | (2.155) | Argo Group International Holdings Ltd | Morgan Stanley | 5.223 |
| 2.333 | Archaea Energy Inc | HSBC | 1.143 | | | Barclays Bank | (819) |
| (48.312) | Archer Aviation Inc 'A' | Goldman Sachs | (6.039) | (4.667) | Argo Group International Holdings Ltd | Goldman Sachs | (1.120) |
| (10.827) | Archer-Daniels-Midland Co | Bank of America | | (3.884) | Argo Group International Holdings Ltd | HSBC | (1.631) |
| | | Merrill Lynch | (25.763) | 3.922 | Arhaus Inc | Bank of America | |
| (2.494) | Archer-Daniels-Midland Co | Barclays Bank | (8.330) | 6.929 | Arhaus Inc | Merrill Lynch | 160 |
| (3.010) | Archer-Daniels-Midland Co | Goldman Sachs | (4.847) | 9.348 | Arhaus Inc | Goldman Sachs | (1.039) |
| (4.647) | Archer-Daniels-Midland Co | HSBC | (23.477) | 400 | Arhaus Inc | HSBC | (11.778) |
| (16.554) | Archer-Daniels-Midland Co | Morgan Stanley | (55.290) | (20.387) | Aris Water Solution Inc 'A' | Morgan Stanley | (12) |
| 4.236 | Archimedes Tech SPAC Partners Co 'A' | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 8.874 | (2.446) | Arista Networks Inc | Merrill Lynch | (54.229) |
| 8.836 | Archimedes Tech SPAC Partners Co 'A' | Barclays Bank | 18.025 | (2.990) | Arista Networks Inc | Barclays Bank | 5.496 |
| 6.824 | Archimedes Tech SPAC Partners Co 'A' | Morgan Stanley | 13.921 | (5.905) | Arista Networks Inc | Barclays Bank | (1.794) |
| 31.887 | Archrock Inc | Goldman Sachs | 34.757 | (8.700) | Arista Networks Inc | Goldman Sachs | 11.604 |
| 21.450 | Archrock Inc | HSBC | 41.827 | (14.324) | Arista Networks Inc | HSBC | (3.232) |
| 58.808 | Archrock Inc | Morgan Stanley | 51.751 | (14.609) | Arko Corp | Morgan Stanley | (8.595) |
| 4.738 | Arconic Rolled Products Corp | Barclays Bank | 1.895 | (23.549) | Arko Corp | Barclays Bank | (4.967) |
| 13.091 | Arconic Rolled Products Corp | HSBC | 23.433 | (34.412) | Arko Corp | Goldman Sachs | (10.907) |
| (3.809) | Arcosa Inc | Bank of America | | (4.397) | Arko Corp | HSBC | (33.529) |
| | | Merrill Lynch | (4.217) | (8.963) | Arlo Technologies Inc | Morgan Stanley | (1.495) |
| (14.588) | Arcosa Inc | Barclays Bank | (22.611) | (2.330) | Arlo Technologies Inc | Barclays Bank | (2.241) |
| (3.926) | Arcosa Inc | Goldman Sachs | (5.496) | (37.773) | Arlo Technologies Inc | Goldman Sachs | (769) |
| (3.634) | Arcosa Inc | Morgan Stanley | (4.293) | 91.167 | Armada Hoffer Properties Inc (REIT) | HSBC | (2.644) |
| (3.322) | Arcturus Therapeutics Holdings Inc | Bank of America | | | | Barclays Bank | 38.290 |
| | | Merrill Lynch | (7.240) | 56.766 | Armada Hoffer Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 36.898 |
| (3.389) | Arcturus Therapeutics Holdings Inc | Barclays Bank | (5.524) | | | | |
| (2.332) | Arcturus Therapeutics Holdings Inc | Goldman Sachs | (6.670) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|---|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 35.818 | Armada Hoffer Properties Inc (REIT) | HSBC | 35.818 | (5.361) | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | Morgan Stanley | (12.598) |
| (19.499) | ARMOUR Residential Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 390 | 6.036 | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | Morgan Stanley | 14.185 |
| (215.855) | ARMOUR Residential Inc (REIT) | Barclays Bank | (23.744) | 18.805 | Artivion Inc | Barclays Bank | 6.770 |
| (27.224) | ARMOUR Residential Inc (REIT) | Goldman Sachs | 544 | 31.588 | Artivion Inc | Goldman Sachs | 59.070 |
| (50.038) | ARMOUR Residential Inc (REIT) | Morgan Stanley | (5.504) | 15.209 | Artivion Inc | HSBC | 39.391 |
| (4.461) | Armstrong World Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (267) | 5.115 | Artivion Inc | Morgan Stanley | 1.841 |
| (6.868) | Armstrong World Industries Inc | Barclays Bank | (1.854) | 4.367 | Arvinas Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.755) |
| (7.586) | Armstrong World Industries Inc | Goldman Sachs | (456) | 4.321 | Arvinas Inc | Barclays Bank | (6.655) |
| (13.864) | Armstrong World Industries Inc | HSBC | 3.424 | 1.893 | Arvinas Inc | Goldman Sachs | (122) |
| (11.420) | Armstrong World Industries Inc | Morgan Stanley | (5.143) | 1.692 | Arvinas Inc | HSBC | 4.500 |
| (21.528) | Array Technologies Inc | Barclays Bank | (34.660) | (13.904) | Asana Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.988 |
| (8.817) | Array Technologies Inc | Goldman Sachs | (36.062) | (11.731) | Asana Inc 'A' | Barclays Bank | (4.692) |
| (7.984) | Array Technologies Inc | HSBC | (29.621) | (22.834) | Asana Inc 'A' | Goldman Sachs | (8.181) |
| (6.305) | Array Technologies Inc | Morgan Stanley | (10.151) | (4.147) | Asana Inc 'A' | HSBC | 3.721 |
| (22.690) | Arrow Electronics Inc | Barclays Bank | (30.405) | 1.072 | Asbury Automotive Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.332 |
| (17.654) | Arrow Electronics Inc | Goldman Sachs | 79.620 | 518 | Asbury Automotive Group Inc | Barclays Bank | 5.603 |
| (9.652) | Arrow Electronics Inc | HSBC | 45.364 | (352) | Asbury Automotive Group Inc | Barclays Bank | (5.498) |
| (625) | Arrow Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (775) | (3.598) | Asbury Automotive Group Inc | Goldman Sachs | 14.752 |
| (9.182) | Arrow Financial Corp | Barclays Bank | (4.591) | 955 | Asbury Automotive Group Inc | HSBC | 11.423 |
| (6.762) | Arrow Financial Corp | Goldman Sachs | (8.385) | (911) | Asbury Automotive Group Inc | HSBC | 4.365 |
| (2.644) | Arrow Financial Corp | HSBC | (344) | 1.051 | Asbury Automotive Group Inc | Morgan Stanley | 16.417 |
| (582) | Arrow Financial Corp | Morgan Stanley | (291) | (11.680) | Ascet Global Logistics Holding Inc | Bank of America Merrill Lynch | 117 |
| (108) | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (116) | (16.747) | Ascet Global Logistics Holding Inc | Goldman Sachs | 17 |
| (28.448) | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 59.741 | (3.298) | Ascet Global Logistics Holding Inc | HSBC | — |
| (8.314) | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (8.896) | (9.988) | Ascet Global Logistics Holding Inc ^o | Morgan Stanley | — |
| 3.665 | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 3.922 | (95.171) | Asensus Surgical Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.958) |
| 810 | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | HSBC | 996 | (52.019) | Asensus Surgical Inc | Barclays Bank | (1.035) |
| (2.054) | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | HSBC | (2.526) | 1.628 | ASGN Inc | Bank of America Merrill Lynch | (10.980) |
| (935) | Arteris Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.019) | 12.603 | ASGN Inc | Barclays Bank | (51.163) |
| (8.319) | Arteris Inc | Barclays Bank | (4.825) | 28.494 | ASGN Inc | Goldman Sachs | (227.365) |
| (4.322) | Arteris Inc | Goldman Sachs | (1.260) | 24.491 | ASGN Inc | HSBC | (334.101) |
| 9.239 | Artesian Resources Corp 'A' | Morgan Stanley | 12.750 | 1.441 | ASGN Inc | Morgan Stanley | (6.268) |
| (2.017) | Arthur J Gallagher & Co | Bank of America Merrill Lynch | (4.203) | 7.067 | Ashford Hospitality Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 2.544 |
| (9.076) | Arthur J Gallagher & Co | Barclays Bank | (40.433) | 13.927 | Ashford Hospitality Trust Inc (REIT) | HSBC | 3.503 |
| (28.545) | Arthur J Gallagher & Co | Goldman Sachs | (44.924) | 4.294 | Ashford Hospitality Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.546 |
| (18.752) | Arthur J Gallagher & Co | HSBC | (59.237) | (1.051) | Ashland Global Holdings Inc | Barclays Bank | (3.922) |
| (4.763) | Arthur J Gallagher & Co | Morgan Stanley | (21.219) | (5.566) | Ashland Global Holdings Inc | Goldman Sachs | (42.357) |
| (1.809) | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (6.494) | (886) | Ashland Global Holdings Inc | HSBC | (695) |
| (6.515) | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | Barclays Bank | (15.311) | (11.865) | Ashland Global Holdings Inc | Morgan Stanley | (66.883) |
| 16.469 | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | Barclays Bank | 38.702 | (5.997) | Aspen Aerogels Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.136) |
| (4.459) | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | Goldman Sachs | (16.008) | (8.832) | Aspen Aerogels Inc | Barclays Bank | (15.721) |
| 13.198 | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | Goldman Sachs | 47.381 | (7.649) | Aspen Aerogels Inc | Goldman Sachs | (9.102) |
| (18.909) | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | HSBC | (74.691) | (5.934) | Aspen Aerogels Inc | HSBC | (10.528) |
| 10.302 | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | HSBC | 41.815 | (1.074) | Aspen Aerogels Inc | Morgan Stanley | (1.912) |
| | | | | (5.738) | Aspen Group Inc Co | Bank of America Merrill Lynch | (1.048) |
| | | | | (19.979) | Aspen Group Inc Co | Barclays Bank | (1.560) |
| | | | | (7.454) | Aspen Group Inc Co | Morgan Stanley | (582) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (545) | Aspen Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.501) | 5.313 | Atara Biotherapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.009) |
| (848) | Aspen Technology Inc | Barclays Bank | (3.604) | 16.222 | Atara Biotherapeutics Inc | Barclays Bank | 2.109 |
| (636) | Aspen Technology Inc | Goldman Sachs | 127.129 | 23.265 | Atara Biotherapeutics Inc | Goldman Sachs | (5.428) |
| (241) | Aspen Technology Inc | HSBC | 44.934 | 9.690 | Atara Biotherapeutics Inc | HSBC | (5.911) |
| 296 | Aspen Technology Inc | HSBC | (54.992) | 27.561 | Atea Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 19.568 |
| (1.841) | Aspen Technology Inc | Morgan Stanley | (8.682) | 3.953 | Atea Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 1.977 |
| 1 | Aspen Technology Inc | Morgan Stanley | (118) | 11.717 | Atea Pharmaceuticals Inc | HSBC | 31.402 |
| (5.828) | Aspira Women's Health Inc | Bank of America Merrill Lynch | 72 | 7.770 | Athenex Inc | Bank of America Merrill Lynch | 51 |
| (39.106) | Aspira Women's Health Inc | Barclays Bank | (3.019) | 14.788 | Athenex Inc | Goldman Sachs | 96 |
| (46.809) | Aspira Women's Health Inc | HSBC | 84 | 7.609 | Athenex Inc | HSBC | 85 |
| (14.850) | Aspira Women's Health Inc | Morgan Stanley | (1.146) | 16.339 | Athenex Inc | Morgan Stanley | (29) |
| 37.312 | Assembly Biosciences Inc | Barclays Bank | 10.074 | 14.919 | Athersys Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.648) |
| 11.302 | Assembly Biosciences Inc | Goldman Sachs | 3.278 | | | | |
| 15.726 | Assembly Biosciences Inc | HSBC | 7.706 | 11.767 | Athersys Inc | Barclays Bank | (135) |
| 24.008 | Assembly Biosciences Inc | Morgan Stanley | 6.482 | 66.835 | Athersys Inc | Goldman Sachs | (29.782) |
| 8.711 | Assetmark Financial Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12.021 | 115.269 | Athersys Inc | HSBC | (48.125) |
| 31.961 | AssetMark Financial Holdings Inc | | | 44.484 | Athersys Inc | Morgan Stanley | (512) |
| 10.516 | AssetMark Financial Holdings Inc | Barclays Bank | 35.477 | (13.463) | Athira Pharma Inc | Goldman Sachs | (6.597) |
| 23.002 | AssetMark Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 15.093 | (18.378) | ATI Physical Therapy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.962) |
| 5.860 | AssetMark Financial Holdings Inc | HSBC | 47.837 | (6.750) | ATI Physical Therapy Inc | Goldman Sachs | (1.823) |
| (5.911) | Associated Banc-Corp | | | (5.335) | Atkore Inc | Barclays Bank | (22.513) |
| (99.470) | Associated Banc-Corp | Morgan Stanley | 6.505 | 8.993 | Atkore Inc | Barclays Bank | 37.950 |
| (49.922) | Associated Banc-Corp | Bank of America Merrill Lynch | (5.911) | (4.866) | Atkore Inc | Goldman Sachs | (5.547) |
| (56.493) | Associated Banc-Corp | Barclays Bank | (43.766) | (10.965) | Atlantic Union Bankshares Corp | Bank of America Merrill Lynch | (6.489) |
| (40.900) | Associated Banc-Corp | Goldman Sachs | (49.922) | (3.340) | Atlantic Union Bankshares Corp | Barclays Bank | (1.236) |
| (2.751) | Associated Capital Group Inc 'A' | HSBC | (41.393) | (2.047) | Atlantic Union Bankshares Corp | Goldman Sachs | (1.453) |
| (2.355) | Associated Capital Group Inc 'A' | Morgan Stanley | (17.996) | (23.147) | Atlantic Union Bankshares Corp | HSBC | (249) |
| (1.862) | Assurant Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.458 | (76.364) | Atlantic Union Bankshares Corp | Morgan Stanley | (28.255) |
| (10.377) | Assurant Inc | HSBC | (1.719) | (4.846) | Atlanticus Holdings Corp | Barclays Bank | (17.736) |
| (5.504) | Assurant Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.719 | (668) | Atlanticus Holdings Corp | Goldman Sachs | (2.298) |
| (1.809) | Assurant Inc | Barclays Bank | (5.500) | (1.433) | Atlanticus Holdings Corp | HSBC | (1.722) |
| (17.624) | Assurant Inc | Goldman Sachs | 8.036 | (1.399) | Atlas Air Worldwide Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.248 |
| (780) | Assured Guaranty Ltd | HSBC | 3.528 | (8.918) | Atlas Air Worldwide Holdings Inc | Barclays Bank | (15.607) |
| (14.313) | Assured Guaranty Ltd | Morgan Stanley | (8.245) | (1.722) | Atlas Air Worldwide Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.193 |
| (4.082) | Assured Guaranty Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.246) | (2.630) | Atlas Air Worldwide Holdings Inc | HSBC | 2.499 |
| (2.623) | Assured Guaranty Ltd | Barclays Bank | (17.748) | 11 | Atlas Financial Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1) |
| (433) | Assured Guaranty Ltd | Goldman Sachs | (11.756) | (10.008) | Atlas Technical Consultants Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.105) |
| 3.528 | Astec Industries Inc | HSBC | (7.108) | (32.489) | Atlas Technical Consultants Inc | Barclays Bank | (23.392) |
| 7.299 | Astec Industries Inc | Morgan Stanley | (537) | 288 | Atlassian Corp Plc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.077 |
| 14.455 | Astec Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6.350 | 3.222 | Atlassian Corp Plc 'A' | Barclays Bank | 6.895 |
| 10.777 | Astec Industries Inc | Barclays Bank | 9.927 | 853 | Atlassian Corp Plc 'A' | Goldman Sachs | 2.564 |
| 1.326 | Astec Industries Inc | Goldman Sachs | 9.927 | 1.083 | Atlassian Corp Plc 'A' | HSBC | 6.937 |
| 15.281 | Astronics Corp | HSBC | 26.019 | 40.026 | Atmos Energy Corp | Barclays Bank | 90.058 |
| 19.306 | Astronics Corp | Morgan Stanley | 1.803 | 26.971 | Atmos Energy Corp | Goldman Sachs | 74.440 |
| 15.759 | Astronics Corp | Barclays Bank | (3.362) | 9.940 | Atmos Energy Corp | HSBC | 22.896 |
| 9.829 | Astronics Corp | Goldman Sachs | 7.529 | 13.829 | Atmos Energy Corp | Morgan Stanley | 31.115 |
| 12.445 | Astronics Corp | HSBC | (3.467) | 1.869 | ATN International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.364 |
| (12.258) | Asure Software Inc | Morgan Stanley | (2.084) | 12.679 | ATN International Inc | Barclays Bank | 13.947 |
| (3.796) | Asure Software Inc | Bank of America Merrill Lynch | (190) | 957 | ATN International Inc | Goldman Sachs | 2.747 |
| (3.555) | Asure Software Inc | Barclays Bank | (604) | 2.257 | ATN International Inc | HSBC | 5.778 |
| (46.082) | AT&T Inc | HSBC | (20.355) | (13.767) | Atomeria Inc | Barclays Bank | (7.228) |
| (42.532) | AT&T Inc | Morgan Stanley | (20.203) | (3.140) | Atomeria Inc | Goldman Sachs | (4.066) |
| (85.567) | AT&T Inc | Bank of America Merrill Lynch | (73.392) | | | | |
| (71.011) | AT&T Inc | Barclays Bank | (105.515) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (7.257) | Atomera Inc | HSBC | (8.745) | 890 | AvalonBay Communities Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 3.453 |
| (4.134) | Atomera Inc | Morgan Stanley | (2.170) | (12.944) | AvalonBay Communities Inc (REIT) | Barclays Bank | (56.750) |
| (10.019) | Atossa Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 254 | 5.115 | AvalonBay Communities Inc (REIT) | Barclays Bank | 23.222 |
| (24.041) | Atossa Therapeutics Inc | HSBC | — | (3.885) | AvalonBay Communities Inc (REIT) | Goldman Sachs | (14.846) |
| 50.846 | Atreca Inc 'A' | Barclays Bank | (3.559) | 2.691 | AvalonBay Communities Inc (REIT) | Goldman Sachs | 10.441 |
| 46.060 | Atreca Inc 'A' | Goldman Sachs | (461) | (4.345) | AvalonBay Communities Inc (REIT) | HSBC | (15.446) |
| 5.426 | Atreca Inc 'A' | Morgan Stanley | (380) | 683 | AvalonBay Communities Inc (REIT) | HSBC | 3.422 |
| 695 | AtriCure Inc | Bank of America Merrill Lynch | (658) | (3.783) | AvalonBay Communities Inc (REIT) | Morgan Stanley | (17.175) |
| 4.067 | AtriCure Inc | Barclays Bank | (8.866) | (12.423) | Avangrid Inc | Bank of America Merrill Lynch | (31.927) |
| 5.338 | AtriCure Inc | Goldman Sachs | (1.281) | 3.277 | Avangrid Inc | Bank of America Merrill Lynch | 8.422 |
| 8.853 | AtriCure Inc | HSBC | (2.532) | (19.524) | Avangrid Inc | Barclays Bank | 4.686 |
| 2.557 | AtriCure Inc | Morgan Stanley | (4.434) | 11.464 | Avangrid Inc | Barclays Bank | (2.751) |
| 754 | Atrion Corp | Morgan Stanley | 9.564 | (38.703) | Avangrid Inc | Goldman Sachs | (99.467) |
| (2.772) | aTyr Pharma Inc | HSBC | 2.162 | 10.599 | Avangrid Inc | Goldman Sachs | 23.992 |
| (29.820) | Audacy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.877 | 12.364 | Avangrid Inc | HSBC | 33.096 |
| (30.648) | Audacy Inc | Barclays Bank | (3.065) | 2.966 | Avangrid Inc | Morgan Stanley | (712) |
| (15.874) | Audacy Inc | Goldman Sachs | 2.064 | (12.231) | Avanos Medical Inc | Bank of America Merrill Lynch | (21.098) |
| (7.892) | AudioEye Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.894) | (14.990) | Avanos Medical Inc | Barclays Bank | (12.817) |
| 952 | Autodesk Inc | Barclays Bank | 21.591 | (1.002) | Avanos Medical Inc | Goldman Sachs | (1.213) |
| 2.872 | Autodesk Inc | Goldman Sachs | 38.747 | (4.337) | Avanos Medical Inc | HSBC | (6.074) |
| 2.894 | Autodesk Inc | HSBC | 57.504 | (13.534) | Avanos Medical Inc | Morgan Stanley | (11.233) |
| 2.671 | Autodesk Inc | Morgan Stanley | 60.578 | (8.616) | Avantor Inc | Bank of America Merrill Lynch | (13.613) |
| (1.403) | Autoliv Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.692) | 15.507 | Avantor Inc | Barclays Bank | 10.700 |
| (5.887) | Autoliv Inc | Barclays Bank | (7.947) | (8.678) | Avantor Inc | Barclays Bank | (5.988) |
| (8.192) | Autoliv Inc | Goldman Sachs | (37.040) | (5.303) | Avantor Inc | Goldman Sachs | (8.379) |
| (18.183) | Autoliv Inc | Morgan Stanley | (24.547) | (5.362) | Avantor Inc | HSBC | (11.610) |
| 1.460 | Automatic Data Processing Inc | Bank of America Merrill Lynch | 20.907 | 2.946 | Avantor Inc | Morgan Stanley | 2.033 |
| 6.103 | Automatic Data Processing Inc | Barclays Bank | 60.786 | (6.535) | Avantor Inc | Morgan Stanley | (4.733) |
| 4.089 | Automatic Data Processing Inc | Goldman Sachs | 58.554 | 923 | Avaya Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.920) |
| 1.440 | Automatic Data Processing Inc | HSBC | 19.580 | 13.367 | Avaya Holdings Corp | Barclays Bank | (5.213) |
| 6.747 | Automatic Data Processing Inc | Morgan Stanley | 67.200 | 11.026 | Avaya Holdings Corp | Goldman Sachs | (22.934) |
| 2.183 | AutoNation Inc | Bank of America Merrill Lynch | 21.150 | 20.153 | Avaya Holdings Corp | HSBC | (69.869) |
| (1.254) | AutoNation Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.411 | 4.238 | Avaya Holdings Corp | Morgan Stanley | (1.653) |
| 359 | AutoNation Inc | Barclays Bank | 4.330 | 50.028 | Aveanna Healthcare Holdings Inc | Barclays Bank | 3.002 |
| (2.861) | AutoNation Inc | Barclays Bank | (34.504) | 32.200 | Aveanna Healthcare Holdings Inc | Goldman Sachs | 5.796 |
| 2.882 | AutoNation Inc | Goldman Sachs | (7.839) | 26.978 | Aveanna Healthcare Holdings Inc | HSBC | 8.363 |
| 2.182 | AutoNation Inc | HSBC | 9.086 | 5.787 | Aveanna Healthcare Holdings Inc | Morgan Stanley | 347 |
| 1.020 | AutoNation Inc | Morgan Stanley | 5.640 | 5.778 | AVEO Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 809 |
| 88 | AutoZone Inc | Bank of America Merrill Lynch | 13.003 | 7.829 | AVEO Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 1.096 |
| 83 | AutoZone Inc | Barclays Bank | 21.945 | 335 | Avery Dennison Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.514 |
| 161 | AutoZone Inc | Goldman Sachs | 6.755 | (1.152) | Avery Dennison Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.306 |
| 157 | AutoZone Inc | HSBC | 22.405 | 7.914 | Avery Dennison Corp | Barclays Bank | 30.865 |
| (649) | AutoZone Inc | Morgan Stanley | (171.596) | (1.675) | Avery Dennison Corp | Barclays Bank | (6.533) |
| 48 | AutoZone Inc | Morgan Stanley | 12.691 | (881) | Avery Dennison Corp | Goldman Sachs | 2.528 |
| (2.784) | Avalara Inc | Bank of America Merrill Lynch | (20.688) | (780) | Avery Dennison Corp | HSBC | 2.914 |
| (940) | Avalara Inc | Barclays Bank | (3.296) | (347) | Avery Dennison Corp | Morgan Stanley | (1.809) |
| (3.665) | Avalara Inc | Goldman Sachs | (30.676) | (935) | Aviat Networks Inc | Bank of America Merrill Lynch | (449) |
| (7.967) | Avalara Inc | HSBC | (65.903) | (5.261) | Aviat Networks Inc | Barclays Bank | (368) |
| (1.208) | Avalara Inc | Morgan Stanley | (7.381) | (4.193) | Aviat Networks Inc | Goldman Sachs | (2.013) |
| (49.534) | Avalo Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.204) | | | | |
| (54.392) | Avalo Therapeutics Inc | Barclays Bank | 566 | | | | |
| (10.916) | Avalo Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (486) | | | | |
| (11.196) | Avalo Therapeutics Inc | HSBC | 44 | | | | |
| (6.363) | AvalonBay Communities Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (24.477) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3.454) | Aviat Networks Inc | HSBC | (3.281) | 3.015 | Axogen Inc | Morgan Stanley | (980) |
| (1.741) | Aviat Networks Inc | Morgan Stanley | (531) | 293 | Axon Enterprise Inc | Bank of America | |
| (20.723) | Avid Bioservices Inc | Barclays Bank | (31.499) | | | Merrill Lynch | 1.251 |
| (17.488) | Avid Bioservices Inc | Goldman Sachs | (31.490) | 12.154 | Axon Enterprise Inc | Barclays Bank | 60.406 |
| (10.037) | Avid Bioservices Inc | HSBC | (16.361) | 1.424 | Axon Enterprise Inc | Goldman Sachs | 5.454 |
| (1.631) | Avid Bioservices Inc | Morgan Stanley | (2.479) | 619 | Axon Enterprise Inc | HSBC | 7.317 |
| (4.180) | Avid Technology Inc | Bank of America | | 3.341 | Axon Enterprise Inc | Morgan Stanley | 16.605 |
| | | Merrill Lynch | (18.894) | (7.572) | Axonics Inc | Barclays Bank | 6.360 |
| (7.461) | Avid Technology Inc | Barclays Bank | (21.115) | (2.999) | Axonics Inc | Goldman Sachs | (9.507) |
| (7.374) | Avid Technology Inc | Goldman Sachs | (33.330) | (8.224) | Axonics Inc | HSBC | (90.464) |
| (2.251) | Avid Technology Inc | HSBC | (13.348) | (41.821) | Axos Financial Inc | Barclays Bank | (74.023) |
| 1.148 | Avidity Biosciences Inc | Bank of America | | (9.743) | Axos Financial Inc | Goldman Sachs | (30.983) |
| | | Merrill Lynch | 723 | (1.468) | Axsome Therapeutics Inc | Bank of America | |
| 9.222 | Avidity Biosciences Inc | Barclays Bank | 9.130 | | | Merrill Lynch | 6.298 |
| 11.416 | Avidity Biosciences Inc | Goldman Sachs | 7.192 | (11.408) | Axsome Therapeutics Inc | Barclays Bank | 18.595 |
| 1.818 | Avidity Biosciences Inc | HSBC | 3.436 | (8.001) | AXT Inc | Barclays Bank | (3.840) |
| 2.300 | Avidity Biosciences Inc | Morgan Stanley | 2.277 | (5.336) | AXT Inc | Goldman Sachs | (1.708) |
| 1.999 | AvidXchange Holdings Inc | Bank of America | | (9.585) | AXT Inc | Morgan Stanley | (4.601) |
| | | Merrill Lynch | 4.178 | (18.197) | AZEK Co Inc | Bank of America | |
| 9.730 | AvidXchange Holdings Inc | Barclays Bank | 2.627 | | | Merrill Lynch | (47.312) |
| 5.514 | AvidXchange Holdings Inc | Goldman Sachs | 11.524 | (10.383) | AZEK Co Inc | Barclays Bank | (15.782) |
| 29.077 | AvidXchange Holdings Inc | HSBC | 61.825 | 11.650 | AZEK Co Inc | Barclays Bank | 17.708 |
| 6.329 | Avient Corp | Barclays Bank | 7.975 | (37.874) | AZEK Co Inc | Goldman Sachs | (98.472) |
| 41.322 | Avient Corp | Goldman Sachs | 102.892 | (22.664) | AZEK Co Inc | HSBC | (30.692) |
| 13.000 | Avient Corp | HSBC | 16.250 | 1.252 | AZEK Co Inc | HSBC | 2.347 |
| (140) | Avis Budget Group Inc | Bank of America | | (1.592) | AZEK Co Inc | Morgan Stanley | (2.420) |
| | | Merrill Lynch | (3.018) | (7.595) | Azenta Inc | Barclays Bank | (37.671) |
| (803) | Avis Budget Group Inc | Barclays Bank | (11.856) | (20.056) | Azenta Inc | Goldman Sachs | (23.265) |
| (5.131) | Avis Budget Group Inc | Goldman Sachs | 35.435 | (2.814) | Azenta Inc | HSBC | (31.066) |
| (223) | Avis Budget Group Inc | HSBC | (4.165) | 2.932 | Aziyo Biologics Inc 'A' | Barclays Bank | (1.349) |
| (509) | Avista Corp | Bank of America | | 1.573 | Aziyo Biologics Inc 'A' | Goldman Sachs | (629) |
| | | Merrill Lynch | 301 | 2.665 | Aziyo Biologics Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.226) |
| (12.095) | Avista Corp | Barclays Bank | (726) | 3.027 | AZZ Inc | Bank of America | |
| (26.229) | Avista Corp | HSBC | (28.590) | | | Merrill Lynch | 3.771 |
| (1.923) | Avista Corp | Morgan Stanley | 221 | 35.063 | AZZ Inc | Barclays Bank | 35.537 |
| (3.204) | Avita Medical Inc | Bank of America | | 12.668 | AZZ Inc | Goldman Sachs | 15.943 |
| | | Merrill Lynch | (320) | 2.081 | AZZ Inc | HSBC | 2.407 |
| (13.467) | Avita Medical Inc | Barclays Bank | (1.212) | 9.942 | AZZ Inc | Morgan Stanley | 10.240 |
| (1.429) | Avita Medical Inc | Goldman Sachs | (143) | (7.410) | B Riley Financial Inc | Barclays Bank | (28.751) |
| 85.875 | Avnet Inc | Barclays Bank | 135.682 | (6.854) | B Riley Financial Inc | Goldman Sachs | (33.448) |
| 20.116 | Avnet Inc | Goldman Sachs | 13.277 | (5.910) | B Riley Financial Inc | HSBC | (31.146) |
| 7.603 | Avnet Inc | HSBC | 7.451 | (2.764) | B Riley Financial Inc | Morgan Stanley | (10.724) |
| 21.917 | Avrobio Inc | Barclays Bank | 3.296 | (59.894) | B&G Foods Inc | Bank of America | |
| 4.020 | Avrobio Inc | Goldman Sachs | 826 | | | Merrill Lynch | 91.638 |
| 18.687 | Avrobio Inc | HSBC | 3.138 | (10.595) | Babcock & Wilcox Enterprises Inc | Bank of America | |
| 22.941 | Avrobio Inc | Morgan Stanley | 3.450 | | | Merrill Lynch | (683) |
| (12.435) | Axalta Coating Systems Ltd | Bank of America | | (10.217) | Babcock & Wilcox Enterprises Inc | Barclays Bank | (3.167) |
| | | Merrill Lynch | (14.988) | (13.502) | Babcock & Wilcox Enterprises Inc | Goldman Sachs | 1.485 |
| (56.571) | Axalta Coating Systems Ltd | Barclays Bank | (64.491) | (23.223) | Babcock & Wilcox Enterprises Inc | HSBC | 3.308 |
| (32.002) | Axalta Coating Systems Ltd | Goldman Sachs | (50.563) | 5.845 | Backblaze Inc 'A' | Barclays Bank | 1.870 |
| (4.667) | Axalta Coating Systems Ltd | HSBC | (5.725) | 10.951 | Backblaze Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.190) |
| (5.019) | Axalta Coating Systems Ltd | Morgan Stanley | (5.722) | 1.448 | Backblaze Inc 'A' | HSBC | (623) |
| 2.503 | Axcelis Technologies Inc | Bank of America | | (3.646) | Backblaze Inc 'A' | Morgan Stanley | 888 |
| | | Merrill Lynch | 13.016 | | Badger Meter Inc | Bank of America | |
| 7.419 | Axcelis Technologies Inc | Goldman Sachs | 38.579 | (2.702) | Badger Meter Inc | Merrill Lynch | (1.325) |
| 7.281 | Axcelis Technologies Inc | HSBC | 51.258 | (3.300) | Badger Meter Inc | Barclays Bank | (567) |
| 544 | Axcelis Technologies Inc | Morgan Stanley | 2.464 | (5.483) | Badger Meter Inc | Goldman Sachs | (474) |
| (16.472) | Axcella Health Inc | Bank of America | | (1.283) | Baker Hughes Co | HSBC | (1.303) |
| | | Merrill Lynch | (8.895) | | | Bank of America | |
| (4.302) | Axcella Health Inc | Goldman Sachs | (2.323) | 975 | Baker Hughes Co | Merrill Lynch | (2.977) |
| (8.681) | Axis Capital Holdings Ltd | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (12.431) | (40.053) | Baker Hughes Co | Barclays Bank | (61.682) |
| (7.265) | Axis Capital Holdings Ltd | Goldman Sachs | (10.679) | 800 | Baker Hughes Co | Barclays Bank | 1.245 |
| (27.268) | Axis Capital Holdings Ltd | HSBC | (28.904) | (8.232) | Baker Hughes Co | Goldman Sachs | (19.098) |
| (4.207) | Axis Capital Holdings Ltd | Morgan Stanley | (6.226) | 14.382 | Baker Hughes Co | Goldman Sachs | 33.366 |
| 3.497 | Axogen Inc | Bank of America | | 5.501 | Baker Hughes Co | HSBC | 39.607 |
| | | Merrill Lynch | 87 | | | | |
| 8.880 | Axogen Inc | Barclays Bank | (2.886) | | | | |
| 3.986 | Axogen Inc | Goldman Sachs | 100 | | | | |
| 11.110 | Axogen Inc | HSBC | 3.277 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 2.346 | Baker Hughes Co | Morgan Stanley | 3.613 | (11.716) | Bank OZK | Bank of America | |
| (3.388) | Balchem Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (38.853) |
| | | Merrill Lynch | (22.767) | (30.261) | Bank OZK | Barclays Bank | (64.468) |
| (13.188) | Balchem Corp | Barclays Bank | (41.542) | (55.232) | Bank OZK | Goldman Sachs | (184.475) |
| (3.797) | Balchem Corp | Goldman Sachs | (24.100) | (16.617) | Bank OZK | HSBC | (32.524) |
| (814) | Balchem Corp | Morgan Stanley | (2.564) | (3.185) | Bank OZK | Morgan Stanley | (6.848) |
| (2.383) | Ball Corp | Bank of America | | 2.080 | Bank7 Corp | Barclays Bank | 978 |
| | | Merrill Lynch | (1.554) | 2.724 | Bank7 Corp | Goldman Sachs | 4.004 |
| (4.287) | Ball Corp | Barclays Bank | (2.401) | 11.171 | Bank7 Corp | HSBC | 9.160 |
| 5.008 | Ball Corp | Barclays Bank | 2.804 | 961 | Bank7 Corp | Morgan Stanley | 452 |
| (18.420) | Ball Corp | Goldman Sachs | 5.512 | 2.661 | BankFinancial Corp | Bank of America | |
| (2.076) | Ball Corp | HSBC | (3.402) | | | Merrill Lynch | 160 |
| (11.328) | Bally's Corp | Goldman Sachs | (19.824) | 57.827 | BankFinancial Corp | Goldman Sachs | 3.470 |
| (9.777) | Banc of California Inc | Bank of America | | 37.157 | BankFinancial Corp | Morgan Stanley | 1.486 |
| | | Merrill Lynch | (10.364) | (2.344) | BankUnited Inc | Bank of America | |
| (21.911) | Banc of California Inc | Barclays Bank | (11.175) | | | Merrill Lynch | (4.542) |
| (40.045) | Banc of California Inc | Goldman Sachs | (42.448) | (19.411) | BankUnited Inc | Barclays Bank | (18.440) |
| (25.192) | Banc of California Inc | HSBC | (23.177) | (42.993) | BankUnited Inc | Goldman Sachs | (136.718) |
| (18.466) | Banc of California Inc | Morgan Stanley | (9.418) | (17.043) | BankUnited Inc | HSBC | (42.149) |
| 3.484 | BancFirst Corp | Bank of America | | (1.504) | BankUnited Inc | Morgan Stanley | (1.429) |
| | | Merrill Lynch | 26.129 | (24.920) | Bankwell Financial Group Inc | Bank of America | |
| 4.117 | BancFirst Corp | Barclays Bank | 25.031 | | | Merrill Lynch | (33.891) |
| 21.088 | BancFirst Corp | Goldman Sachs | 167.001 | (1.928) | Bankwell Financial Group Inc | Barclays Bank | (2.545) |
| 1.929 | BancFirst Corp | HSBC | 14.769 | | | | |
| 8.565 | Banco Latinoamericano de Comercio Exterior SA | Barclays Bank | 6.252 | (1.183) | Bankwell Financial Group Inc | Morgan Stanley | (1.562) |
| 1.580 | Banco Latinoamericano de Comercio Exterior SA | Goldman Sachs | 1.402 | (19.939) | Banner Corp | Barclays Bank | (45.860) |
| 1.572 | Banco Latinoamericano de Comercio Exterior SA | HSBC | 1.192 | (24.115) | Banner Corp | HSBC | (61.252) |
| (3.275) | Bancorp Inc | Bank of America | | 4.699 | Bar Harbor Bankshares | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (7.919) | | | Merrill Lynch | 6.599 |
| (12.443) | Bancorp Inc | Barclays Bank | (22.895) | 26.914 | Bar Harbor Bankshares | Barclays Bank | 30.413 |
| (6.500) | Bancorp Inc | HSBC | (12.013) | 7.741 | Bar Harbor Bankshares | Goldman Sachs | 12.417 |
| (3.021) | Bancorp Inc | Morgan Stanley | (5.559) | 6.060 | Bar Harbor Bankshares | HSBC | 4.666 |
| 16.221 | Bandwidth Inc 'A' | Barclays Bank | 29.036 | 2.826 | Bar Harbor Bankshares | Morgan Stanley | 3.238 |
| 1.130 | Bandwidth Inc 'A' | Goldman Sachs | 4.735 | 26.108 | BARK Inc | Bank of America | |
| 4.737 | Bandwidth Inc 'A' | HSBC | 11.613 | | | Merrill Lynch | 3.133 |
| 3.885 | Bandwidth Inc 'A' | Morgan Stanley | 6.954 | 24.484 | BARK Inc | Barclays Bank | 5.386 |
| (8.114) | Bank First Corp | Barclays Bank | (8.641) | 6.267 | BARK Inc | HSBC | 1.065 |
| 44.264 | Bank of America Corp | Barclays Bank | 58.428 | 9.432 | BARK Inc | Morgan Stanley | 2.075 |
| 68.921 | Bank of America Corp | Goldman Sachs | 150.717 | (28.738) | Barnes & Noble Education Inc | Bank of America | |
| 82.814 | Bank of America Corp | HSBC | 68.455 | | | Merrill Lynch | (1.437) |
| 10.338 | Bank of America Corp | Morgan Stanley | 13.646 | (2.092) | Barnes & Noble Education Inc | Barclays Bank | (460) |
| 5.833 | Bank of Hawaii Corp | Bank of America | | (4.076) | Barnes & Noble Education Inc | Goldman Sachs | (204) |
| | | Merrill Lynch | 18.549 | | | | |
| 11.946 | Bank of Hawaii Corp | Barclays Bank | 15.959 | (5.090) | Barnes & Noble Education Inc | HSBC | 509 |
| 30.122 | Bank of Hawaii Corp | Goldman Sachs | 95.788 | (12.324) | Barnes & Noble Education Inc | Morgan Stanley | (2.711) |
| 11.140 | Bank of Hawaii Corp | HSBC | 36.316 | | | | |
| 20.014 | Bank of Hawaii Corp | Morgan Stanley | 29.621 | (1.635) | Barnes Group Inc | Bank of America | |
| 908 | Bank of Marin Bancorp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (3.368) |
| | | Merrill Lynch | 1.656 | (33.599) | Barnes Group Inc | Barclays Bank | (34.271) |
| 4.248 | Bank of Marin Bancorp | Barclays Bank | 4.885 | (8.417) | Barnes Group Inc | Goldman Sachs | (17.339) |
| 15.879 | Bank of Marin Bancorp | Goldman Sachs | 37.951 | (806) | Barnes Group Inc | HSBC | (2.120) |
| 1.876 | Bank of Marin Bancorp | HSBC | 3.080 | (2.139) | Barnes Group Inc | Morgan Stanley | (2.182) |
| 29.318 | Bank of New York Mellon Corp | Bank of America | | (2.442) | Barrett Business Services Inc | HSBC | 6.862 |
| | | Merrill Lynch | 84.436 | | | | |
| 14.011 | Bank of New York Mellon Corp | Barclays Bank | 20.176 | (2.141) | Bassett Furniture Industries Inc | Bank of America | |
| 28.648 | Bank of New York Mellon Corp | Barclays Bank | 20.176 | | | Merrill Lynch | (300) |
| 51.901 | Bank of New York Mellon Corp | Goldman Sachs | 82.507 | (1.624) | Bassett Furniture Industries Inc | Barclays Bank | (2.436) |
| 26.878 | Bank of New York Mellon Corp | HSBC | 151.032 | (2.188) | Bassett Furniture Industries Inc | Goldman Sachs | (306) |
| | | | | 9.071 | Bausch Health Cos Inc | Bank of America | |
| (3.469) | Bank of Princeton | Morgan Stanley | 38.704 | | | Merrill Lynch | (9.797) |
| | | Bank of America | | (5.602) | Bausch Health Cos Inc | Barclays Bank | 560 |
| | | Merrill Lynch | (4.510) | 3.075 | Bausch Health Cos Inc | Barclays Bank | (308) |
| (1.049) | Bank of Princeton | HSBC | (252) | (12.442) | Bausch Health Cos Inc | HSBC | 39.939 |
| (416) | Bank of Princeton | Morgan Stanley | (225) | 6.375 | Bausch Health Cos Inc | HSBC | (20.464) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 18.683 | Bausch Health Cos Inc | Morgan Stanley | (1.868) | 30.271 | Benchmark Electronics Inc | HSBC | 24.231 |
| 5.769 | Baxter International Inc | Barclays Bank | 12.346 | 8.031 | Benchmark Electronics Inc | Morgan Stanley | 7.951 |
| (15.466) | Baxter International Inc | Goldman Sachs | (28.148) | (20.788) | Benefitfocus Inc | Barclays Bank | (3.118) |
| 1.859 | Baxter International Inc | Goldman Sachs | 3.383 | (2.577) | Benefitfocus Inc | HSBC | (1.023) |
| (10.605) | Baxter International Inc | HSBC | (20.300) | (6.473) | Benson Hill Inc | Goldman Sachs | (1.032) |
| 3.449 | Baxter International Inc | HSBC | 6.519 | (10.723) | Benson Hill Inc | Morgan Stanley | 107 |
| (14.546) | Baxter International Inc | Morgan Stanley | (31.128) | (3.745) | Bentley Systems Inc 'B' | Bank of America | |
| 2.132 | Baxter International Inc | Morgan Stanley | 689 | | | Merrill Lynch | (9.774) |
| 7.849 | BayCom Corp | Barclays Bank | 6.711 | (35.050) | Bentley Systems Inc 'B' | Barclays Bank | (60.987) |
| 538 | BayCom Corp | Morgan Stanley | 460 | (3.133) | Bentley Systems Inc 'B' | Goldman Sachs | (8.177) |
| (5.874) | BBX Capital Corp | Goldman Sachs | (12.218) | (16.419) | Bentley Systems Inc 'B' | HSBC | 42.361 |
| (7.026) | BBX Capital Corp | HSBC | (23.888) | 7.716 | Berkeley Lights Inc | Bank of America | |
| (840) | BBX Capital Corp | Morgan Stanley | 98 | | | Merrill Lynch | 849 |
| 7.447 | BBX Capital Inc | Barclays Bank | (4.766) | 8.795 | Berkeley Lights Inc | Barclays Bank | 88 |
| (5.511) | BCB Bancorp Inc | Bank of America | | 5.157 | Berkeley Lights Inc | Goldman Sachs | 567 |
| | | Merrill Lynch | (9.534) | 22.571 | Berkeley Lights Inc | HSBC | 10.367 |
| (14.282) | BCB Bancorp Inc | Barclays Bank | (19.709) | 4.543 | Berkeley Lights Inc | Morgan Stanley | 45 |
| (11.229) | BCB Bancorp Inc | Goldman Sachs | (19.426) | 20.679 | Berkshire Grey Inc | Barclays Bank | 1.758 |
| (7.885) | BCB Bancorp Inc | HSBC | (10.904) | 7.100 | Berkshire Grey Inc | Goldman Sachs | 1.385 |
| (5.026) | BCB Bancorp Inc | Morgan Stanley | (5.506) | 4.406 | Berkshire Grey Inc | HSBC | 198 |
| (5.828) | Beacon Roofing Supply Inc | Barclays Bank | (5.420) | 262 | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Bank of America | |
| (16.200) | Beacon Roofing Supply Inc | HSBC | 18.630 | | | Merrill Lynch | 2.428 |
| 1.832 | Beam Therapeutics Inc | Bank of America | | (17.681) | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Goldman Sachs | (118.286) |
| | | Merrill Lynch | 6.320 | 4.545 | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Goldman Sachs | 31.890 |
| 1.560 | Beam Therapeutics Inc | Barclays Bank | 1.560 | 739 | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Morgan Stanley | 5.148 |
| (4.538) | Beam Therapeutics Inc | Barclays Bank | (4.538) | (15.607) | Berkshire Hills Bancorp Inc | Bank of America | |
| 1.043 | Beam Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 3.598 | | | Merrill Lynch | (10.925) |
| (826) | Beam Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (2.850) | (39.471) | Berkshire Hills Bancorp Inc | Barclays Bank | (15.394) |
| 1.968 | Beam Therapeutics Inc | HSBC | 5.314 | (43.002) | Berkshire Hills Bancorp Inc | Goldman Sachs | (30.101) |
| (296) | Beam Therapeutics Inc | HSBC | (799) | (9.917) | Berkshire Hills Bancorp Inc | HSBC | (7.041) |
| (8.394) | Beauty Health Co | Bank of America | | (2.312) | Berkshire Hills Bancorp Inc | Morgan Stanley | (902) |
| | | Merrill Lynch | (23.125) | (11.340) | Berry Corp | Barclays Bank | (4.990) |
| (1.970) | Beauty Health Co | Barclays Bank | (4.304) | (22.561) | Berry Corp | Goldman Sachs | (36.549) |
| (17.022) | Beauty Health Co | Goldman Sachs | (46.896) | (15.458) | Berry Corp | HSBC | (27.824) |
| (7.647) | Beauty Health Co | HSBC | (24.432) | (2.850) | Berry Global Group Inc | Bank of America | |
| (1.766) | Beauty Health Co | Morgan Stanley | (3.859) | | | Merrill Lynch | (7.299) |
| 11.828 | Beazer Homes USA Inc | Bank of America | | (20.119) | Berry Global Group Inc | Barclays Bank | (29.783) |
| | | Merrill Lynch | 3.380 | (8.246) | Berry Global Group Inc | Goldman Sachs | (2.253) |
| 7.784 | Beazer Homes USA Inc | Barclays Bank | 8.485 | (15.254) | Berry Global Group Inc | HSBC | (40.134) |
| 6.450 | Beazer Homes USA Inc | Goldman Sachs | 2.614 | (6.464) | Berry Global Group Inc | Morgan Stanley | (11.213) |
| 2.493 | Beazer Homes USA Inc | HSBC | 3.141 | 275 | Best Buy Co Inc | Bank of America | |
| 2.863 | Beazer Homes USA Inc | Morgan Stanley | 3.121 | | | Merrill Lynch | 3.130 |
| (2.743) | Becton Dickinson and Co | Bank of America | | 5.506 | Best Buy Co Inc | Barclays Bank | 54.950 |
| | | Merrill Lynch | 3.257 | 14.687 | Best Buy Co Inc | Goldman Sachs | (32.311) |
| (8.737) | Becton Dickinson and Co | Barclays Bank | 35.734 | 1.708 | Best Buy Co Inc | Morgan Stanley | 17.046 |
| (1.047) | Becton Dickinson and Co | Goldman Sachs | (669) | (6.689) | Beyond Air Inc | HSBC | (3.947) |
| (8.367) | Becton Dickinson and Co | HSBC | (5.940) | 4.712 | Beyond Meat Inc | Bank of America | |
| (3.629) | Becton Dickinson and Co | Morgan Stanley | 14.842 | | | Merrill Lynch | 907 |
| (11.242) | Bed Bath & Beyond Inc | Bank of America | | 9.383 | Beyond Meat Inc | Barclays Bank | 25.240 |
| | | Merrill Lynch | 6.071 | 7.486 | Beyond Meat Inc | Goldman Sachs | 898 |
| (5.697) | Bed Bath & Beyond Inc | Barclays Bank | (3.019) | 6.582 | Beyond Meat Inc | HSBC | (11.297) |
| (1.767) | Bed Bath & Beyond Inc | Goldman Sachs | 954 | 11.304 | Beyond Meat Inc | Morgan Stanley | 30.407 |
| 19.805 | Bel Fuse Inc 'B' | Barclays Bank | 5.149 | 17.909 | Beyondspring Inc | Barclays Bank | 179 |
| 17.475 | Bel Fuse Inc 'B' | Goldman Sachs | (6.641) | 5.487 | Beyondspring Inc | Goldman Sachs | 165 |
| 3.303 | Bel Fuse Inc 'B' | HSBC | (3.072) | 4.613 | Beyondspring Inc | HSBC | (876) |
| 987 | Belden Inc | Bank of America | | (8.005) | BGC Partners Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.961 | | | Merrill Lynch | (961) |
| 9.750 | Belden Inc | Barclays Bank | 23.497 | (106.386) | BGC Partners Inc 'A' | Barclays Bank | (12.766) |
| 2.375 | Belden Inc | Goldman Sachs | 4.993 | (249.208) | BGC Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | (29.905) |
| 1.262 | Belden Inc | HSBC | 1.527 | (51.202) | BGC Partners Inc 'A' | HSBC | (2.048) |
| 3.953 | Belden Inc | Morgan Stanley | 10.491 | (115.897) | BGC Partners Inc 'A' | Morgan Stanley | (13.908) |
| (40.125) | Bellring Distribution LLC | Barclays Bank | 12.438 | (54.650) | BGSF Inc | Bank of America | |
| (5.950) | Bellring Distribution LLC | Goldman Sachs | (7.735) | | | Merrill Lynch | (13.663) |
| (701) | Bellring Distribution LLC | HSBC | (547) | (17.150) | BGSF Inc | Barclays Bank | (3.945) |
| (6.983) | Bellring Distribution LLC | Morgan Stanley | 2.165 | (4.705) | BGSF Inc | Goldman Sachs | (1.176) |
| 4.239 | Benchmark Electronics Inc | Bank of America | | 5.570 | Big 5 Sporting Goods Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 4.154 | | | Merrill Lynch | (1.727) |
| 31.592 | Benchmark Electronics Inc | Barclays Bank | 31.276 | 6.664 | Big 5 Sporting Goods Corp | Barclays Bank | 5.531 |
| 34.976 | Benchmark Electronics Inc | Goldman Sachs | 34.276 | 1.461 | Big 5 Sporting Goods Corp | Goldman Sachs | (453) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.410 | Big 5 Sporting Goods Corp | Morgan Stanley | 1.170 | (4.076) | Bionano Genomics Inc | HSBC | (1.345) |
| 4.658 | Big Lots Inc | Bank of America | | (6.911) | Bionano Genomics Inc | Morgan Stanley | (898) |
| | | Merrill Lynch | (33.351) | 878 | BioNTech SE ADR | Morgan Stanley | 1.826 |
| 37 | Big Lots Inc | Barclays Bank | (60) | (573) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Bank of America | |
| 5.122 | Big Lots Inc | Goldman Sachs | (36.674) | | | Merrill Lynch | (14.693) |
| 7.783 | Big Lots Inc | HSBC | (68.179) | (969) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Barclays Bank | (9.826) |
| 1.347 | Big Lots Inc | Morgan Stanley | (2.169) | (890) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Goldman Sachs | (25.695) |
| 623 | BigCommerce Holdings Inc | Bank of America | | (349) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | HSBC | (17.781) |
| | | Merrill Lynch | 841 | (1.117) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Morgan Stanley | (9.369) |
| (3.464) | BigCommerce Holdings Inc | Bank of America | | (16.107) | BioSig Technologies Inc | Barclays Bank | (322) |
| | | Merrill Lynch | (4.676) | (408) | Bio-Techne Corp | Bank of America | |
| 876 | BigCommerce Holdings Inc | Barclays Bank | 929 | | | Merrill Lynch | (5.794) |
| 614 | BigCommerce Holdings Inc | HSBC | 1.639 | (2.943) | Bio-Techne Corp | Barclays Bank | (34.786) |
| (16.571) | BigCommerce Holdings Inc | HSBC | (50.404) | (800) | Bio-Techne Corp | Goldman Sachs | (11.360) |
| 73 | Biglari Holdings Inc 'A' | Bank of America | | (1.644) | Bio-Techne Corp | HSBC | (48.120) |
| | | Merrill Lynch | (3.929) | (2.416) | Bio-Techne Corp | Morgan Stanley | (28.557) |
| 6 | Biglari Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | 128 | (5.857) | Bioventus Inc | Bank of America | |
| 137 | Biglari Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (7.227) | | | Merrill Lynch | (6.501) |
| 51 | Biglari Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.088 | (18.871) | Bioventus Inc | Barclays Bank | (13.776) |
| 1.116 | Biglari Holdings Inc 'B' | Barclays Bank | 3.404 | (2.618) | Bioventus Inc | HSBC | (3.691) |
| (4.591) | Bill.com Holdings Inc | Barclays Bank | (28.924) | (7.232) | Bioventus Inc | Morgan Stanley | (5.279) |
| (1.956) | Bill.com Holdings Inc | Goldman Sachs | (22.611) | (5.312) | Bioxcel Therapeutics Inc | Barclays Bank | 6.640 |
| (2.623) | Bill.com Holdings Inc | HSBC | (34.230) | 3.649 | BJ's Restaurants Inc | Bank of America | |
| 9.449 | BioAtla Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 7.006 |
| | | Merrill Lynch | 1.039 | 6.955 | BJ's Restaurants Inc | Barclays Bank | 20.239 |
| 1.395 | BioAtla Inc | Barclays Bank | 279 | 1.565 | BJ's Restaurants Inc | Goldman Sachs | 3.005 |
| 26.513 | BioAtla Inc | Goldman Sachs | 2.916 | 20.226 | BJ's Restaurants Inc | HSBC | 23.868 |
| 18.238 | BioAtla Inc | HSBC | 4.742 | (1.931) | BJ's Wholesale Club | | |
| 9.922 | BioAtla Inc | Morgan Stanley | 1.984 | | Holdings Inc | Barclays Bank | (5.523) |
| (514) | BioCryst | Bank of America | | 6.364 | BJ's Wholesale Club | | |
| | Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | (529) | | Holdings Inc | Barclays Bank | 18.201 |
| (5.945) | BioCryst | | | (5.261) | BJ's Wholesale Club | | |
| | Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (3.745) | | Holdings Inc | Goldman Sachs | (21.678) |
| (24.016) | BioCryst | | | 14.802 | BJ's Wholesale Club | | |
| | Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (24.736) | | Holdings Inc | Goldman Sachs | (84.764) |
| (17.167) | BioCryst | | | 4.579 | BJ's Wholesale Club | | |
| | Pharmaceuticals Inc | HSBC | (19.914) | | Holdings Inc | HSBC | (5.363) |
| 6.420 | Biodesix Inc | Goldman Sachs | (1.284) | (2.819) | BJ's Wholesale Club | | |
| 577 | Biogen Inc | Bank of America | | | Holdings Inc | Morgan Stanley | (7.470) |
| | | Merrill Lynch | 1.329 | 3.066 | BJ's Wholesale Club | | |
| 4.970 | Biogen Inc | Barclays Bank | 14.115 | | Holdings Inc | Morgan Stanley | 8.769 |
| 3.255 | Biogen Inc | Goldman Sachs | 12.564 | 6.078 | Black Diamond | Bank of America | |
| 3.062 | Biogen Inc | HSBC | 30.523 | | Therapeutics Inc | Merrill Lynch | (1.155) |
| 944 | Biogen Inc | Morgan Stanley | 2.681 | 21.992 | Black Diamond | | |
| (756) | Biohaven Pharmaceutical | | | | Therapeutics Inc | Barclays Bank | 220 |
| | Holding Co Ltd | Barclays Bank | 106 | 36.509 | Black Diamond | | |
| (798) | Biohaven Pharmaceutical | | | | Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (6.937) |
| | Holding Co Ltd | HSBC | (47.657) | 26.036 | Black Diamond | | |
| (2.589) | BioLife Solutions Inc | Bank of America | | | Therapeutics Inc | HSBC | (6.769) |
| | | Merrill Lynch | (3.858) | 10.258 | Black Diamond | | |
| (10.634) | BioLife Solutions Inc | Barclays Bank | (12.335) | | Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 103 |
| (6.213) | BioLife Solutions Inc | Goldman Sachs | (9.257) | 17.030 | Black Hills Corp | Bank of America | |
| (9.030) | BioLife Solutions Inc | HSBC | (29.980) | | | Merrill Lynch | (4.087) |
| 2.432 | BioMarin | Bank of America | | 47.058 | Black Hills Corp | Barclays Bank | 95.528 |
| | Pharmaceutical Inc | Merrill Lynch | (1.143) | 147.618 | Black Hills Corp | Goldman Sachs | (29.569) |
| 636 | BioMarin | | | 31.929 | Black Hills Corp | HSBC | 17.424 |
| | Pharmaceutical Inc | Barclays Bank | (2.232) | 12.340 | Black Hills Corp | Morgan Stanley | 25.050 |
| (3.648) | BioMarin | | | (4.399) | Black Knight Inc | Barclays Bank | 14.429 |
| | Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs | 1.715 | (6.547) | Black Knight Inc | Morgan Stanley | 21.474 |
| 4.726 | BioMarin | | | (1.793) | Blackbaud Inc | Bank of America | |
| | Pharmaceutical Inc | HSBC | 6.599 | | | Merrill Lynch | (9.575) |
| 2.461 | BioMarin | | | (13.830) | Blackbaud Inc | Barclays Bank | (13.277) |
| | Pharmaceutical Inc | Morgan Stanley | (8.638) | (5.250) | Blackbaud Inc | Goldman Sachs | (23.735) |
| 2.783 | Biomea Fusion Inc | Bank of America | | (1.813) | Blackbaud Inc | HSBC | (18.521) |
| | | Merrill Lynch | 4.982 | (7.277) | Blackline Inc | Barclays Bank | (11.135) |
| 963 | Biomea Fusion Inc | Barclays Bank | (58) | 5.981 | Blackline Inc | Barclays Bank | 9.749 |
| 3.315 | Biomea Fusion Inc | Goldman Sachs | 5.934 | (2.871) | Blackline Inc | Goldman Sachs | (39.505) |
| 7.969 | Biomea Fusion Inc | Morgan Stanley | (478) | 8.413 | Blackline Inc | HSBC | 149.290 |
| (81.676) | Bionano Genomics Inc | Barclays Bank | (10.618) | 1.716 | Blackline Inc | Morgan Stanley | 2.797 |
| (8.503) | Bionano Genomics Inc | Goldman Sachs | (1.105) | (707) | Blackline Inc | Morgan Stanley | (1.152) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.389 | Blackstone Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 18.238 | 351 | Blue Ridge Bankshares Inc | Goldman Sachs | 407 |
| 3.277 | Blackstone Group Inc 'A' | Barclays Bank | 30.738 | (10.486) | Bluebird Bio Inc | Barclays Bank | (839) |
| 1.430 | Blackstone Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 19.322 | (12.601) | Bluebird Bio Inc | Goldman Sachs | 1.386 |
| 831 | Blackstone Group Inc 'A' | HSBC | 17.592 | (102) | BlueLinx Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 763 |
| (38.005) | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (22.423) | (1.113) | BlueLinx Holdings Inc | Barclays Bank | 1.992 |
| 5.460 | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 2.204 | (589) | BlueLinx Holdings Inc | HSBC | 7.044 |
| (17.484) | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | Barclays Bank | (14.998) | 775 | Blueprint Medicines Corp | Bank of America Merrill Lynch | (868) |
| 40.432 | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | Barclays Bank | 38.122 | 15.943 | Blueprint Medicines Corp | Barclays Bank | (29.016) |
| (27.389) | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (16.576) | 13.366 | Blueprint Medicines Corp | Goldman Sachs | (14.342) |
| 18.623 | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | Goldman Sachs | 10.988 | 18.068 | Blueprint Medicines Corp | HSBC | 57.581 |
| (55.910) | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | HSBC | (71.653) | 9.826 | Blueprint Medicines Corp | Morgan Stanley | (17.883) |
| 1.636 | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | HSBC | 2.192 | 523 | BM Technologies Inc | Barclays Bank | 89 |
| (12.723) | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | Morgan Stanley | (12.328) | 2.085 | Boeing Co | Bank of America Merrill Lynch | 1.626 |
| 11.933 | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | Morgan Stanley | 11.336 | 2.431 | Boeing Co | Barclays Bank | 14.659 |
| 2.930 | Blade Air Mobility Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.289 | 14.321 | Boeing Co | Goldman Sachs | 123.838 |
| 11.995 | Blade Air Mobility Inc | Barclays Bank | (5.158) | 2.461 | Boeing Co | HSBC | 13.120 |
| 3.120 | Blade Air Mobility Inc | Goldman Sachs | 1.373 | 500 | Boeing Co | Morgan Stanley | 3.015 |
| 3.706 | Blade Air Mobility Inc | HSBC | 1.779 | (7.471) | Bogota Financial Corp | Barclays Bank | (3.325) |
| 1.211 | Block Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9.749 | 1.546 | Boise Cascade Co | Barclays Bank | 2.505 |
| (1.004) | Block Inc | Barclays Bank | (4.367) | 11.818 | Boise Cascade Co | Goldman Sachs | (6.500) |
| 982 | Block Inc | Goldman Sachs | 7.209 | (2.822) | BOK Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3.960) |
| (898) | Block Inc | Goldman Sachs | (4.169) | (3.415) | BOK Financial Corp | Barclays Bank | (4.137) |
| 1.073 | Block Inc | HSBC | 6.735 | (3.443) | BOK Financial Corp | Goldman Sachs | (4.762) |
| (1.423) | Block Inc | HSBC | (14.353) | (9.955) | BOK Financial Corp | HSBC | 873 |
| 6.996 | Block Inc | Morgan Stanley | 32.410 | (3.973) | BOK Financial Corp | Morgan Stanley | (5.245) |
| 4.091 | Bloom Energy Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 16.487 | 170 | Bolt Biotherapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 32 |
| (4.215) | Bloom Energy Corp 'A' | Barclays Bank | (8.472) | 139 | Bolt Biotherapeutics Inc | Barclays Bank | 25 |
| 17.800 | Bloom Energy Corp 'A' | Barclays Bank | 35.778 | 945 | Bolt Biotherapeutics Inc | HSBC | 161 |
| 5.152 | Bloom Energy Corp 'A' | Goldman Sachs | 20.763 | (185) | Booking Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (32.743) |
| 1.103 | Bloom Energy Corp 'A' | HSBC | 4.722 | 118 | Booking Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 17.886 |
| 7.214 | Bloom Energy Corp 'A' | Morgan Stanley | 14.500 | 93 | Booking Holdings Inc | Barclays Bank | 10.821 |
| 11.380 | Bloomin' Brands Inc | Barclays Bank | 21.963 | (157) | Booking Holdings Inc | Goldman Sachs | (27.787) |
| 33.863 | Bloomin' Brands Inc | Goldman Sachs | 2.709 | 94 | Booking Holdings Inc | Goldman Sachs | 16.637 |
| 11.642 | Bloomin' Brands Inc | HSBC | 4.540 | (195) | Booking Holdings Inc | HSBC | (38.889) |
| (26.473) | Blucora Inc | Barclays Bank | (31.701) | 240 | Booking Holdings Inc | HSBC | 47.863 |
| (19.024) | Blucora Inc | Goldman Sachs | (23.970) | (165) | Booking Holdings Inc | Morgan Stanley | (19.198) |
| (8.727) | Blucora Inc | HSBC | (15.447) | (4.394) | Boot Barn Holdings Inc | Barclays Bank | (30.890) |
| (13.489) | Blue Apron Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 4.451 | (1.961) | Boot Barn Holdings Inc | Goldman Sachs | 26.826 |
| (5.452) | Blue Apron Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (545) | (2.686) | Boot Barn Holdings Inc | HSBC | 23.510 |
| (4.942) | Blue Apron Holdings Inc 'A' | HSBC | 198 | 2.191 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | 6.770 |
| (24.191) | Blue Bird Corp | Barclays Bank | 726 | 24.409 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Goldman Sachs | 95.030 |
| (11.951) | Blue Bird Corp | Goldman Sachs | (3.705) | 8.593 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | HSBC | 35.911 |
| (9.288) | Blue Foundry Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (4.365) | 12.298 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Morgan Stanley | 51.898 |
| (61.189) | Blue Foundry Bancorp | Barclays Bank | (6.119) | 10.786 | BorgWarner Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12.702 |
| (18.568) | Blue Foundry Bancorp | Goldman Sachs | (8.727) | 57.168 | BorgWarner Inc | Barclays Bank | 82.894 |
| (16.775) | Blue Foundry Bancorp | HSBC | 2.013 | 13.758 | BorgWarner Inc | Goldman Sachs | 30.268 |
| (14.342) | Blue Foundry Bancorp | Morgan Stanley | (1.434) | 1.285 | BorgWarner Inc | HSBC | 1.786 |
| (43.183) | Blue Owl Capital Inc | Bank of America Merrill Lynch | (54.843) | 828 | BorgWarner Inc | Morgan Stanley | (9) |
| (19.633) | Blue Owl Capital Inc | Barclays Bank | (12.172) | (139) | Boston Beer Co Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 253 |
| (49.252) | Blue Owl Capital Inc | Goldman Sachs | (62.550) | 296 | Boston Beer Co Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 3.335 |
| (10.850) | Blue Owl Capital Inc | HSBC | (10.416) | (296) | Boston Beer Co Inc 'A' | Barclays Bank | (6.281) |
| (57.570) | Blue Owl Capital Inc | Morgan Stanley | (35.693) | 610 | Boston Beer Co Inc 'A' | Barclays Bank | 12.944 |
| 5.073 | Blue Ridge Bankshares Inc | Barclays Bank | 4.972 | (380) | Boston Beer Co Inc 'A' | HSBC | (3.060) |
| | | | | 246 | Boston Beer Co Inc 'A' | HSBC | (1.552) |
| | | | | (302) | Boston Beer Co Inc 'A' | Morgan Stanley | (6.408) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 604 | Boston Beer Co Inc 'A' | Morgan Stanley | 12.817 | 49.827 | Brandywine Realty Trust (REIT) | Goldman Sachs | 14.450 |
| (1.105) | Boston Omaha Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.276) | 5.141 | Brandywine Realty Trust (REIT) | Morgan Stanley | 1.594 |
| (1.895) | Boston Omaha Corp 'A' | Barclays Bank | (3.089) | (6.399) | Braze Inc 'A' | Goldman Sachs | (8.767) |
| (972) | Boston Omaha Corp 'A' | HSBC | (2.051) | (7.755) | Braze Inc 'A' | HSBC | (9.151) |
| (12.645) | Boston Omaha Corp 'A' | Morgan Stanley | (20.611) | (7.864) | Braze Inc 'A' | Morgan Stanley | (11.560) |
| (3.667) | Boston Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 340 | (3.296) | Bread Financial Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (14.469) |
| (6.382) | Boston Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (36.122) | (7.847) | Bread Financial Holdings Inc | Barclays Bank | (33.742) |
| (10.164) | Boston Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 15.150 | (6.112) | Bread Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | (26.832) |
| (25.087) | Boston Properties Inc (REIT) | HSBC | 51.020 | (3.091) | Bread Financial Holdings Inc | HSBC | (16.533) |
| (3.448) | Boston Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (19.516) | (3.306) | Bread Financial Holdings Inc | Morgan Stanley | (14.216) |
| 2.891 | Boston Scientific Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.440 | 11.273 | Bridgebio Pharma Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.382 |
| 14.196 | Boston Scientific Corp | Barclays Bank | 15.900 | 24.188 | Bridgebio Pharma Inc | Barclays Bank | (7.256) |
| 49.897 | Boston Scientific Corp | Goldman Sachs | 46.495 | 29.921 | Bridgebio Pharma Inc | Goldman Sachs | 8.976 |
| 54.997 | Boston Scientific Corp | HSBC | 140.519 | 17.772 | Bridgebio Pharma Inc | HSBC | 25.860 |
| 68.182 | Boston Scientific Corp | Morgan Stanley | 76.364 | (15.217) | Bridgewater Bancshares Inc | Barclays Bank | (6.628) |
| 17.299 | Bowlero Corp | Goldman Sachs | 3.806 | (5.618) | Bridgewater Bancshares Inc | Goldman Sachs | (3.095) |
| 20.719 | Bowlero Corp | HSBC | 37.107 | (6.755) | Bridgewater Bancshares Inc | HSBC | (68) |
| 6.866 | Bowlero Corp | Morgan Stanley | 206 | (12.694) | Bridgewater Bancshares Inc | Morgan Stanley | (4.297) |
| (1.150) | Bowman Consulting Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.564 | (262) | Bridgford Foods Corp | Bank of America Merrill Lynch | 139 |
| 12.358 | Box Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (19.649) | (6.472) | Bridgford Foods Corp | Barclays Bank | (453) |
| (3.006) | Box Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 4.780 | (3.165) | Bridgford Foods Corp | Goldman Sachs | 1.677 |
| 27.649 | Box Inc 'A' | Barclays Bank | 4.701 | (299) | Bridgford Foods Corp | HSBC | 132 |
| (4.090) | Box Inc 'A' | Barclays Bank | (695) | (826) | Bridgford Foods Corp | Morgan Stanley | (58) |
| 20.041 | Box Inc 'A' | Goldman Sachs | (17.442) | 3.518 | Briggs & Stratton Corp** | Barclays Bank | — |
| (2.751) | Box Inc 'A' | Goldman Sachs | 4.374 | 32.162 | Briggs & Stratton Corp* | Goldman Sachs | (32) |
| 7.360 | Box Inc 'A' | HSBC | (8.682) | (31.415) | Brigham Minerals Inc 'A' | Barclays Bank | (98.329) |
| (8.046) | Box Inc 'A' | HSBC | 19.713 | (12.235) | Brigham Minerals Inc 'A' | Goldman Sachs | (36.950) |
| 7.044 | Box Inc 'A' | Morgan Stanley | 544 | (6.932) | Brigham Minerals Inc 'A' | HSBC | (36.809) |
| (708) | Boyd Gaming Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.577) | (4.055) | Brigham Minerals Inc 'A' | Morgan Stanley | (12.692) |
| 3.806 | Boyd Gaming Corp | Barclays Bank | 17.809 | 45.930 | Bright Health Group Inc | Goldman Sachs | (7.578) |
| (1.620) | Boyd Gaming Corp | Barclays Bank | (6.448) | 49 | Bright Health Group Inc | HSBC | (18) |
| 12.552 | Boyd Gaming Corp | Goldman Sachs | 45.689 | (892) | Bright Horizons Family Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (9.705) |
| (7.478) | Boyd Gaming Corp | Goldman Sachs | (27.220) | (633) | Bright Horizons Family Solutions Inc | Barclays Bank | (1.260) |
| 8.667 | Boyd Gaming Corp | HSBC | 32.068 | (2.552) | Bright Horizons Family Solutions Inc | Goldman Sachs | (27.766) |
| (6.818) | Boyd Gaming Corp | HSBC | (20.628) | (3.504) | Bright Horizons Family Solutions Inc | HSBC | (32.220) |
| (2.718) | Boyd Gaming Corp | Morgan Stanley | (10.818) | (2.954) | Bright Horizons Family Solutions Inc | Morgan Stanley | (5.699) |
| 2.044 | Brady Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 3.969 | (10.844) | Brightcove Inc | Barclays Bank | (2.060) |
| 7.483 | Brady Corp 'A' | Barclays Bank | 26.265 | (21.612) | Brightcove Inc | Goldman Sachs | (3.242) |
| 10.681 | Brady Corp 'A' | Goldman Sachs | 41.164 | (10.053) | Brightcove Inc | HSBC | (1.005) |
| 1.842 | Brady Corp 'A' | HSBC | 8.180 | (4.763) | Brightcove Inc | Morgan Stanley | (905) |
| 1.406 | Brady Corp 'A' | Morgan Stanley | 4.935 | 11.425 | Brighthouse Financial Inc | Barclays Bank | 29.705 |
| 14.668 | Braemar Hotels & Resorts Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 2.347 | (5.273) | Brighthouse Financial Inc | Barclays Bank | (13.710) |
| 52.585 | Braemar Hotels & Resorts Inc (REIT) | Barclays Bank | 22.612 | 1.416 | Brighthouse Financial Inc | Goldman Sachs | 3.823 |
| 42.107 | Braemar Hotels & Resorts Inc (REIT) | Goldman Sachs | 6.737 | 18.472 | Brighthouse Financial Inc | HSBC | (38.237) |
| 63.919 | Braemar Hotels & Resorts Inc (REIT) | HSBC | 7.670 | (2.437) | Brighthouse Financial Inc | Morgan Stanley | (6.336) |
| (57.881) | BrainStorm Cell Therapeutics Inc | Barclays Bank | (4.052) | (33.806) | BrightSphere Investment Group Inc | Goldman Sachs | (18.118) |
| (8.367) | BrainStorm Cell Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.422) | (1.563) | BrightSphere Investment Group Inc | HSBC | (877) |
| 5.282 | Brandywine Realty Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.532 | (3.968) | BrightSphere Investment Group Inc | Morgan Stanley | (873) |
| 90.941 | Brandywine Realty Trust (REIT) | Barclays Bank | 28.192 | (3.288) | BrightSpire Capital Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (2.323) |
| | | | | (21.853) | BrightSpire Capital Inc (REIT) | Barclays Bank | (8.960) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (55.132) | BrightSpire Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | (19.848) | (2.862) | Broadstone Net Lease Inc (REIT) | Morgan Stanley | 461 |
| (32.531) | BrightSpire Capital Inc (REIT) | HSBC | (26.350) | 8.340 | Broadway Gold Mining Ltd | HSBC | 530 |
| (18.532) | BrightSpire Capital Inc (REIT) | Morgan Stanley | (7.598) | 27.995 | Broadway Gold Mining Ltd | Morgan Stanley | 2.402 |
| 9.690 | BrightView Holdings Inc | Barclays Bank | 9.109 | (33.181) | Brookdale Senior Living Inc | Morgan Stanley | (8.959) |
| 20.691 | BrightView Holdings Inc | Goldman Sachs | 17.380 | 2.111 | Brookfield Infrastructure Corp 'A' | Bank of America | |
| 2.350 | Brilliant Earth Group Inc 'A' | Bank of America | | | Brookfield Infrastructure Corp 'A' | Merrill Lynch | 1.034 |
| | | Merrill Lynch | 870 | 11.473 | Brookfield Infrastructure Corp 'A' | Barclays Bank | (34.993) |
| 2.133 | Brilliant Earth Group Inc 'A' | HSBC | (5.994) | 8.438 | Brookfield Infrastructure Corp 'A' | Goldman Sachs | 4.135 |
| (9.587) | Brinker International Inc | Bank of America | | 7.289 | Brookfield Infrastructure Corp 'A' | HSBC | 15.526 |
| | | Merrill Lynch | 16.873 | 23.623 | Brookfield Renewable Corp 'A' | Barclays Bank | (6.142) |
| (4.677) | Brinker International Inc | Barclays Bank | (16.182) | 35.127 | Brookfield Renewable Corp 'A' | HSBC | 70.605 |
| (4.125) | Brinker International Inc | Goldman Sachs | 7.260 | 3.988 | Brookfield Renewable Corp 'A' | Morgan Stanley | (1.037) |
| (6.833) | Brinker International Inc | HSBC | 10.083 | (4.204) | Brookline Bancorp Inc | Bank of America | |
| (510) | Brink's Co | Bank of America | | | Brookline Bancorp Inc | Merrill Lynch | (1.423) |
| | | Merrill Lynch | (2.004) | (19.889) | Brookline Bancorp Inc | Barclays Bank | 12.530 |
| (6.088) | Brink's Co | Barclays Bank | (15.159) | (16.774) | Brookline Bancorp Inc | HSBC | 2.355 |
| (9.513) | Brink's Co | Goldman Sachs | (37.386) | (4.511) | Brookline Bancorp Inc | Morgan Stanley | 1.681 |
| (11.267) | Brink's Co | HSBC | (42.232) | (9.638) | Brown & Brown Inc | Bank of America | |
| (3.136) | Bristol-Myers Squibb Co | Bank of America | | | Brown & Brown Inc | Merrill Lynch | (13.493) |
| | | Merrill Lynch | 8.467 | 8.149 | Brown & Brown Inc | Barclays Bank | 23.551 |
| (1.881) | Bristol-Myers Squibb Co | Barclays Bank | 4.684 | (13.414) | Brown & Brown Inc | Barclays Bank | (38.766) |
| (18.249) | Bristol-Myers Squibb Co | Goldman Sachs | 49.268 | 15.322 | Brown & Brown Inc | Goldman Sachs | 21.451 |
| (30.047) | Bristol-Myers Squibb Co | HSBC | 61.708 | (5.037) | Brown & Brown Inc | Goldman Sachs | (3.503) |
| (10.181) | Bristol-Myers Squibb Co | Morgan Stanley | 25.351 | 8.270 | Brown & Brown Inc | HSBC | 18.856 |
| (10.423) | Bristow Group Inc | Barclays Bank | (23.660) | 2.721 | Brown & Brown Inc | Morgan Stanley | 7.864 |
| (6.993) | Bristow Group Inc | Goldman Sachs | (18.182) | (2.717) | Brown & Brown Inc | Morgan Stanley | (7.852) |
| 6.014 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | Bank of America | | 5.299 | Brown-Forman Corp 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.827 | | Brown-Forman Corp 'A' | Merrill Lynch | (3.868) |
| 117.635 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | Barclays Bank | 215.272 | 8.392 | Brown-Forman Corp 'A' | Barclays Bank | 20.493 |
| 108.456 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | Goldman Sachs | 50.974 | 8.105 | Brown-Forman Corp 'A' | Goldman Sachs | (4.791) |
| 90.899 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | HSBC | 85.445 | 18.139 | Brown-Forman Corp 'A' | HSBC | 32.604 |
| 25.016 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | Morgan Stanley | 45.779 | 15.091 | Brown-Forman Corp 'A' | Morgan Stanley | 37.483 |
| (5.678) | Broadcom Inc | Goldman Sachs | 19.192 | 20.496 | Brown-Forman Corp 'B' | Bank of America | |
| (1.558) | Broadcom Inc | HSBC | 4.319 | | Brown-Forman Corp 'B' | Merrill Lynch | (19.269) |
| (1.178) | Broadcom Inc | Morgan Stanley | (62.352) | 30.721 | Brown-Forman Corp 'B' | Barclays Bank | 72.194 |
| 45.255 | Broadmark Realty Capital Inc (REIT) | Bank of America | | 72.203 | Brown-Forman Corp 'B' | Goldman Sachs | (89.481) |
| | | Merrill Lynch | (2.282) | 30.186 | Brown-Forman Corp 'B' | HSBC | 25.960 |
| 86.470 | Broadmark Realty Capital Inc (REIT) | Barclays Bank | 12.106 | (11.623) | BRP Group Inc 'A' | Barclays Bank | (23.478) |
| 21.654 | Broadmark Realty Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.697 | (8.229) | BRP Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (22.301) |
| 32.462 | Broadmark Realty Capital Inc (REIT) | HSBC | 7.497 | (8.309) | BRP Group Inc 'A' | HSBC | (11.716) |
| 8.599 | Broadmark Realty Capital Inc (REIT) | Morgan Stanley | (213) | 22.177 | BRT Apartments Corp (REIT) | Goldman Sachs | 41.249 |
| 3.141 | Broadridge Financial Solutions Inc | Bank of America | | 3.579 | BRT Apartments Corp (REIT) | Morgan Stanley | 6.800 |
| | | Merrill Lynch | 20.129 | 10.642 | Bruker Corp | Bank of America | |
| 7.722 | Broadridge Financial Solutions Inc | Barclays Bank | 39.536 | | Bruker Corp | Merrill Lynch | 31.713 |
| 13.249 | Broadridge Financial Solutions Inc | Goldman Sachs | 84.602 | 8.090 | Bruker Corp | Barclays Bank | 15.128 |
| 8.876 | Broadridge Financial Solutions Inc | HSBC | 67.720 | 23.584 | Bruker Corp | Goldman Sachs | 70.280 |
| 254 | Broadridge Financial Solutions Inc | Morgan Stanley | 1.300 | 13.360 | Bruker Corp | HSBC | 65.063 |
| (9.973) | Broadstone Net Lease Inc (REIT) | Bank of America | | 12.488 | Bruker Corp | Morgan Stanley | 23.353 |
| | | Merrill Lynch | (5.485) | 1.231 | Brunswick Corp | Bank of America | |
| (30.632) | Broadstone Net Lease Inc (REIT) | Barclays Bank | (15.010) | 1.092 | Brunswick Corp | Merrill Lynch | 4.659 |
| (32.411) | Broadstone Net Lease Inc (REIT) | Goldman Sachs | (17.826) | (9.623) | Brunswick Corp | Barclays Bank | 3.877 |
| (57.198) | Broadstone Net Lease Inc (REIT) | HSBC | (64.998) | (9.126) | Brunswick Corp | Barclays Bank | (34.162) |
| | | | | 443 | Brunswick Corp | Goldman Sachs | 13.780 |
| | | | | (3.675) | Brunswick Corp | HSBC | (2.162) |
| | | | | 2.620 | Brunswick Corp | HSBC | 17.332 |
| | | | | (334) | Brunswick Corp | Morgan Stanley | 9.301 |
| | | | | 49.417 | BTRS Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.186) |
| | | | | 29.693 | BTRS Holdings Inc | Barclays Bank | 15.813 |
| | | | | 17.564 | BTRS Holdings Inc | Goldman Sachs | 12.174 |
| | | | | | BTRS Holdings Inc | HSBC | (6.850) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|-----------------|---|---|--------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 9.010 | Buckle Inc | Bank of America | | 325 | Cable One Inc | Morgan Stanley | 22.383 |
| | | Merrill Lynch | 6.353 | 3.724 | Cabot Corp | Bank of America | |
| 9.595 | Buckle Inc | Barclays Bank | 27.993 | | | Merrill Lynch | 28.712 |
| 10.117 | Buckle Inc | Goldman Sachs | (3.237) | 14.969 | Cabot Corp | Barclays Bank | 97.149 |
| 2.117 | Buckle Inc | HSBC | 6.550 | 3.879 | Cabot Corp | Goldman Sachs | 29.907 |
| 2.124 | Buckle Inc | Morgan Stanley | 6.245 | 11.869 | Cabot Corp | HSBC | 128.304 |
| (1.098) | Build-A-Bear Workshop Inc | Barclays Bank | (2.163) | 3.600 | CACI International Inc 'A' | Bank of America | |
| (6.620) | Build-A-Bear Workshop Inc | Goldman Sachs | (7.745) | | | Merrill Lynch | 61.056 |
| (8.503) | Build-A-Bear Workshop Inc | HSBC | (20.266) | 2.516 | CACI International Inc 'A' | Barclays Bank | 36.859 |
| 20.088 | Builders FirstSource Inc | Barclays Bank | 60.690 | 1.918 | CACI International Inc 'A' | Goldman Sachs | 32.529 |
| 23.803 | Builders FirstSource Inc | Goldman Sachs | (23.499) | 2.772 | CACI International Inc 'A' | HSBC | 58.349 |
| 2.833 | Builders FirstSource Inc | HSBC | 2.040 | 1.717 | CACI International Inc 'A' | Morgan Stanley | 25.154 |
| 10.142 | Builders FirstSource Inc | Morgan Stanley | 30.122 | (600) | Cactus Inc 'A' | Bank of America | |
| (6.534) | Bumble Inc 'A' | Barclays Bank | (3.398) | | | Merrill Lynch | (4.645) |
| (4.922) | Bumble Inc 'A' | Goldman Sachs | (11.075) | (6.041) | Cactus Inc 'A' | Barclays Bank | (27.970) |
| 2.813 | Bumble Inc 'A' | HSBC | 23.629 | (8.207) | Cactus Inc 'A' | Goldman Sachs | (49.062) |
| 4.045 | Bunge Ltd | Bank of America | | (7.424) | Cactus Inc 'A' | HSBC | (68.047) |
| | | Merrill Lynch | 18.809 | (269) | Cactus Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.245) |
| 14.182 | Bunge Ltd | Barclays Bank | 53.608 | 908 | Cadence Bank | Bank of America | |
| 8.781 | Bunge Ltd | Goldman Sachs | 31.786 | | | Merrill Lynch | 1.553 |
| 23.383 | Burford Capital Ltd | Barclays Bank | 14.965 | (5.688) | Cadence Bank | Barclays Bank | (4.695) |
| 15.251 | Burford Capital Ltd | Goldman Sachs | 17.844 | 26.685 | Cadence Bank | Goldman Sachs | 45.631 |
| 21.414 | Burford Capital Ltd | HSBC | 29.337 | 10.840 | Cadence Bank | Morgan Stanley | 9.648 |
| (5.008) | Burlington Stores Inc | Barclays Bank | (47.175) | 8.072 | Cadence Design Systems Inc | Barclays Bank | 39.870 |
| (714) | Burlington Stores Inc | Goldman Sachs | 5.419 | | | | |
| 2.203 | Business First Bancshares Inc | Bank of America | | 2.058 | Cadence Design Systems Inc | Goldman Sachs | 28.298 |
| | | Merrill Lynch | 617 | | | | |
| 13.324 | Business First Bancshares Inc | Barclays Bank | 8.927 | 757 | Cadence Design Systems Inc | HSBC | 8.718 |
| 18.395 | Business First Bancshares Inc | Goldman Sachs | 5.151 | (15.014) | Cadiz Inc | Morgan Stanley | 40.986 |
| 5.273 | Business First Bancshares Inc | HSBC | (2.847) | (33.709) | Cadiz Inc | Barclays Bank | (150) |
| 842 | Business First Bancshares Inc | Morgan Stanley | 564 | (11.333) | Cadiz Inc | HSBC | (5.056) |
| (21.177) | Butterfly Network Inc | Barclays Bank | (1.906) | 5.164 | Cadre Holdings Inc | Morgan Stanley | (113) |
| 9.076 | BuzzFeed Inc | Goldman Sachs | 2.451 | 5.164 | Caesars Entertainment Inc | Barclays Bank | 10.276 |
| (15.071) | BWX Technologies Inc | Bank of America | | (14.600) | Caesars Entertainment Inc | Barclays Bank | (34.018) |
| | | Merrill Lynch | (22.117) | (2.055) | Caesars Entertainment Inc | Goldman Sachs | 2.142 |
| (16.667) | BWX Technologies Inc | Barclays Bank | (23.667) | (2.262) | Caesars Entertainment Inc | HSBC | 5.361 |
| (21.125) | BWX Technologies Inc | Goldman Sachs | (35.490) | 2.393 | Caesarstone Ltd | Bank of America | |
| (7.379) | BWX Technologies Inc | HSBC | (22.009) | | | Merrill Lynch | (574) |
| (10.884) | BWX Technologies Inc | Morgan Stanley | (15.455) | 2.133 | Caesarstone Ltd | Barclays Bank | 683 |
| 17.305 | Byline Bancorp Inc | Bank of America | | 9.944 | Caesarstone Ltd | HSBC | 1.193 |
| | | Merrill Lynch | 21.153 | 13.998 | Caesarstone Ltd | Morgan Stanley | 4.479 |
| 22.402 | Byline Bancorp Inc | Barclays Bank | 10.081 | (70.018) | CalAmp Corp | Barclays Bank | (42.711) |
| 32.664 | Byline Bancorp Inc | Goldman Sachs | 55.227 | (19.984) | CalAmp Corp | Goldman Sachs | (30.176) |
| 8.698 | Byline Bancorp Inc | HSBC | 11.945 | (12.443) | CalAmp Corp | Morgan Stanley | (7.590) |
| 20.530 | Byline Bancorp Inc | Morgan Stanley | 9.279 | 643 | Calavo Growers Inc | Bank of America | |
| (2.352) | C&F Financial Corp | Barclays Bank | (4.351) | | | Merrill Lynch | 328 |
| (60) | C&F Financial Corp | Goldman Sachs | (89) | 7.600 | Calavo Growers Inc | Barclays Bank | 13.376 |
| 12.758 | C3.ai Inc 'A' | Bank of America | | 6.707 | Calavo Growers Inc | Goldman Sachs | 3.421 |
| | | Merrill Lynch | 30.109 | 3.414 | Calavo Growers Inc | HSBC | 8.398 |
| 22.416 | C3.ai Inc 'A' | Barclays Bank | 29.589 | 2.270 | Calavo Growers Inc | Morgan Stanley | 3.995 |
| 3.174 | C3.ai Inc 'A' | Goldman Sachs | 7.491 | 3.469 | Caledonia Mining Corp Plc | Barclays Bank | 2.394 |
| 32.808 | C3.ai Inc 'A' | HSBC | 139.254 | 6.610 | Caledonia Mining Corp Plc | Goldman Sachs | 5.883 |
| 10.228 | C3.ai Inc 'A' | Morgan Stanley | 13.501 | (12.073) | Caleres Inc | Goldman Sachs | (51.672) |
| (5.938) | C4 Therapeutics Inc | Barclays Bank | (3.741) | (25.620) | Caleres Inc | HSBC | (132.968) |
| (11.597) | C4 Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (5.914) | 3.576 | California BanCorp | Bank of America | |
| (2.473) | C4 Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.558) | | | Merrill Lynch | 3.254 |
| 15.163 | Cabaletta Bio Inc | Barclays Bank | — | 9.685 | California BanCorp | Barclays Bank | 9.685 |
| 3.347 | Cabaletta Bio Inc | Goldman Sachs | (1.607) | 5.398 | California BanCorp | Goldman Sachs | 4.912 |
| 13.804 | Cabaletta Bio Inc | HSBC | 1.518 | 4.610 | California BanCorp | HSBC | 968 |
| 8.761 | Cabaletta Bio Inc | Morgan Stanley | — | 2.851 | California BanCorp | Morgan Stanley | 2.851 |
| 181 | Cable One Inc | Bank of America | | (7.629) | California Resources Corp | Barclays Bank | (14.103) |
| | | Merrill Lynch | 29.201 | (4.157) | California Resources Corp | HSBC | (20.999) |
| 775 | Cable One Inc | Barclays Bank | 53.374 | (2.606) | California Water Service Group | Barclays Bank | 3.101 |
| 597 | Cable One Inc | Goldman Sachs | 96.314 | | | | |
| 70 | Cable One Inc | HSBC | 12.216 | (19.634) | California Water Service Group | Goldman Sachs | 4.909 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------|-----------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (1.580) | California Water Service Group | HSBC | (1.820) | 7.508 | Canoo Inc | Morgan Stanley | 1.239 |
| 10.481 | Calithera Biosciences Inc | Bank of America | | (14.746) | Cantaloupe Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (106) | (20.048) | Cantaloupe Inc | Barclays Bank | (8.553) |
| 36.803 | Calithera Biosciences Inc | Goldman Sachs | (372) | (24.028) | Cantaloupe Inc | Goldman Sachs | (13.936) |
| 12.913 | Calithera Biosciences Inc | HSBC | 56 | (6.750) | Cantaloupe Inc | HSBC | (2.160) |
| 6.711 | Calithera Biosciences Inc | Morgan Stanley | (115) | (6.984) | Cantaloupe Inc | Morgan Stanley | (3.073) |
| 615 | Calix Inc | Bank of America | | (6.213) | Capital Bancorp Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.561 | | | Merrill Lynch | (5.654) |
| (3.535) | Calix Inc | Goldman Sachs | (11.347) | (6.153) | Capital Bancorp Inc | Barclays Bank | (3.138) |
| 10.084 | Calix Inc | Goldman Sachs | 30.567 | (5.025) | Capital Bancorp Inc | Goldman Sachs | (4.573) |
| 575 | Calix Inc | HSBC | 1.265 | (1.478) | Capital Bancorp Inc | HSBC | (1.005) |
| 1.556 | Calix Inc | Morgan Stanley | 3.283 | (5.576) | Capital Bancorp Inc | Morgan Stanley | (2.844) |
| (23.658) | Callaway Golf Co | Bank of America | | 26.545 | Capital City Bank Group Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (12.959) | | | Merrill Lynch | 19.112 |
| (35.197) | Callaway Golf Co | Barclays Bank | (58.779) | 41.877 | Capital City Bank Group Inc | Barclays Bank | 8.375 |
| (56.010) | Callaway Golf Co | Goldman Sachs | (22.792) | 62.213 | Capital City Bank Group Inc | Goldman Sachs | 44.793 |
| (31.225) | Callaway Golf Co | HSBC | (84.888) | 23.551 | Capital City Bank Group Inc | HSBC | 471 |
| (8.807) | Callaway Golf Co | Morgan Stanley | (14.708) | 20.719 | Capital City Bank Group Inc | Morgan Stanley | 4.144 |
| 1.999 | Callon Petroleum Co | Bank of America | | 2.510 | Capital One Financial Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 24.698 | | | Merrill Lynch | 33.107 |
| 2.696 | Callon Petroleum Co | Barclays Bank | 31.435 | 9.124 | Capital One Financial Corp | Barclays Bank | 76.277 |
| 1.165 | Callon Petroleum Co | Goldman Sachs | 16.147 | (2.549) | Capital One Financial Corp | Goldman Sachs | (33.621) |
| 846 | Callon Petroleum Co | HSBC | 13.050 | 5.483 | Capital One Financial Corp | HSBC | 21.603 |
| (14.897) | Cal-Maine Foods Inc | Barclays Bank | (28.602) | 511 | Capital One Financial Corp | Morgan Stanley | 2.331 |
| (378) | Cal-Maine Foods Inc | HSBC | 1.230 | (22.369) | Capitol Federal Financial Inc | Bank of America | |
| (19.076) | Calyxt Inc | Barclays Bank | 570 | | | Merrill Lynch | (13.645) |
| (2.617) | Cambium Networks Corp | Barclays Bank | (2.041) | (72.094) | Capitol Federal Financial Inc | Barclays Bank | (13.698) |
| (3.177) | Cambium Networks Corp | Goldman Sachs | (3.018) | (35.423) | Capitol Federal Financial Inc | Goldman Sachs | (19.434) |
| (2.646) | Cambium Networks Corp | HSBC | (2.223) | (54.590) | Capitol Federal Financial Inc | HSBC | (21.206) |
| (8.428) | Cambium Networks Corp | Morgan Stanley | (6.574) | (20.470) | Capitol Federal Financial Inc | Morgan Stanley | (3.889) |
| (8.700) | Cambridge Bancorp | Goldman Sachs | (38.976) | 4.147 | Capri Holdings Ltd | Bank of America | |
| (4.106) | Cambridge Bancorp | HSBC | 1.355 | | | Merrill Lynch | 20.175 |
| 16.035 | Camden National Corp | Bank of America | | 10.061 | Capri Holdings Ltd | Barclays Bank | 59.511 |
| | | Merrill Lynch | 31.031 | 4.797 | Capri Holdings Ltd | Goldman Sachs | 23.338 |
| 21.773 | Camden National Corp | Barclays Bank | 23.297 | 12.062 | Capri Holdings Ltd | HSBC | 92.370 |
| 8.284 | Camden National Corp | Goldman Sachs | 16.539 | 5.022 | Capri Holdings Ltd | Morgan Stanley | 29.705 |
| 1.965 | Camden National Corp | HSBC | (1.434) | 2.404 | Capstar Financial | Bank of America | |
| 2.368 | Camden National Corp | Morgan Stanley | 2.534 | | Holdings Inc | Merrill Lynch | 2.356 |
| 4.100 | Camden Property Trust (REIT) | Barclays Bank | 11.849 | 40.496 | Capstar Financial | Barclays Bank | 17.413 |
| 8.432 | Camden Property Trust (REIT) | Goldman Sachs | (4.047) | 29.175 | Capstar Financial | Goldman Sachs | 28.591 |
| 18.039 | Camden Property Trust (REIT) | HSBC | 6.494 | 28.931 | Capstar Financial | HSBC | 3.182 |
| 3.390 | Camden Property Trust (REIT) | Morgan Stanley | 9.797 | (5.444) | Cara Therapeutics Inc | Bank of America | |
| (6.837) | Campbell Soup Co | Bank of America | | (12.111) | Cara Therapeutics Inc | Merrill Lynch | 1.742 |
| | | Merrill Lynch | 23.656 | (1.740) | Cara Therapeutics Inc | Barclays Bank | 5.450 |
| (10.500) | Campbell Soup Co | Barclays Bank | (10.920) | (4.715) | Cara Therapeutics Inc | HSBC | (1.131) |
| (41.648) | Campbell Soup Co | Goldman Sachs | 144.102 | (31.489) | Cardiff Oncology Inc | Morgan Stanley | 2.122 |
| (21.615) | Campbell Soup Co | HSBC | 61.314 | | | Bank of America | |
| (14.250) | Campbell Soup Co | Morgan Stanley | (14.820) | (6.154) | Cardiff Oncology Inc | Merrill Lynch | (630) |
| (2.425) | Canadian Pacific Railway Ltd | Barclays Bank | (3.565) | (8.947) | Cardiff Oncology Inc | Barclays Bank | (615) |
| (1.465) | Canadian Pacific Railway Ltd | Goldman Sachs | (1.714) | (7.320) | Cardiff Oncology Inc | Goldman Sachs | (179) |
| (8.816) | Canadian Pacific Railway Ltd | Morgan Stanley | (12.960) | (1.975) | Cardinal Health Inc | HSBC | (732) |
| (4.555) | Cannae Holdings Inc | Bank of America | | 560 | Cardinal Health Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (9.110) | (31.662) | Cardinal Health Inc | Merrill Lynch | 62 |
| (16.038) | Cannae Holdings Inc | Barclays Bank | (18.123) | (2.070) | Cardinal Health Inc | Barclays Bank | 30.883 |
| (17.134) | Cannae Holdings Inc | Goldman Sachs | (34.268) | 6.977 | Cardinal Health Inc | Goldman Sachs | (228) |
| (15.891) | Cannae Holdings Inc | HSBC | (16.938) | (5.670) | Cardinal Health Inc | Goldman Sachs | (1.917) |
| 36.407 | Cano Health Inc | Barclays Bank | (24.757) | (2.621) | Cardiovascular Systems Inc | Morgan Stanley | 6.289 |
| 28.210 | Cano Health Inc | Goldman Sachs | 4.232 | (9.725) | Cardiovascular Systems Inc | Barclays Bank | — |
| 39.306 | Cano Health Inc | HSBC | 38.127 | (1.710) | Cardiovascular Systems Inc | Goldman Sachs | (6.699) |
| 3.674 | Cano Health Inc | Morgan Stanley | (2.498) | 3.171 | Cardlytics Inc | HSBC | (2.753) |
| 9.141 | Canoo Inc | Goldman Sachs | 424 | 4.432 | Cardlytics Inc | Bank of America | |
| 11.152 | Canoo Inc | HSBC | (2.211) | 978 | Cardlytics Inc | Merrill Lynch | (9.862) |
| | | | | | | Barclays Bank | (337) |
| | | | | | | Goldman Sachs | (107) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------|----------------------------------|---|---|--|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 7.920 | Cardlytics Inc | HSBC | (19.345) | (27.230) | Carter Bankshares Inc | Barclays Bank | (6.535) |
| (393) | CareDx Inc | Bank of America Merrill Lynch | (248) | (10.318) | Carter Bankshares Inc | Goldman Sachs | (2.167) |
| (12.050) | CareDx Inc | Barclays Bank | (19.641) | (19.062) | Carter Bankshares Inc | HSBC | 9.340 |
| (10.607) | CareDx Inc | Goldman Sachs | (6.683) | (5.698) | Carter Bankshares Inc | Morgan Stanley | (1.368) |
| (8.463) | CareDx Inc | HSBC | (25.803) | 5.510 | Carter's Inc | Bank of America Merrill Lynch | (34.324) |
| (4.792) | CareDx Inc | Morgan Stanley | (7.811) | 8.540 | Carter's Inc | Barclays Bank | 6.063 |
| 8.946 | CareMax Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.457 | 10.733 | Carter's Inc | Goldman Sachs | (72.448) |
| 10.456 | CareMax Inc | Barclays Bank | (1.987) | 11.523 | Carter's Inc | HSBC | (50.016) |
| 2.419 | CareMax Inc | Morgan Stanley | (460) | 5.205 | Carvana Co | Morgan Stanley | 3.695 |
| (2.810) | CareTrust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (2.782) | (7.249) | Carvana Co | Barclays Bank | (9.496) |
| (21.770) | CareTrust Inc (REIT) | Barclays Bank | (22.205) | (10.235) | Carvana Co | Goldman Sachs | 70.110 |
| (33.795) | CareTrust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (33.457) | (2.612) | Carvana Co | Morgan Stanley | (3.422) |
| (6.793) | CareTrust Inc (REIT) | HSBC | (11.820) | 4.476 | Casa Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.969 |
| (22.088) | Cargurus Inc | Barclays Bank | (63.834) | 20.380 | Casa Systems Inc | Goldman Sachs | 8.967 |
| (99) | Cargurus Inc | Goldman Sachs | 31 | 5.321 | Casa Systems Inc | Morgan Stanley | 2.607 |
| (10.444) | Cargurus Inc | HSBC | 50.236 | (1.565) | Casella Waste Systems Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.864) |
| (334) | Carlisle Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | (942) | (12.231) | Casella Waste Systems Inc 'A' | Barclays Bank | (24.829) |
| (19.380) | Carlisle Cos Inc | Barclays Bank | (13.760) | (1.692) | Casella Waste Systems Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.428) |
| (959) | Carlisle Cos Inc | Goldman Sachs | 134 | (5.773) | Casella Waste Systems Inc 'A' | HSBC | (5.976) |
| (606) | Carlisle Cos Inc | HSBC | (462) | (8.626) | Casella Waste Systems Inc 'A' | Morgan Stanley | (17.511) |
| 6.066 | Carlyle Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6.417 | (905) | Casey's General Stores Inc | Bank of America Merrill Lynch | 881 |
| 25.227 | Carlyle Group Inc | Barclays Bank | 49.193 | 399 | Casey's General Stores Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.615 |
| 2.966 | Carlyle Group Inc | Goldman Sachs | 3.174 | (2.142) | Casey's General Stores Inc | Barclays Bank | (15.872) |
| 2.085 | Carlyle Group Inc | HSBC | 5.726 | 1.345 | Casey's General Stores Inc | Barclays Bank | 9.966 |
| (8.664) | CarMax Inc | Bank of America Merrill Lynch | (45.400) | (3.793) | Casey's General Stores Inc | Goldman Sachs | 12.478 |
| (5.209) | CarMax Inc | Barclays Bank | (36.515) | 585 | Casey's General Stores Inc | Goldman Sachs | 1.364 |
| (7.683) | CarMax Inc | Goldman Sachs | (40.259) | (3.411) | Casey's General Stores Inc | HSBC | (31.688) |
| (6.120) | CarMax Inc | HSBC | (31.151) | 432 | Casey's General Stores Inc | HSBC | 1.644 |
| (3.018) | CarMax Inc | Morgan Stanley | (21.156) | (1.167) | Casey's General Stores Inc | Morgan Stanley | (8.647) |
| 14.637 | Carnival Corp | Bank of America Merrill Lynch | (878) | 8.454 | Cass Information Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | 254 |
| 74.641 | Carnival Corp | Barclays Bank | 68.670 | 11.700 | Cass Information Systems Inc | Barclays Bank | 15.444 |
| 26.464 | Carnival Corp | Goldman Sachs | (1.588) | 3.750 | Cass Information Systems Inc | Goldman Sachs | 113 |
| 16.408 | Carnival Corp | Morgan Stanley | 23.281 | 10.255 | Cass Information Systems Inc | HSBC | (13.627) |
| (5.385) | CarParts.com Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.558) | (3.507) | Castle Biosciences Inc | Barclays Bank | (2.595) |
| (11.535) | CarParts.com Inc | Barclays Bank | (2.941) | (6.593) | Castle Biosciences Inc | HSBC | (20.109) |
| (2.911) | CarParts.com Inc | Goldman Sachs | (1.383) | (1.473) | Castle Biosciences Inc | Morgan Stanley | (1.090) |
| (7.626) | CarParts.com Inc | HSBC | 496 | (4.874) | Catalent Inc | Bank of America Merrill Lynch | (25.004) |
| (4.903) | Carpenter Technology Corp | Bank of America Merrill Lynch | (13.777) | (1.576) | Catalent Inc | Barclays Bank | (6.714) |
| (26.716) | Carpenter Technology Corp | Goldman Sachs | (75.072) | (7.356) | Catalent Inc | Goldman Sachs | (33.528) |
| 5.451 | Carriage Services Inc | Barclays Bank | 6.378 | (3.318) | Catalent Inc | HSBC | (28.820) |
| 1.610 | Carriage Services Inc | Goldman Sachs | 580 | (4.041) | Catalent Inc | Morgan Stanley | (17.215) |
| 8.537 | Carriage Services Inc | HSBC | (1.622) | 22.484 | Catalyst Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | 18.003 |
| 748 | Carriage Services Inc | Morgan Stanley | 875 | 30.102 | Catalyst Biosciences Inc | Barclays Bank | (2.107) |
| 10.241 | Carrier Global Corp | Bank of America Merrill Lynch | (9.012) | 3.322 | Catalyst Biosciences Inc | Goldman Sachs | 2.660 |
| (14.810) | Carrier Global Corp | Barclays Bank | (10.515) | 32.520 | Catalyst Biosciences Inc | HSBC | 24.878 |
| 21.024 | Carrier Global Corp | Barclays Bank | 14.927 | 23.842 | Catalyst Biosciences Inc | Morgan Stanley | (1.669) |
| (39.605) | Carrier Global Corp | Goldman Sachs | 34.852 | (90.353) | Catalyst Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (20.781) |
| (27.972) | Carrier Global Corp | HSBC | (23.776) | (8.135) | CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT) | Barclays Bank | (32.540) |
| 1.938 | Carrier Global Corp | HSBC | (2.502) | (124.838) | CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (521.823) |
| (22.769) | Carrols Restaurant Group Inc | Goldman Sachs | (8.425) | (7.981) | CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT) | HSBC | (31.206) |
| (7.729) | Carrols Restaurant Group Inc | HSBC | (1.700) | | | | |
| (1.916) | Cars.com Inc | Bank of America Merrill Lynch | (364) | | | | |
| (31.350) | Cars.com Inc | Goldman Sachs | (5.957) | | | | |
| (9.164) | Cars.com Inc | HSBC | (8.523) | | | | |
| (3.537) | Carter Bankshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (743) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3.287) | CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT) | Morgan Stanley | (13.148) | (1.008) | Cedar Realty Trust Inc (REIT) | HSBC | 665 |
| (188) | Caterpillar Inc | Bank of America | | (12.826) | Cedar Realty Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (1.411) |
| 816 | Caterpillar Inc | Bank of America | | 1.290 | Celanese Corp | Bank of America | |
| (166) | Caterpillar Inc | Merrill Lynch | 7.940 | (13.802) | Celanese Corp | Merrill Lynch | 17.273 |
| 2.479 | Caterpillar Inc | Barclays Bank | (744) | 3.688 | Celanese Corp | Barclays Bank | (86.677) |
| (7.339) | Caterpillar Inc | Barclays Bank | 31.657 | 9.440 | Celanese Corp | Barclays Bank | 23.304 |
| 1.388 | Caterpillar Inc | Goldman Sachs | (70.820) | (8.906) | Celanese Corp | HSBC | 144.497 |
| 664 | Caterpillar Inc | Goldman Sachs | 13.505 | (4.302) | Celcuity Inc | Morgan Stanley | (55.930) |
| 1.642 | Caterpillar Inc | HSBC | 8.118 | (12.982) | Celldex Therapeutics Inc | Barclays Bank | 989 |
| (7.514) | Cathay General Bancorp | Morgan Stanley | 20.968 | (7.275) | Celldex Therapeutics Inc | Barclays Bank | 40.504 |
| (10.041) | Cathay General Bancorp | Bank of America | | (5.403) | Celldex Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 20.588 |
| (5.094) | Cathay General Bancorp | Merrill Lynch | (15.879) | (1.074) | Celsius Holdings Inc | HSBC | 6.862 |
| (5.688) | Cathay General Bancorp | Barclays Bank | (18.370) | (17.380) | Celsius Holdings Inc | Bank of America | (10.244) |
| (9.374) | Cathay General Bancorp | Goldman Sachs | (10.120) | (21.294) | Celsius Holdings Inc | Merrill Lynch | (85.858) |
| (9.447) | Cato Corp 'A' | HSBC | (7.925) | 2.329 | Centene Corp | Barclays Bank | (271.711) |
| (9.529) | Cato Corp 'A' | Morgan Stanley | (17.104) | (24.677) | Centene Corp | Bank of America | (2.515) |
| (27.043) | Cato Corp 'A' | Bank of America | | (12.001) | Centene Corp | Merrill Lynch | 59.225 |
| (9.724) | Cato Corp 'A' | Merrill Lynch | 7.652 | (21.906) | Centene Corp | Barclays Bank | 12.961 |
| (1.573) | Cato Corp 'A' | Barclays Bank | (4.955) | 3.169 | Centene Corp | HSBC | (97.482) |
| (603) | Cavco Industries Inc | Barclays Bank | 416 | 2.948 | Centene Corp | HSBC | 14.102 |
| (2.772) | Cavco Industries Inc | Goldman Sachs | 23.562 | 10.044 | Centennial Resource Development Inc 'A' | Morgan Stanley | (7.075) |
| (2.656) | Cavco Industries Inc | Goldman Sachs | 35.829 | 9.523 | Centennial Resource Development Inc 'A' | Bank of America | 6.177 |
| (209) | Cavco Industries Inc | HSBC | 144 | 16.196 | Centennial Resource Development Inc 'A' | Merrill Lynch | |
| 7.924 | CB Financial Services Inc | Morgan Stanley | 144 | 48.245 | Centennial Resource Development Inc 'A' | Barclays Bank | 12.618 |
| 4.652 | CB Financial Services Inc | Barclays Bank | 7.449 | 3.275 | Centennial Resource Development Inc 'A' | HSBC | 61.512 |
| 3.850 | CB Financial Services Inc | Goldman Sachs | 1.210 | (20.532) | CenterPoint Energy Inc | Morgan Stanley | 4.339 |
| 4.390 | cbdMD Inc | Goldman Sachs | 3.619 | (67.417) | CenterPoint Energy Inc | Bank of America | |
| (2.363) | CBIZ Inc | Goldman Sachs | 164 | (44.124) | CenterPoint Energy Inc | Merrill Lynch | (13.918) |
| (58.859) | CBIZ Inc | Bank of America | (3.119) | (86.762) | CenterPoint Energy Inc | Barclays Bank | (71.404) |
| (7.968) | CBIZ Inc | Merrill Lynch | (115.364) | (32.663) | CenterPoint Energy Inc | Goldman Sachs | (40.821) |
| (1.774) | CBIZ Inc | Barclays Bank | (10.518) | 11.187 | Centerspace (REIT) | HSBC | (128.099) |
| 3.903 | CBL & Associates Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.625 | 5.471 | Centerspace (REIT) | Morgan Stanley | (36.093) |
| 2.474 | CBL & Associates Properties Inc (REIT) | Bank of America | | 5.145 | Centerspace (REIT) | Barclays Bank | 559 |
| 14.775 | CBL & Associates Properties Inc (REIT) | Bank of America | | 15.975 | Centogene NV | Goldman Sachs | (10.450) |
| 1.022 | CBL & Associates Properties Inc (REIT) | Merrill Lynch | (3.119) | 1.477 | Centogene NV | HSBC | 15.538 |
| 1.812 | Cboe Global Markets Inc | Barclays Bank | (115.364) | 1.310 | Centogene NV | Barclays Bank | (2.316) |
| 8.078 | Cboe Global Markets Inc | Goldman Sachs | (10.518) | 11.759 | Central Garden & Pet Co 'A' | Goldman Sachs | (746) |
| 17.450 | Cboe Global Markets Inc | Morgan Stanley | (3.477) | 18.296 | Central Garden & Pet Co 'A' | Morgan Stanley | (190) |
| 28.360 | Cboe Global Markets Inc | Bank of America | | 22.822 | Central Garden & Pet Co 'A' | Bank of America | |
| 3.475 | Cboe Global Markets Inc | Merrill Lynch | 4.616 | 2.420 | Central Garden & Pet Co 'A' | Merrill Lynch | 1.881 |
| 19.185 | CBRE Group Inc 'A' | Barclays Bank | 30.293 | 4.480 | Central Garden & Pet Co 'A' | Barclays Bank | 42.264 |
| 13.296 | CBRE Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 36.819 | 35.016 | Central Pacific Financial Corp | Goldman Sachs | 3.652 |
| (6.011) | CBTX Inc | HSBC | 109.199 | 90.586 | Central Pacific Financial Corp | HSBC | (73) |
| (19.609) | CBTX Inc | Morgan Stanley | 13.032 | (75) | Central Valley Community Bancorp | Morgan Stanley | 10.349 |
| (43.420) | CBTX Inc | Bank of America | (2.945) | (4.182) | Central Valley Community Bancorp | Bank of America | 6.303 |
| 2.379 | CDW Corp | Merrill Lynch | (10.981) | (3.937) | Central Valley Community Bancorp | Merrill Lynch | 35 |
| 9.892 | CDW Corp | Barclays Bank | (10.981) | (9.618) | Central Valley Community Bancorp | Barclays Bank | 2.007 |
| 1.847 | CDW Corp | Goldman Sachs | (21.276) | (1.079) | Central Valley Community Bancorp | Goldman Sachs | 1.850 |
| 520 | CDW Corp | HSBC | (987) | (9.104) | Centrus Energy Corp 'A' | HSBC | 12.311 |
| 5.439 | CDW Corp | Merrill Lynch | (987) | (571) | Centrus Energy Corp 'A' | Morgan Stanley | 518 |
| 72.782 | CECO Environmental Corp | Barclays Bank | 74.239 | (3.050) | Centrus Energy Corp 'A' | Barclays Bank | (17.753) |
| 40.400 | CECO Environmental Corp | Goldman Sachs | (767) | | | Goldman Sachs | (1.953) |
| 29.010 | CECO Environmental Corp | HSBC | 3.892 | | | HSBC | (19.723) |
| 10.703 | CECO Environmental Corp | Morgan Stanley | 40.820 | | | | |
| (25.615) | Cedar Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 49.492 | | | | |
| | | Barclays Bank | 10.908 | | | | |
| | | Goldman Sachs | 19.727 | | | | |
| | | Morgan Stanley | 2.890 | | | | |
| | | Barclays Bank | (2.818) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 11.136 | Century Aluminum Co | Goldman Sachs | (12.250) | 1.943 | Charles River Laboratories International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 13.640 |
| 1.870 | Century Aluminum Co | HSBC | — | 1.366 | Charles River Laboratories International Inc | Barclays Bank | 9.535 |
| 2.409 | Century Aluminum Co | Morgan Stanley | (795) | 1.079 | Charles River Laboratories International Inc | Goldman Sachs | 7.575 |
| 12.715 | Century Casinos Inc | Barclays Bank | 10.172 | 4.330 | Charles River Laboratories International Inc | Morgan Stanley | 30.223 |
| 16.497 | Century Casinos Inc | Goldman Sachs | (1.320) | 7.621 | Charles Schwab Corp | Bank of America Merrill Lynch | 45.062 |
| 5.796 | Century Casinos Inc | Morgan Stanley | 4.637 | 9.029 | Charles Schwab Corp | Barclays Bank | 45.145 |
| (8.471) | Century Communities Inc | Barclays Bank | (19.144) | 3.327 | Charles Schwab Corp | Goldman Sachs | 22.452 |
| (12.050) | Century Communities Inc | Goldman Sachs | (5.302) | 22.407 | Charles Schwab Corp | HSBC | 143.746 |
| (15.164) | Century Communities Inc | HSBC | (1.904) | 5.047 | Charles Schwab Corp | Morgan Stanley | 25.235 |
| (4.689) | Cerence Inc | Bank of America Merrill Lynch | (12.335) | 777 | Chart Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6.580 |
| (1.981) | Cerence Inc | Barclays Bank | (1.347) | (5.709) | Chart Industries Inc | Barclays Bank | (5.481) |
| (4.479) | Cerence Inc | Goldman Sachs | (12.631) | (1.649) | Chart Industries Inc | Goldman Sachs | (20.151) |
| (2.888) | Cerence Inc | HSBC | (13.834) | 1.243 | Chart Industries Inc | Goldman Sachs | 15.189 |
| (679) | Cerence Inc | Morgan Stanley | (462) | 2.105 | Chart Industries Inc | HSBC | 12.540 |
| (3.427) | Cerevel Therapeutics Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.237) | 2.874 | Charter Communications Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 124.502 |
| (19.915) | Cerevel Therapeutics Holdings Inc | Barclays Bank | (36.046) | 268 | Charter Communications Inc 'A' | Barclays Bank | 8.841 |
| (3.988) | Cerevel Therapeutics Holdings Inc | Goldman Sachs | (7.258) | 2.435 | Charter Communications Inc 'A' | HSBC | 104.681 |
| (2.862) | Cerevel Therapeutics Holdings Inc | Morgan Stanley | (5.180) | (9.847) | Chase Corp | Goldman Sachs | (5.219) |
| 2.151 | Ceridian HCM Holding Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.517 | (17.538) | Chatham Lodging Trust (REIT) | Barclays Bank | (12.452) |
| 7.268 | Ceridian HCM Holding Inc | Barclays Bank | 6.178 | (90.998) | Chatham Lodging Trust (REIT) | Goldman Sachs | (44.843) |
| 9.373 | Ceridian HCM Holding Inc | Goldman Sachs | 19.683 | (2.285) | Chatham Lodging Trust (REIT) | Morgan Stanley | (1.165) |
| 6.014 | Ceridian HCM Holding Inc | HSBC | 27.123 | 2.498 | CHC Group Ltd* | Morgan Stanley | (1.124) |
| 7.752 | Ceridian HCM Holding Inc | Morgan Stanley | 6.589 | 1.482 | Check Point Software Technologies Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 4.105 |
| (7.536) | Certara Inc | Bank of America Merrill Lynch | (13.791) | (6.208) | Check Point Software Technologies Ltd | Barclays Bank | (7.077) |
| (7.991) | Certara Inc | Barclays Bank | (5.993) | 1.110 | Check Point Software Technologies Ltd | Barclays Bank | 1.265 |
| (26.142) | Certara Inc | Goldman Sachs | (47.840) | (9.210) | Check Point Software Technologies Ltd | Goldman Sachs | (25.512) |
| (1.375) | Certara Inc | HSBC | (4.153) | 6.791 | Check Point Software Technologies Ltd | HSBC | 37.623 |
| (17.152) | Certara Inc | Morgan Stanley | (12.864) | (5.335) | Checkpoint Therapeutics Inc | Barclays Bank | (133) |
| 22.324 | Cerus Corp | Barclays Bank | 4.465 | (39.455) | Checkpoint Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (6.510) |
| 60.890 | Cerus Corp | HSBC | 18.267 | 2.431 | Cheesecake Factory Inc | Bank of America Merrill Lynch | 10.833 |
| 32.555 | Cerus Corp | Morgan Stanley | 6.511 | 19.334 | Cheesecake Factory Inc | Goldman Sachs | 36.198 |
| (30.748) | CEVA Inc | Barclays Bank | (90.707) | 7.349 | Cheesecake Factory Inc | HSBC | (873) |
| (18.348) | CEVA Inc | Goldman Sachs | (44.402) | 2.926 | Cheesecake Factory Inc | Morgan Stanley | 12.406 |
| (5.657) | CEVA Inc | HSBC | (10.692) | 7.401 | Chefs' Warehouse Inc | Barclays Bank | 16.060 |
| (2.838) | CEVA Inc | Morgan Stanley | (8.372) | 1.923 | Chefs' Warehouse Inc | Goldman Sachs | (981) |
| 4.417 | CF Industries Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (30.212) | 2.539 | Chefs' Warehouse Inc | HSBC | 507 |
| 2.820 | CF Industries Holdings Inc | Goldman Sachs | (15.996) | (13.108) | Chegg Inc | Barclays Bank | (11.011) |
| 829 | CF Industries Holdings Inc | HSBC | 293 | (72.603) | Chembio Diagnostics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.968) |
| (1.439) | CF Industries Holdings Inc | HSBC | 7.614 | (33.416) | Chembio Diagnostics Inc | Barclays Bank | 685 |
| 2.171 | CF Industries Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.997) | (10.138) | Chembio Diagnostics Inc | HSBC | (912) |
| (3.613) | CH Robinson Worldwide Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.330 | (424) | Chemed Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.832 |
| (6.083) | CH Robinson Worldwide Inc | Barclays Bank | (8.395) | (4.628) | Chemed Corp | Barclays Bank | 16.918 |
| (990) | CH Robinson Worldwide Inc | Goldman Sachs | 900 | (1.607) | Chemed Corp | Goldman Sachs | 6.942 |
| (3.892) | CH Robinson Worldwide Inc | HSBC | 9.206 | (376) | Chemed Corp | HSBC | 5.099 |
| (25.869) | Champions Oncology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.104) | (331) | Chemed Corp | Morgan Stanley | 1.205 |
| (2.664) | Champions Oncology Inc | Barclays Bank | (373) | (18.679) | ChemoCentryx Inc | Barclays Bank | (1.308) |
| (2.471) | Champions Oncology Inc | Goldman Sachs | (297) | (992) | ChemoCentryx Inc | Goldman Sachs | (3.204) |
| (1.719) | Change Healthcare Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.444) | (7.566) | ChemoCentryx Inc | Morgan Stanley | (530) |
| 45.273 | Change Healthcare Inc | Barclays Bank | 27.164 | | | | |
| (8.548) | Change Healthcare Inc | Barclays Bank | (5.129) | | | | |
| 16.001 | Change Healthcare Inc | Goldman Sachs | 13.441 | | | | |
| (14.496) | Change Healthcare Inc | Goldman Sachs | (11.835) | | | | |
| 25.233 | Change Healthcare Inc | HSBC | 21.953 | | | | |
| (8.243) | Change Healthcare Inc | HSBC | (9.100) | | | | |
| 12.505 | Change Healthcare Inc | Morgan Stanley | 7.503 | | | | |
| (5.655) | ChannelAdvisor Corp | Barclays Bank | (1.810) | | | | |
| (11.113) | ChannelAdvisor Corp | Goldman Sachs | (9.668) | | | | |
| (1.931) | ChannelAdvisor Corp | Morgan Stanley | (850) | | | | |
| (59.317) | ChargePoint Holdings Inc | Barclays Bank | (120.413) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (7.124) | Chemours Co | Bank of America Merrill Lynch | (20.873) | 1.840 | Chinook Therapeutics Inc | Barclays Bank | 1.343 |
| (8.465) | Chemours Co | Barclays Bank | (17.861) | 2.984 | Chinook Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 5.222 |
| (4.761) | Chemours Co | Goldman Sachs | (13.950) | 4.665 | Chinook Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 3.405 |
| (13.391) | Chemours Co | HSBC | (48.682) | (64) | Chipotle Mexican Grill Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.880) |
| (183) | Chemung Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 245 | (1.152) | Chipotle Mexican Grill Inc | Goldman Sachs | (105.846) |
| (1.421) | Chemung Financial Corp | Morgan Stanley | 711 | 228 | Chipotle Mexican Grill Inc | Goldman Sachs | 19.830 |
| 1.118 | Cheniere Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.298 | 467 | Chipotle Mexican Grill Inc | HSBC | 53.415 |
| 1.149 | Cheniere Energy Inc | Barclays Bank | 9.893 | (339) | Chipotle Mexican Grill Inc | Morgan Stanley | (34.293) |
| 11.608 | Cheniere Energy Inc | Goldman Sachs | 34.243 | 123 | Chipotle Mexican Grill Inc | Morgan Stanley | 12.443 |
| 4.773 | Cheniere Energy Inc | HSBC | 25.679 | 2.919 | Choice Hotels International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.908 |
| 4.570 | Cheniere Energy Inc | Morgan Stanley | 39.348 | 7.926 | Choice Hotels International Inc | Barclays Bank | 30.515 |
| 1.243 | Cherry Hill Mortgage Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 186 | 34.677 | Choice Hotels International Inc | Goldman Sachs | 35.024 |
| 9.583 | Cherry Hill Mortgage Investment Corp (REIT) | Barclays Bank | 862 | 17.532 | Choice Hotels International Inc | HSBC | 25.773 |
| 6.226 | Cherry Hill Mortgage Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 934 | 5.585 | Choice Hotels International Inc | Morgan Stanley | 21.502 |
| 8.257 | Cherry Hill Mortgage Investment Corp (REIT) | HSBC | 3.881 | 1.208 | ChoiceOne Financial Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | 302 |
| 3.489 | Cherry Hill Mortgage Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | 314 | 2.527 | ChoiceOne Financial Services Inc | Barclays Bank | (3.007) |
| 2.976 | Chesapeake Energy Corp | Bank of America Merrill Lynch | 39.015 | 4.491 | ChoiceOne Financial Services Inc | HSBC | (7.949) |
| (8.567) | Chesapeake Energy Corp | Barclays Bank | (53.715) | 283 | ChoiceOne Financial Services Inc | Morgan Stanley | (337) |
| 13.254 | Chesapeake Energy Corp | Barclays Bank | 83.102 | (15.887) | ChromaDex Corp | Barclays Bank | (1.271) |
| 4.590 | Chesapeake Energy Corp | HSBC | 76.712 | (4.861) | ChromaDex Corp | HSBC | (875) |
| (740) | Chesapeake Utilities Corp | Bank of America Merrill Lynch | (176) | (11.012) | Chubb Ltd | Barclays Bank | (14.095) |
| (738) | Chesapeake Utilities Corp | Barclays Bank | (613) | (20.058) | Chubb Ltd | Goldman Sachs | (11.834) |
| (3.047) | Chesapeake Utilities Corp | HSBC | (15.991) | (4.593) | Chubb Ltd | HSBC | (15.984) |
| (1.458) | Chesapeake Utilities Corp | Morgan Stanley | (396) | 1.680 | Chubb Ltd | HSBC | (4.460) |
| (853) | Chevron Corp | Barclays Bank | (7.353) | 1.368 | Chubb Ltd | Morgan Stanley | 1.751 |
| (19.737) | Chevron Corp | Goldman Sachs | (144.672) | 8.605 | Church & Dwight Co Inc | Barclays Bank | (4.990) |
| (1.559) | Chevron Corp | Morgan Stanley | (8.053) | 32.729 | Church & Dwight Co Inc | Goldman Sachs | (319.762) |
| (13.435) | Chewy Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 3.359 | 22.898 | Church & Dwight Co Inc | HSBC | (211.315) |
| (11.556) | Chewy Inc 'A' | Barclays Bank | (16.410) | 683 | Church & Dwight Co Inc | Morgan Stanley | (635) |
| (13.906) | Chewy Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.477 | (7.614) | Churchill Downs Inc | Barclays Bank | (124.565) |
| (57) | Chewy Inc 'A' | HSBC | 1 | (8.558) | Churchill Downs Inc | Goldman Sachs | (77.022) |
| (326) | Chewy Inc 'A' | Morgan Stanley | (463) | (5.221) | Churchill Downs Inc | HSBC | (87.242) |
| 1.632 | Chicken Soup For The Soul Entertainment Inc | Barclays Bank | 1.289 | (2.548) | Churchill Downs Inc | Morgan Stanley | (41.685) |
| 1.394 | Chicken Soup For The Soul Entertainment Inc | Goldman Sachs | 2.314 | (8.290) | Chuy's Holdings Inc | Barclays Bank | (11.109) |
| 13.459 | Chico's FAS Inc | Barclays Bank | 9.690 | (989) | Chuy's Holdings Inc | HSBC | 477 |
| 16.305 | Chico's FAS Inc | Goldman Sachs | (489) | (1.046) | Chuy's Holdings Inc | Morgan Stanley | (209) |
| 6.005 | Chico's FAS Inc | HSBC | 1.441 | 25.781 | Cidara Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 335 |
| 15.721 | Chico's FAS Inc | Morgan Stanley | 11.319 | 44.185 | Cidara Therapeutics Inc | Barclays Bank | (80) |
| 4.060 | Children's Place Inc | Bank of America Merrill Lynch | (412) | 74.154 | Cidara Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 964 |
| 7.527 | Children's Place Inc | Goldman Sachs | 75 | 37.772 | Cidara Therapeutics Inc | HSBC | (10.198) |
| (12.599) | Chimera Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (3.780) | 17.362 | Ciena Corp | Bank of America Merrill Lynch | 5.113 |
| (33.342) | Chimera Investment Corp (REIT) | Barclays Bank | (14.004) | 13.589 | Ciena Corp | Barclays Bank | 15.220 |
| (80.308) | Chimera Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (24.092) | 14.350 | Ciena Corp | Goldman Sachs | 783 |
| (61.757) | Chimera Investment Corp (REIT) | HSBC | (95) | 29.801 | Ciena Corp | HSBC | (20.379) |
| (75.690) | Chimera Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (31.790) | 2.296 | Ciena Corp | Morgan Stanley | 2.571 |
| (12.698) | Chimerix Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.048) | 2.947 | Cigna Corp | Barclays Bank | 20.364 |
| (17.595) | Chimerix Inc | Barclays Bank | 7.918 | 5.616 | Cigna Corp | Goldman Sachs | 21.285 |
| (62.335) | Chimerix Inc | Goldman Sachs | (7.936) | 1.258 | Cigna Corp | Morgan Stanley | 8.693 |
| (66.116) | Chimerix Inc | HSBC | 67.435 | 527 | Cimpress Plc | Bank of America Merrill Lynch | (612) |
| | | | | 834 | Cimpress Plc | Barclays Bank | 375 |
| | | | | 8.391 | Cimpress Plc | Goldman Sachs | 336 |
| | | | | 2.532 | Cimpress Plc | HSBC | (937) |
| | | | | 1.333 | Cimpress Plc | Morgan Stanley | 600 |
| | | | | 2.975 | Cincinnati Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.935 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (233) | Cincinnati Financial Corp | Bank of America | | 9.592 | Citizens Inc | Goldman Sachs | 1.055 |
| | | Merrill Lynch | (91) | 29.037 | Citizens Inc | HSBC | 17.422 |
| 8.971 | Cincinnati Financial Corp | Barclays Bank | 8.725 | 17.295 | Citizens Inc | Morgan Stanley | (865) |
| (3.315) | Cincinnati Financial Corp | Barclays Bank | (3.845) | (1.625) | City Holding Co | Barclays Bank | (2.235) |
| 3.199 | Cincinnati Financial Corp | Goldman Sachs | 2.098 | (3.626) | City Holding Co | Goldman Sachs | (7.748) |
| 1.061 | Cincinnati Financial Corp | HSBC | 2.563 | (2.755) | City Holding Co | HSBC | (5.038) |
| 1.336 | Cincinnati Financial Corp | Morgan Stanley | 1.550 | (2.415) | City Holding Co | Morgan Stanley | (3.801) |
| (2.752) | Cincinnati Financial Corp | Morgan Stanley | (3.872) | (8.200) | Civeo Corp | Bank of America | |
| 4.488 | CinCor Pharma Inc | Goldman Sachs | (27.736) | | | Merrill Lynch | (19.270) |
| 30.092 | Cinemark Holdings Inc | Barclays Bank | 37.314 | (4.241) | Civeo Corp | Barclays Bank | (6.192) |
| 26.924 | Cinemark Holdings Inc | Goldman Sachs | 30.424 | (5.576) | Civeo Corp | Goldman Sachs | (13.104) |
| 4.897 | Cinemark Holdings Inc | HSBC | 12.729 | 16.910 | Civista Bancshares Inc | Bank of America | |
| 414 | Cinemark Holdings Inc | Morgan Stanley | 513 | | | Merrill Lynch | 4.058 |
| (79) | Cintas Corp | Bank of America | | 19.085 | Civista Bancshares Inc | Barclays Bank | 5.344 |
| | | Merrill Lynch | (1.970) | 21.425 | Civista Bancshares Inc | Goldman Sachs | 5.142 |
| 472 | Cintas Corp | Bank of America | | 8.392 | Civista Bancshares Inc | HSBC | 1.175 |
| | | Merrill Lynch | 7.552 | 25.088 | Civista Bancshares Inc | Morgan Stanley | 7.025 |
| (744) | Cintas Corp | Barclays Bank | (17.447) | (9.792) | Civitas Resources Inc | Barclays Bank | (89.891) |
| 1.146 | Cintas Corp | Barclays Bank | 26.874 | (19.148) | Civitas Resources Inc | Goldman Sachs | (272.887) |
| 1.749 | Cintas Corp | Goldman Sachs | 25.150 | (5.241) | Civitas Resources Inc | HSBC | (102.724) |
| (8.142) | Cintas Corp | HSBC | (158.769) | (35.301) | Clarivate Plc | Barclays Bank | — |
| 565 | Cintas Corp | HSBC | 9.082 | (17.423) | Clarivate Plc | Goldman Sachs | (6.621) |
| 252 | Cintas Corp | Morgan Stanley | 5.909 | (23.505) | Clarivate Plc | HSBC | (3.996) |
| (45.857) | Cipher Mining Inc | Barclays Bank | (14.674) | (11.725) | Clarivate Plc | Morgan Stanley | — |
| (23.227) | CIRCOR International Inc | Barclays Bank | 9.988 | (25.980) | Clarus Corp | Barclays Bank | (67.288) |
| (12.515) | CIRCOR International Inc | Goldman Sachs | 1.126 | (42.513) | Clarus Corp | Goldman Sachs | (54.842) |
| (983) | CIRCOR International Inc | Morgan Stanley | 423 | (7.052) | Clarus Corp | HSBC | (11.918) |
| 1.945 | Cirrus Logic Inc | Bank of America | | 17.327 | Clean Energy Fuels Corp | Barclays Bank | 10.781 |
| | | Merrill Lynch | 4.707 | 5.481 | Clean Energy Fuels Corp | HSBC | 1.433 |
| 11.733 | Cirrus Logic Inc | Barclays Bank | 22.058 | (1.486) | Clean Harbors Inc | Bank of America | |
| 18.022 | Cirrus Logic Inc | Goldman Sachs | 38.548 | | | Merrill Lynch | (3.909) |
| 6.249 | Cirrus Logic Inc | HSBC | 27.868 | 942 | Clean Harbors Inc | Bank of America | |
| 2.877 | Cisco Systems Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 2.214 |
| | | Merrill Lynch | (11.738) | (2.503) | Clean Harbors Inc | Barclays Bank | (6.401) |
| (99.129) | Cisco Systems Inc | Barclays Bank | (152.493) | 5.341 | Clean Harbors Inc | Barclays Bank | 10.789 |
| 35.992 | Cisco Systems Inc | Barclays Bank | 56.507 | 1.200 | Clean Harbors Inc | Goldman Sachs | 2.820 |
| (8.565) | Cisco Systems Inc | HSBC | 992 | (699) | Clean Harbors Inc | HSBC | (1.548) |
| 23.092 | Cisco Systems Inc | HSBC | (93.292) | 1.080 | Clean Harbors Inc | HSBC | 3.450 |
| 7.309 | Cisco Systems Inc | Morgan Stanley | 11.475 | 1.550 | Clean Harbors Inc | Morgan Stanley | 3.131 |
| 635 | Citi Trends Inc | Bank of America | | (44.332) | Cleanspark Inc | Barclays Bank | (27.664) |
| | | Merrill Lynch | (76) | (1.145) | Cleanspark Inc | Goldman Sachs | (149) |
| 4.076 | Citi Trends Inc | Barclays Bank | 13.899 | (12.681) | Cleanspark Inc | HSBC | (4.946) |
| 4.175 | Citi Trends Inc | Goldman Sachs | (501) | (95.332) | Clear Channel Outdoor Holdings Inc | Barclays Bank | 8.580 |
| 1.236 | Citi Trends Inc | HSBC | 25 | | | Barclays Bank | (1.194) |
| 31.074 | Citigroup Inc | Barclays Bank | 24.859 | (9.492) | Clear Secure Inc 'A' | Bank of America | |
| 31.341 | Citigroup Inc | Goldman Sachs | 191.494 | (2.783) | Clearfield Inc | Merrill Lynch | (22.598) |
| 19.892 | Citigroup Inc | HSBC | 73.203 | | | Barclays Bank | (5.659) |
| 13.298 | Citigroup Inc | Morgan Stanley | 10.638 | (2.160) | Clearfield Inc | Goldman Sachs | (17.726) |
| (113.720) | Citius Pharmaceuticals Inc | HSBC | 3.594 | (2.183) | Clearfield Inc | HSBC | (16.473) |
| 828 | Citizens & Northern Corp | Bank of America | | (1.840) | Clearfield Inc | Barclays Bank | (6.713) |
| | | Merrill Lynch | 8 | (15.257) | ClearPoint Neuro Inc | Barclays Bank | (11.139) |
| 1.398 | Citizens & Northern Corp | Barclays Bank | (308) | (5.925) | ClearPoint Neuro Inc | HSBC | (9.740) |
| 5.425 | Citizens & Northern Corp | Goldman Sachs | 54 | (2.815) | ClearPoint Neuro Inc | Barclays Bank | 3.795 |
| 2.867 | Citizens & Northern Corp | HSBC | (172) | (54.218) | Clearside Biomedical Inc | Barclays Bank | (28.215) |
| 1.148 | Citizens & Northern Corp | Morgan Stanley | (253) | (11.855) | Clearwater Paper Corp | Goldman Sachs | (5.939) |
| (9.601) | Citizens Financial Group Inc | Bank of America | | (4.242) | Clearwater Paper Corp | HSBC | (3.962) |
| | | Merrill Lynch | (24.949) | (2.892) | Clearwater Paper Corp | Bank of America | |
| 11.060 | Citizens Financial Group Inc | Bank of America | | 1.999 | Clearway Energy Inc 'A' | Merrill Lynch | 4.778 |
| | | Merrill Lynch | 29.530 | | | Barclays Bank | 72.160 |
| (15.082) | Citizens Financial Group Inc | Barclays Bank | (24.282) | 45.100 | Clearway Energy Inc 'A' | Goldman Sachs | 10.528 |
| 4.493 | Citizens Financial Group Inc | Barclays Bank | 7.234 | 4.405 | Clearway Energy Inc 'A' | HSBC | 23.859 |
| (62.151) | Citizens Financial Group Inc | Goldman Sachs | (166.087) | 8.995 | Clearway Energy Inc 'A' | Bank of America | |
| 38.650 | Citizens Financial Group Inc | Goldman Sachs | 103.195 | 3.611 | Clearway Energy Inc 'C' | Merrill Lynch | 10.905 |
| 7.692 | Citizens Financial Group Inc | HSBC | 9.538 | | | Barclays Bank | 46.662 |
| (6.193) | Citizens Financial Group Inc | Morgan Stanley | (9.971) | 21.210 | Clearway Energy Inc 'C' | HSBC | 60.028 |
| 10.909 | Citizens Financial Group Inc | Morgan Stanley | 17.563 | (8.345) | Cleveland-Cliffs Inc | Barclays Bank | (6.384) |
| (944) | Citizens Holding Co | Bank of America | | (43.566) | Cleveland-Cliffs Inc | Goldman Sachs | (94.320) |
| | | Merrill Lynch | (302) | (16.473) | Cleveland-Cliffs Inc | HSBC | (25.898) |
| (8.513) | Citizens Holding Co | Goldman Sachs | (2.724) | | | | |
| 63.873 | Citizens Inc | Barclays Bank | (3.194) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (14.191) | Cleveland-Cliffs Inc | Morgan Stanley | (10.856) | (3.489) | Coda Octopus Group Inc | HSBC | 558 |
| 59.046 | Clipper Realty Inc (REIT) | Barclays Bank | (10.628) | (2.093) | Coda Octopus Group Inc | Morgan Stanley | (879) |
| 22.342 | Clipper Realty Inc (REIT) | Goldman Sachs | (13.182) | 12.501 | Codex DNA Inc | Barclays Bank | (6.125) |
| 2.419 | Clorox Co | Bank of America | | 4.783 | Codex DNA Inc | Morgan Stanley | (2.344) |
| | | Merrill Lynch | (28.375) | 4.133 | Codexis Inc | Bank of America | |
| 4.528 | Clorox Co | Barclays Bank | 26.127 | | | Merrill Lynch | 2.397 |
| 1.480 | Clorox Co | Goldman Sachs | (17.360) | 17.758 | Codexis Inc | Barclays Bank | 4.440 |
| (3.555) | Clorox Co | Goldman Sachs | 35.090 | 3.239 | Codexis Inc | Goldman Sachs | 1.619 |
| 851 | Clorox Co | Morgan Stanley | 4.910 | 12.298 | Codexis Inc | HSBC | 6.986 |
| (2.957) | Clorox Co | Morgan Stanley | (14.946) | 2.904 | Codexis Inc | Morgan Stanley | 2.638 |
| (959) | Cloudflare Inc 'A' | Bank of America | | 6.484 | Co-Diagnostics Inc | Barclays Bank | 778 |
| | | Merrill Lynch | (4.674) | 4.260 | Co-Diagnostics Inc | Goldman Sachs | 1.747 |
| (2.893) | Cloudflare Inc 'A' | Barclays Bank | 1.070 | 3.448 | Co-Diagnostics Inc | HSBC | 4.034 |
| (18.079) | Cloudflare Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.878 | (15.384) | Codorus Valley Bancorp Inc | Bank of America | |
| (3.545) | Cloudflare Inc 'A' | HSBC | (14.254) | | | Merrill Lynch | (26.614) |
| 57.343 | Clovis Oncology Inc | Barclays Bank | (883) | (13.336) | Codorus Valley Bancorp Inc | Barclays Bank | (24.272) |
| 39.290 | Clovis Oncology Inc | Goldman Sachs | (6.275) | (12.664) | Codorus Valley Bancorp Inc | Goldman Sachs | (21.909) |
| 48.943 | Clovis Oncology Inc | HSBC | (7.067) | (6.145) | Codorus Valley Bancorp Inc | HSBC | (7.374) |
| 27.325 | Clovis Oncology Inc | Morgan Stanley | (421) | (4.860) | Codorus Valley Bancorp Inc | Morgan Stanley | (8.845) |
| (177) | CME Group Inc | Bank of America | | 81.273 | Coeur Mining Inc | Barclays Bank | 21.537 |
| | | Merrill Lynch | (391) | 78.174 | Coeur Mining Inc | Goldman Sachs | 41.823 |
| 874 | CME Group Inc | Goldman Sachs | 7.132 | 12.870 | Coeur Mining Inc | HSBC | 5.985 |
| 4.541 | CME Group Inc | HSBC | 11.930 | 109.864 | Coeur Mining Inc | Morgan Stanley | 29.114 |
| 939 | CME Group Inc | Morgan Stanley | 6.366 | (23.534) | Cogent Biosciences Inc | Bank of America | |
| 109.234 | CMS Energy Corp | Barclays Bank | 110.326 | | | Merrill Lynch | (26.829) |
| 88.068 | CMS Energy Corp | Goldman Sachs | 137.386 | 321 | Cogent Communications Holdings Inc | Bank of America | |
| 6.916 | CMS Energy Corp | HSBC | 10.097 | | | Merrill Lynch | 674 |
| 733 | CNA Financial Corp | Bank of America | | 8.012 | Cogent Communications Holdings Inc | Barclays Bank | 25.558 |
| | | Merrill Lynch | 924 | 7.711 | Cogent Communications Holdings Inc | Goldman Sachs | 16.193 |
| (37.700) | CNA Financial Corp | Barclays Bank | (23.751) | 7.239 | Cogent Communications Holdings Inc | HSBC | 14.436 |
| (28.225) | CNA Financial Corp | Morgan Stanley | (17.782) | 778 | Cogent Communications Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.482 |
| 708 | CNA Financial Corp | Morgan Stanley | 446 | (9.185) | Cognex Corp | Barclays Bank | (5.327) |
| (8.137) | CNB Financial Corp | Barclays Bank | (1.790) | (4.888) | Cognex Corp | Goldman Sachs | 293 |
| (8.156) | CNB Financial Corp | Goldman Sachs | (408) | (9.182) | Cognex Corp | Morgan Stanley | (5.326) |
| (8.772) | CNB Financial Corp | Morgan Stanley | (1.930) | 2.783 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | Bank of America | |
| 67.999 | CNO Financial Group Inc | Barclays Bank | 33.999 | 4.166 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | Merrill Lynch | 4.146 |
| 16.855 | CNO Financial Group Inc | Goldman Sachs | 10.113 | 4.166 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | Barclays Bank | 9.290 |
| 40.996 | CNX Resources Corp | Barclays Bank | 586 | 10.495 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | Goldman Sachs | 19.988 |
| (17.496) | CNX Resources Corp | Goldman Sachs | (59.311) | 42.668 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | HSBC | (93.869) |
| 4.264 | CNX Resources Corp | Goldman Sachs | 11 | 5.456 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | Morgan Stanley | 12.167 |
| 5.909 | CNX Resources Corp | HSBC | 225 | 3.593 | Cohen & Steers Inc | Bank of America | |
| (24.046) | CNX Resources Corp | HSBC | (94.501) | | | Merrill Lynch | 18.097 |
| 11.017 | CNX Resources Corp | Morgan Stanley | 108 | 14.255 | Cohen & Steers Inc | Barclays Bank | 42.480 |
| (1.033) | CNX Resources Corp | Morgan Stanley | (1.911) | 13.180 | Cohen & Steers Inc | Goldman Sachs | 67.086 |
| (2.314) | Coastal Financial Corp | Bank of America | | 14.606 | Cohen & Steers Inc | HSBC | 7.887 |
| | | Merrill Lynch | (4.316) | 1.557 | Cohen & Steers Inc | Morgan Stanley | 4.640 |
| (1.613) | Coastal Financial Corp | Barclays Bank | (2.879) | (5.395) | Coherent Inc | Barclays Bank | (13.865) |
| (5.249) | Coastal Financial Corp | Goldman Sachs | (9.789) | (8.482) | Coherent Inc | Goldman Sachs | (19.594) |
| (2.407) | Coastal Financial Corp | HSBC | 1.649 | (4.638) | Coherent Inc | HSBC | (14.842) |
| (556) | Coastal Financial Corp | Morgan Stanley | (992) | 15.768 | Coherus Biosciences Inc | Barclays Bank | (8.089) |
| (10.694) | Coca-Cola Co | Barclays Bank | (3.315) | 10.531 | Coherus Biosciences Inc | Goldman Sachs | (2.817) |
| 26.585 | Coca-Cola Co | Barclays Bank | (25.551) | 36.359 | Coherus Biosciences Inc | HSBC | (27.880) |
| (55.584) | Coca-Cola Co | Goldman Sachs | 155.079 | 12.562 | Coherus Biosciences Inc | Morgan Stanley | (7.663) |
| 26.850 | Coca-Cola Co | Goldman Sachs | (74.912) | 4.324 | Cohu Inc | Bank of America | |
| (25.247) | Coca-Cola Co | HSBC | 36.356 | | | Merrill Lynch | 9.037 |
| 24.413 | Coca-Cola Co | HSBC | (36.922) | 3.911 | Cohu Inc | Barclays Bank | 8.459 |
| (18.183) | Coca-Cola Co | Morgan Stanley | (5.637) | 772 | Cohu Inc | Goldman Sachs | 2.432 |
| (53) | Coca-Cola Consolidated Inc | Goldman Sachs | (1.495) | 7.093 | Cohu Inc | HSBC | 18.196 |
| (44) | Coca-Cola Consolidated Inc | HSBC | (2.799) | 4.185 | Cohu Inc | Morgan Stanley | 6.452 |
| (1.268) | Coca-Cola Consolidated Inc | Morgan Stanley | (18.564) | (2.468) | Coinbase Global Inc 'A' | Bank of America | |
| 1.066 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Bank of America | | (690) | Coinbase Global Inc 'A' | Merrill Lynch | (41.685) |
| | | Merrill Lynch | 885 | | | Barclays Bank | (8.618) |
| 8.098 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Barclays Bank | (4.616) | | | | |
| 14.416 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Goldman Sachs | 11.965 | | | | |
| 7.886 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | HSBC | 34.541 | | | | |
| (17.831) | Coda Octopus Group Inc | Barclays Bank | (7.489) | | | | |
| (9.400) | Coda Octopus Group Inc | Goldman Sachs | (3.384) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------|-----------------|---|---|--------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (758) | Coinbase Global Inc 'A' | Goldman Sachs | (12.803) | 996 | CommScope Holding Co Inc | Bank of America | |
| 122.262 | Colgate-Palmolive Co | Goldman Sachs | (66.898) | | | Merrill Lynch | 369 |
| 1.607 | Collegium | Bank of America | | 47.734 | CommScope Holding Co Inc | Goldman Sachs | 17.662 |
| | Pharmaceutical Inc | Merrill Lynch | 289 | 29.270 | CommScope Holding Co Inc | HSBC | 21.367 |
| 8.661 | Collegium | | | 20.111 | CommScope Holding Co Inc | Morgan Stanley | 11.463 |
| | Pharmaceutical Inc | Barclays Bank | 346 | (35.178) | Community Bank | | |
| 1.726 | Collegium | | | | System Inc | Barclays Bank | (20.051) |
| | Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs | (874) | (44.127) | Community Bank | | |
| 1.570 | Collegium | | | | System Inc | Goldman Sachs | (98.844) |
| | Pharmaceutical Inc | HSBC | 1.987 | (45.613) | Community Bank | | |
| 3.912 | Colony Bankcorp Inc | Bank of America | | | System Inc | HSBC | (12.772) |
| | | Merrill Lynch | 704 | 1.434 | Community Financial Corp | Bank of America | |
| 16.169 | Colony Bankcorp Inc | Barclays Bank | 5.336 | | | Merrill Lynch | 3.449 |
| 14.091 | Colony Bankcorp Inc | Goldman Sachs | 2.536 | 3.727 | Community Financial Corp | Barclays Bank | 5.572 |
| 9.698 | Colony Bankcorp Inc | HSBC | (72) | 590 | Community Financial Corp | Goldman Sachs | 1.419 |
| 13.083 | Colony Bankcorp Inc | Morgan Stanley | 4.317 | 3.293 | Community Financial Corp | Morgan Stanley | 4.923 |
| (29.087) | Columbia Financial Inc | Barclays Bank | (18.325) | (3.640) | Community Health | Bank of America | |
| (50.232) | Columbia Financial Inc | Goldman Sachs | (24.111) | | Systems Inc | Merrill Lynch | 3.895 |
| (52.660) | Columbia Financial Inc | HSBC | (18.958) | (16.137) | Community Health | | |
| (33.768) | Columbia Financial Inc | Morgan Stanley | (21.274) | | Systems Inc | Barclays Bank | 8.553 |
| (1.628) | Columbia Sportswear Co | Bank of America | | (3.224) | Community Health | | |
| | | Merrill Lynch | 5.307 | | Systems Inc | Goldman Sachs | 3.450 |
| (42.744) | Columbia Sportswear Co | Barclays Bank | (84.458) | (8.752) | Community Health | | |
| (12.502) | Columbia Sportswear Co | Goldman Sachs | 36.055 | | Systems Inc | HSBC | 11.371 |
| (9.948) | Columbia Sportswear Co | HSBC | (3.184) | (18.435) | Community Healthcare | | |
| (9.937) | Columbus McKinnon Corp | Barclays Bank | (894) | | Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | (17.513) |
| (8.792) | Columbus McKinnon Corp | Goldman Sachs | (791) | (32.794) | Community Healthcare | | |
| (18.163) | Columbus McKinnon Corp | HSBC | 22.900 | | Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (23.284) |
| 13.303 | Comcast Corp 'A' | Barclays Bank | 12.106 | (29.439) | Community Healthcare | | |
| 45.240 | Comcast Corp 'A' | Goldman Sachs | 86.860 | | Trust Inc (REIT) | HSBC | 294 |
| 37.579 | Comcast Corp 'A' | HSBC | 151.443 | (6.237) | Community Healthcare | | |
| (6.200) | Comerica Inc | Bank of America | | | Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (5.925) |
| | | Merrill Lynch | (41.230) | 13.994 | Community Trust | Bank of America | |
| 1.878 | Comerica Inc | Bank of America | | | Bancorp Inc | Merrill Lynch | 16.373 |
| | | Merrill Lynch | 12.489 | 28.795 | Community Trust | | |
| (10.658) | Comerica Inc | Barclays Bank | (52.544) | | Bancorp Inc | Barclays Bank | 288 |
| 10.989 | Comerica Inc | Barclays Bank | 54.176 | 16.131 | Community Trust | | |
| (15.935) | Comerica Inc | Goldman Sachs | (105.968) | | Bancorp Inc | Goldman Sachs | 18.873 |
| 11.654 | Comerica Inc | Goldman Sachs | 75.056 | 11.404 | Community Trust | | |
| (11.492) | Comerica Inc | HSBC | (37.694) | | Bancorp Inc | HSBC | 2.509 |
| 5.001 | Comerica Inc | HSBC | 37.227 | 36.892 | Community Trust | | |
| (3.712) | Comerica Inc | Morgan Stanley | (18.300) | | Bancorp Inc | Morgan Stanley | 369 |
| 1.767 | Comfort Systems USA Inc | Bank of America | | (4.741) | CommVault Systems Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 11.477 | | | Merrill Lynch | (14.128) |
| 7.653 | Comfort Systems USA Inc | Barclays Bank | 46.454 | (7.766) | CommVault Systems Inc | Barclays Bank | (9.931) |
| 4.691 | Comfort Systems USA Inc | Goldman Sachs | 28.709 | (2.525) | CommVault Systems Inc | Goldman Sachs | (2.044) |
| 2.023 | Comfort Systems USA Inc | HSBC | 14.138 | (8.700) | CommVault Systems Inc | HSBC | (28.848) |
| (11.458) | Commerce Bancshares Inc | Bank of America | | (705) | CommVault Systems Inc | Morgan Stanley | (1.241) |
| | | Merrill Lynch | (16.958) | (8.006) | Compass Minerals | | |
| (44.922) | Commerce Bancshares Inc | Barclays Bank | (69.180) | | International Inc | Barclays Bank | (7.125) |
| (41.990) | Commerce Bancshares Inc | Goldman Sachs | (60.023) | (7.297) | Compass Minerals | | |
| (47.620) | Commerce Bancshares Inc | HSBC | 23.810 | | International Inc | Goldman Sachs | (6.421) |
| (34.778) | Commerce Bancshares Inc | Morgan Stanley | (53.558) | (2.967) | CompoSecure Inc | Morgan Stanley | (475) |
| (7.407) | Commercial Metals Co | Bank of America | | (10.333) | Computer Programs and | | |
| | | Merrill Lynch | (26.591) | | Systems Inc | Goldman Sachs | 1.550 |
| 3.709 | Commercial Metals Co | Bank of America | | 862 | CompX International Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 11.206 | | | Merrill Lynch | 720 |
| (7.452) | Commercial Metals Co | Barclays Bank | (16.022) | 5.581 | CompX International Inc | Barclays Bank | (474) |
| 24.193 | Commercial Metals Co | Barclays Bank | 52.015 | 2.748 | CompX International Inc | Goldman Sachs | 2.295 |
| (4.297) | Commercial Metals Co | Goldman Sachs | (15.426) | 4.049 | CompX International Inc | Morgan Stanley | (344) |
| 11.052 | Commercial Metals Co | Goldman Sachs | 39.676 | 77.152 | comScore Inc | Barclays Bank | 386 |
| 11.624 | Commercial Metals Co | HSBC | 24.309 | 4.455 | comScore Inc | Morgan Stanley | 22 |
| 8.584 | Commercial Metals Co | Morgan Stanley | 19.450 | (4.039) | Comstock Mining Inc | Barclays Bank | 40 |
| (2.653) | Commercial Vehicle | | | (8.847) | Comstock Mining Inc | Goldman Sachs | 177 |
| | Group Inc | Barclays Bank | (1.327) | (10.205) | Comstock Mining Inc | Morgan Stanley | 102 |
| (6.882) | Commercial Vehicle | | | (3.188) | Comstock Resources Inc | Bank of America | |
| | Group Inc | Goldman Sachs | (1.652) | | | Merrill Lynch | (14.410) |
| (10.141) | Commercial Vehicle | | | (13.227) | Comstock Resources Inc | Barclays Bank | (42.723) |
| | Group Inc | HSBC | 2.738 | (29.346) | Comstock Resources Inc | Goldman Sachs | (132.644) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|--------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (10.566) | Comstock Resources Inc | HSBC | (55.153) | 3.519 | Consolidated Edison Inc | Goldman Sachs | 15.871 |
| (24.870) | Comstock Resources Inc | Morgan Stanley | (80.330) | (5.865) | Consolidated Edison Inc | Goldman Sachs | (26.451) |
| (32.611) | Comtech Telecommunications Corp | Barclays Bank | (9.131) | 12.037 | Consolidated Edison Inc | HSBC | 60.363 |
| (24.565) | Comtech Telecommunications Corp | Goldman Sachs | (16.213) | (10.308) | Consolidated Edison Inc | HSBC | (53.292) |
| (30.743) | Conagra Brands Inc | Bank of America | | 14.907 | Consolidated Edison Inc | Morgan Stanley | 27.876 |
| | | Merrill Lynch | 92.083 | (5.782) | Consolidated Edison Inc | Morgan Stanley | (10.812) |
| 42.007 | Conagra Brands Inc | Barclays Bank | 3.361 | (27.051) | Consolidated Water Co Ltd | Bank of America | |
| 79.906 | Conagra Brands Inc | Goldman Sachs | (257.297) | | | Merrill Lynch | (72.497) |
| (15.972) | Conagra Brands Inc | Goldman Sachs | 12.064 | (43.008) | Consolidated Water Co Ltd | Barclays Bank | (11.182) |
| (12.719) | Conagra Brands Inc | HSBC | 49.223 | (56.967) | Consolidated Water Co Ltd | Goldman Sachs | (152.672) |
| (2.024) | Concentrix Corp | Bank of America | | (3.899) | Consolidated Water Co Ltd | Morgan Stanley | (1.014) |
| | | Merrill Lynch | (20.240) | 951 | Constellation Brands Inc 'A' | Bank of America | |
| (6.787) | Concentrix Corp | Barclays Bank | (58.707) | 1.248 | Constellation Brands Inc 'A' | Merrill Lynch | 3.076 |
| (2.971) | Concentrix Corp | HSBC | (32.934) | 5.203 | Constellation Brands Inc 'A' | Barclays Bank | 1.133 |
| 5.925 | Concrete Pumping Holdings Inc | Bank of America | | (5.012) | Constellation Brands Inc 'A' | Goldman Sachs | 29.263 |
| | | Merrill Lynch | 3.849 | (14.061) | Constellation Energy Corp | HSBC | 14.785 |
| 2.740 | Concrete Pumping Holdings Inc | Barclays Bank | 1.014 | (55.970) | Constellation Energy Corp | Barclays Bank | (90.412) |
| 4.766 | Concrete Pumping Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.417 | (29.088) | Constellation Energy Corp | Goldman Sachs | (360.447) |
| 14.940 | Concrete Pumping Holdings Inc | HSBC | 2.988 | (10.741) | Constellation Energy Corp | HSBC | (156.159) |
| 5.620 | Concrete Pumping Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.079 | (28.953) | Constellation Energy Corp | Morgan Stanley | (69.065) |
| 12.770 | Conduent Inc | Barclays Bank | 2.937 | (22.973) | Constellium SE | Barclays Bank | 14.476 |
| 72.547 | Conduent Inc | Goldman Sachs | 24.666 | | Construction Partners Inc 'A' | Barclays Bank | (26.878) |
| 21.834 | Conduent Inc | HSBC | 9.389 | (8.293) | Construction Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.981) |
| (6.286) | Confluent Inc 'A' | Barclays Bank | (12.195) | (4.594) | Construction Partners Inc 'A' | HSBC | (10.520) |
| (2.145) | Confluent Inc 'A' | Goldman Sachs | (4.204) | (5.393) | Construction Partners Inc 'A' | Morgan Stanley | (6.310) |
| (5.824) | Confluent Inc 'A' | HSBC | (7.979) | 15.516 | Consumer Portfolio Services Inc | Morgan Stanley | 14.895 |
| (1.924) | Confluent Inc 'A' | Morgan Stanley | (3.733) | (16.739) | Container Store Group Inc | Barclays Bank | (8.704) |
| (463) | CONMED Corp | Bank of America | | (6.930) | Container Store Group Inc | Goldman Sachs | (2.495) |
| | | Merrill Lynch | 394 | (2.556) | Container Store Group Inc | HSBC | (281) |
| (8.971) | CONMED Corp | Barclays Bank | (18.480) | 10.672 | Continental Resources Inc | Bank of America | |
| (5.124) | CONMED Corp | Goldman Sachs | 4.322 | | | Merrill Lynch | 117.466 |
| (1.015) | CONMED Corp | HSBC | (2.166) | 3.239 | Continental Resources Inc | Barclays Bank | 23.969 |
| (1.141) | CONMED Corp | Morgan Stanley | (2.350) | 20.949 | Continental Resources Inc | Goldman Sachs | 234.001 |
| 7.878 | ConnectOne Bancorp Inc | Bank of America | | 11.716 | Continental Resources Inc | HSBC | 183.004 |
| | | Merrill Lynch | 6.854 | 15.764 | Continental Resources Inc | Morgan Stanley | 116.654 |
| 36.512 | ConnectOne Bancorp Inc | Barclays Bank | 24.463 | 9.636 | Contra Flexion Therape' | Morgan Stanley | 5.974 |
| 17.776 | ConnectOne Bancorp Inc | Goldman Sachs | 14.080 | (55.459) | ContraFect Corp | Goldman Sachs | (14.974) |
| 14.099 | ConnectOne Bancorp Inc | HSBC | (10.010) | 3.944 | Convey Health Solutions Holdings Inc | Bank of America | |
| 9.449 | ConnectOne Bancorp Inc | Morgan Stanley | 6.331 | 8.663 | Convey Health Solutions Holdings Inc | Merrill Lynch | 3.195 |
| 4.263 | Conn's Inc | Barclays Bank | 4.434 | | Convey Health Solutions Holdings Inc | Barclays Bank | 3.205 |
| 8.998 | Conn's Inc | Goldman Sachs | (7.648) | 7.184 | Convey Health Solutions Holdings Inc | Goldman Sachs | 5.819 |
| 1.664 | Conn's Inc | HSBC | (3.078) | 18.493 | Convey Health Solutions Holdings Inc | HSBC | 9.616 |
| 1.643 | Conn's Inc | Morgan Stanley | 1.709 | (274) | Cooper Cos Inc | Bank of America | |
| (8.795) | ConocoPhillips | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (5.820) |
| | | Merrill Lynch | (101.411) | (4.867) | Cooper Cos Inc | Barclays Bank | (50.763) |
| (25.707) | ConocoPhillips | Barclays Bank | (203.085) | 3.989 | Cooper Cos Inc | Barclays Bank | 40.898 |
| (13.465) | ConocoPhillips | HSBC | (256.557) | (1.496) | Cooper Cos Inc | Goldman Sachs | (31.775) |
| (6.633) | ConocoPhillips | Morgan Stanley | (52.401) | 3.420 | Cooper Cos Inc | Goldman Sachs | 63.953 |
| (409) | Consensus Cloud Solutions Inc | Bank of America | | (939) | Cooper Cos Inc | HSBC | (35.250) |
| | | Merrill Lynch | (573) | 328 | Cooper Cos Inc | HSBC | 3.559 |
| (2.143) | Consensus Cloud Solutions Inc | Barclays Bank | 4.715 | (2.358) | Cooper Cos Inc | Morgan Stanley | (24.594) |
| (4.640) | Consensus Cloud Solutions Inc | Goldman Sachs | (6.496) | 460 | Cooper Cos Inc | Morgan Stanley | 4.798 |
| (3.926) | Consensus Cloud Solutions Inc | HSBC | 2.373 | 17.957 | Cooper-Standard Holdings Inc | Bank of America | |
| (33.309) | Consolidated Communications Holdings Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 8.440 |
| | | Merrill Lynch | (12.657) | 7.255 | Cooper-Standard Holdings Inc | Barclays Bank | 4.280 |
| (30.019) | Consolidated Communications Holdings Inc | Barclays Bank | (13.208) | 18.976 | Cooper-Standard Holdings Inc | Goldman Sachs | 8.919 |
| (41.091) | Consolidated Communications Holdings Inc | Goldman Sachs | (15.615) | 2.735 | Cooper-Standard Holdings Inc | HSBC | (1.067) |
| (17.040) | Consolidated Edison Inc | Barclays Bank | (31.865) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 7.290 | Cooper-Standard Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.301 | 4.824 | Costamare Inc | Goldman Sachs | 2.557 |
| 322 | Copa Holdings SA 'A' | Bank of America | | (1.568) | CoStar Group Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 654 | (3.833) | CoStar Group Inc | Barclays Bank | (6.366) |
| 2.235 | Copa Holdings SA 'A' | Barclays Bank | 3.822 | (26.301) | CoStar Group Inc | Goldman Sachs | (104.266) |
| 1.099 | Copa Holdings SA 'A' | Goldman Sachs | 2.037 | (13.508) | CoStar Group Inc | HSBC | (59.528) |
| 3.012 | Copa Holdings SA 'A' | HSBC | 8.957 | 2.399 | Costco Wholesale Corp | Bank of America | |
| 1.895 | Copa Holdings SA 'A' | Morgan Stanley | 3.240 | | | Merrill Lynch | (80.343) |
| (2.484) | Copart Inc | Barclays Bank | (8.520) | 3.407 | Costco Wholesale Corp | Barclays Bank | 107.525 |
| (27.086) | Copart Inc | Goldman Sachs | (100.489) | 4.338 | Costco Wholesale Corp | Goldman Sachs | (128.476) |
| (2.553) | Copart Inc | HSBC | (9.212) | 1.243 | Costco Wholesale Corp | HSBC | (46.973) |
| (821) | Copart Inc | Morgan Stanley | (2.215) | 4.289 | Costco Wholesale Corp | Morgan Stanley | 135.361 |
| 4.465 | Corcept Therapeutics Inc | Bank of America | | (39.046) | Coterra Energy Inc | Goldman Sachs | (194.840) |
| | | Merrill Lynch | 8.796 | (18.395) | Coterra Energy Inc | HSBC | (114.601) |
| 15.361 | Corcept Therapeutics Inc | Barclays Bank | 14.747 | 2.985 | Coty Inc 'A' | Bank of America | |
| 13.488 | Corcept Therapeutics Inc | HSBC | 31.669 | | | Merrill Lynch | 2.269 |
| 1.541 | Corcept Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.658 | 11.324 | Coty Inc 'A' | Barclays Bank | 8.040 |
| (9.804) | Core & Main Inc 'A' | Bank of America | | (9.230) | Coty Inc 'A' | Barclays Bank | (6.553) |
| | | Merrill Lynch | (28.824) | 61.821 | Coty Inc 'A' | Goldman Sachs | 46.252 |
| (18.494) | Core & Main Inc 'A' | Barclays Bank | (25.521) | 10.365 | Coty Inc 'A' | HSBC | 2.902 |
| (4.764) | Core & Main Inc 'A' | Goldman Sachs | (14.007) | 6.045 | Coty Inc 'A' | Morgan Stanley | 4.292 |
| (20.751) | Core & Main Inc 'A' | HSBC | (42.211) | (11.381) | Couchbase Inc | Barclays Bank | (10.100) |
| (5.139) | Core & Main Inc 'A' | Morgan Stanley | (7.092) | (13.362) | Couchbase Inc | HSBC | 7.483 |
| (3.782) | CoreCard Corp | Bank of America | | 1.933 | Coupa Software Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.778) | | | Merrill Lynch | 2.474 |
| (11.384) | CoreCard Corp | Barclays Bank | (7.286) | 6.247 | Coupa Software Inc | Barclays Bank | (3.561) |
| (2.195) | CoreCard Corp | Morgan Stanley | (1.405) | 6.729 | Coupa Software Inc | Goldman Sachs | 8.613 |
| (15.578) | CoreCivic Inc (REIT) | Barclays Bank | (9.035) | 588 | Coupa Software Inc | HSBC | 365 |
| (22.351) | CoreCivic Inc (REIT) | Goldman Sachs | (37.326) | 3.895 | Coupa Software Inc | Morgan Stanley | (2.220) |
| (13.672) | CorMedix Inc | Bank of America | | 19.694 | Coupang LLC 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 6.973 | | | Merrill Lynch | 23.830 |
| (30.061) | CorMedix Inc | Barclays Bank | 6.012 | 25.078 | Coupang LLC 'A' | HSBC | 85.067 |
| (8.405) | CorMedix Inc | HSBC | (168) | 17.347 | Coupang LLC 'A' | Morgan Stanley | 694 |
| (17.086) | Cornerstone Building Brands Inc | Barclays Bank | (1.538) | (6.907) | Coursera Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (11.051) |
| (4.752) | Cornerstone Building Brands Inc | Goldman Sachs | (1.140) | (2.759) | Coursera Inc | Barclays Bank | (2.869) |
| (4.994) | Cornerstone Building Brands Inc | HSBC | (949) | (15.784) | Coursera Inc | Goldman Sachs | (25.254) |
| (2.375) | Corning Inc | Bank of America | | (3.121) | Coursera Inc | Morgan Stanley | (3.246) |
| | | Merrill Lynch | (6.113) | 44.687 | Cousins Properties Inc (REIT) | Bank of America | |
| (59.432) | Corning Inc | Barclays Bank | (95.685) | (20.622) | Cousins Properties Inc (REIT) | Merrill Lynch | 34.409 |
| (5.245) | Corning Inc | Goldman Sachs | (8.942) | 35.128 | Cousins Properties Inc (REIT) | Bank of America | |
| (16.120) | Corning Inc | HSBC | 6.287 | (22.610) | Cousins Properties Inc (REIT) | Merrill Lynch | (15.844) |
| 13.436 | Corporate Office Properties Trust (REIT) | Bank of America | | | | Barclays Bank | 21.280 |
| | | Merrill Lynch | 17.601 | 2.539 | Cousins Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (14.244) |
| 94.428 | Corporate Office Properties Trust (REIT) | Barclays Bank | 13.220 | (5.812) | Cousins Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.676 |
| 17.538 | Corporate Office Properties Trust (REIT) | Goldman Sachs | 18.973 | 19.884 | Cousins Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (4.475) |
| 9.068 | Corporate Office Properties Trust (REIT) | HSBC | 14.509 | (12.050) | Cousins Properties Inc (REIT) | HSBC | 9.442 |
| (6.302) | Corsair Gaming Inc | Bank of America | | 19.066 | Cousins Properties Inc (REIT) | HSBC | (4.941) |
| | | Merrill Lynch | (1.828) | (3.259) | Cousins Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 11.360 |
| (1.504) | Corsair Gaming Inc | Barclays Bank | (1.624) | 17.414 | Covenant Logistics Group Inc | Morgan Stanley | (2.053) |
| (13.544) | Corsair Gaming Inc | HSBC | (14.628) | | | Barclays Bank | 21.419 |
| (5.059) | Corsair Gaming Inc | Morgan Stanley | (5.464) | 962 | Covenant Logistics Group Inc | HSBC | 87 |
| 40.575 | Corteva Inc | Barclays Bank | 99.003 | 1.419 | Covetrus Inc | Bank of America | |
| 27.322 | Corteva Inc | Goldman Sachs | 186.063 | (13.462) | Covetrus Inc | Merrill Lynch | 6.002 |
| 4.581 | Corteva Inc | HSBC | 20.753 | 5.338 | Covetrus Inc | Barclays Bank | (13.866) |
| 3.584 | Cortexyme Inc | Goldman Sachs | (2.580) | (5.234) | Covetrus Inc | Goldman Sachs | 22.580 |
| (942) | CorVel Corp | Bank of America | | (2.827) | Covetrus Inc | Goldman Sachs | (22.140) |
| | | Merrill Lynch | 2.246 | | | HSBC | (18.178) |
| (395) | CorVel Corp | Barclays Bank | (735) | | | | |
| (478) | CorVel Corp | Goldman Sachs | 876 | | | | |
| (1.256) | CorVel Corp | Morgan Stanley | (2.336) | | | | |
| 10.360 | Corvus Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 414 | | | | |
| 24.195 | Corvus Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 726 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 9.608 | Cowen Inc 'A' | Bank of America | | (2.991) | Crinetics | | |
| | | Merrill Lynch | 24.596 | | Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 11.156 |
| 18.802 | Cowen Inc 'A' | Barclays Bank | 42.116 | 7.685 | Crocs Inc | Bank of America | |
| 3.303 | Cowen Inc 'A' | Goldman Sachs | 8.456 | | | Merrill Lynch | (10.529) |
| 11.651 | Cowen Inc 'A' | HSBC | 25.056 | (1.822) | Crocs Inc | Barclays Bank | (2.933) |
| 4.801 | Cowen Inc 'A' | Morgan Stanley | 10.754 | 13.518 | Crocs Inc | Barclays Bank | 24.922 |
| 1.126 | CPI Card Group Inc | Barclays Bank | 2.083 | (3.174) | Crocs Inc | Goldman Sachs | 4.348 |
| 1.476 | CPI Card Group Inc | Goldman Sachs | 1.712 | 666 | Crocs Inc | Goldman Sachs | (446) |
| 1.388 | CPI Card Group Inc | HSBC | 3.414 | 7.820 | Crocs Inc | HSBC | 12.761 |
| 1.207 | CPI Card Group Inc | Morgan Stanley | 2.233 | 1.299 | Crocs Inc | Morgan Stanley | 2.091 |
| (10.772) | CPS Technologies Corp | Barclays Bank | (1.939) | 4.137 | Cross Country | Bank of America | |
| (1.891) | CPS Technologies Corp | Goldman Sachs | (170) | | Healthcare Inc | Merrill Lynch | 3.392 |
| 838 | CRA International Inc | Bank of America | | 1.909 | Cross Country | | |
| | | Merrill Lynch | 1.785 | | Healthcare Inc | Barclays Bank | (420) |
| 882 | CRA International Inc | Barclays Bank | 1.491 | 9.083 | Cross Country | | |
| 352 | CRA International Inc | Goldman Sachs | (164) | | Healthcare Inc | Goldman Sachs | 7.448 |
| 3.069 | CRA International Inc | HSBC | 8.409 | 5.753 | Cross Country | | |
| 1.376 | CRA International Inc | Morgan Stanley | 2.325 | | Healthcare Inc | HSBC | 633 |
| (768) | Cracker Barrel Old | Bank of America | | 8.701 | Cross Country | | |
| | Country Store Inc | Merrill Lynch | (1.565) | | Healthcare Inc | Morgan Stanley | (1.914) |
| (2.655) | Cracker Barrel Old | | | (1.358) | CrossFirst Bankshares Inc | Barclays Bank | (299) |
| | Country Store Inc | Barclays Bank | (22.992) | (60.265) | CrossFirst Bankshares Inc | Goldman Sachs | (35.556) |
| (1.464) | Cracker Barrel Old | | | (137) | CrossFirst Bankshares Inc | HSBC | (74) |
| | Country Store Inc | Goldman Sachs | 988 | (33.476) | CrossFirst Bankshares Inc | Morgan Stanley | (7.365) |
| (8.988) | Cracker Barrel Old | | | (2.057) | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (35.113) |
| | Country Store Inc | HSBC | 34.107 | (5.133) | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (104.014) |
| (728) | Cracker Barrel Old | | | (2.728) | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | HSBC | (60.970) |
| | Country Store Inc | Morgan Stanley | (6.304) | (2.011) | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | (39.795) |
| (8.185) | Crane Holdings Co | Bank of America | | (2.156) | Crown Castle International | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (31.969) | | Corp (REIT) | Merrill Lynch | (31.003) |
| (7.949) | Crane Holdings Co | Barclays Bank | (31.080) | 8.708 | Crown Castle International | | |
| (10.181) | Crane Holdings Co | Goldman Sachs | 86.443 | | Corp (REIT) | Barclays Bank | 42.321 |
| (5.146) | Crane Holdings Co | HSBC | (3.242) | 10.439 | Crown Castle International | | |
| (6.160) | Crane Holdings Co | Morgan Stanley | (24.085) | | Corp (REIT) | Goldman Sachs | 150.073 |
| 34.659 | Crawford & Co 'A' | Bank of America | | 7.422 | Crown Castle International | | |
| | | Merrill Lynch | 18.716 | | Corp (REIT) | HSBC | 115.775 |
| 102.582 | Crawford & Co 'A' | Barclays Bank | 71.807 | 1.585 | Crown Castle International | | |
| 35.328 | Crawford & Co 'A' | Goldman Sachs | 19.077 | | Corp (REIT) | Morgan Stanley | 7.703 |
| 50.189 | Crawford & Co 'A' | HSBC | 30.615 | (2.512) | Crown Holdings Inc | Bank of America | |
| 43.377 | Crawford & Co 'A' | Morgan Stanley | 30.364 | | | Merrill Lynch | (9.274) |
| (1.061) | Credicorp Ltd | Bank of America | | (7.844) | Crown Holdings Inc | Barclays Bank | (26.278) |
| | | Merrill Lynch | (12.106) | (13.050) | Crown Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.224) |
| (5.568) | Credicorp Ltd | Barclays Bank | (29.121) | (5.016) | Crown Holdings Inc | HSBC | (19.327) |
| (430) | Credicorp Ltd | HSBC | (1.673) | (3.034) | Crown Holdings Inc | Morgan Stanley | (10.164) |
| (685) | Credit Acceptance Corp | Bank of America | | (838) | CryoPort Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 9.741 | | | Merrill Lynch | (1.852) |
| (2.064) | Credit Acceptance Corp | Barclays Bank | (30.795) | (4.699) | CryoPort Inc | Barclays Bank | (11.748) |
| 7.705 | Credo Technology Group | Bank of America | | (9.374) | CryoPort Inc | Goldman Sachs | (20.717) |
| | Holding Ltd | Merrill Lynch | 4.777 | (9.896) | CryoPort Inc | HSBC | (40.651) |
| 15.055 | Credo Technology Group | | | (5.312) | CS Disco Inc | Bank of America | |
| | Holding Ltd | Barclays Bank | 6.323 | | | Merrill Lynch | (5.526) |
| 23.305 | Credo Technology Group | | | (3.774) | CS Disco Inc | Barclays Bank | (4.000) |
| | Holding Ltd | HSBC | 15.847 | (1.138) | CS Disco Inc | Goldman Sachs | (1.297) |
| 3.692 | Credo Technology Group | | | (5.069) | CS Disco Inc | HSBC | (4.359) |
| | Holding Ltd | Morgan Stanley | 1.551 | (809) | CS Disco Inc | Morgan Stanley | (858) |
| (5.032) | Crescent Energy Co 'A' | Bank of America | | 27.613 | CSG Systems | | |
| | | Merrill Lynch | (5.535) | | International Inc | Barclays Bank | 42.524 |
| (9.311) | Crescent Energy Co 'A' | Barclays Bank | (6.331) | 5.334 | CSG Systems | | |
| (8.541) | Crescent Energy Co 'A' | Goldman Sachs | (9.395) | | International Inc | Goldman Sachs | 13.922 |
| (3.017) | Crescent Energy Co 'A' | HSBC | (8.508) | 26.093 | CSG Systems | | |
| 4.476 | Cricut Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.135 | | International Inc | Morgan Stanley | 40.183 |
| (3.195) | Crinetics | Bank of America | | (6.279) | CSW Industrials Inc | Barclays Bank | (3.642) |
| | Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | 12.365 | (2.055) | CSW Industrials Inc | Goldman Sachs | (863) |
| (15.392) | Crinetics | | | (6.266) | CSW Industrials Inc | Morgan Stanley | (3.634) |
| | Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 57.412 | 10.283 | CSX Corp | Bank of America | |
| (1.526) | Crinetics | | | | | Merrill Lynch | (6.677) |
| | Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 5.906 | (4.613) | CSX Corp | Bank of America | |
| (2.614) | Crinetics | | | | | Merrill Lynch | 6.550 |
| | Pharmaceuticals Inc | HSBC | 209 | 9.369 | CSX Corp | Barclays Bank | (53) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------|-------------------------------|---|---|-----------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (7.967) | CSX Corp | Barclays Bank | (4.860) | 17.296 | Curtiss-Wright Corp | Goldman Sachs | 94.090 |
| 19.727 | CSX Corp | Goldman Sachs | (16.921) | 48.000 | Cushman & Wakefield Plc | Barclays Bank | 29.760 |
| (8.927) | CSX Corp | Goldman Sachs | 12.676 | 15.504 | Cushman & Wakefield Plc | Goldman Sachs | 5.736 |
| (34.860) | CSX Corp | HSBC | 63.169 | 7.848 | Custom Truck One Source Inc | Morgan Stanley | 471 |
| 6.573 | CSX Corp | Morgan Stanley | 620 | (3.676) | Customers Bancorp Inc | Barclays Bank | (7.977) |
| (31.920) | CTI BioPharma Corp | Goldman Sachs | (32.878) | (13.182) | Customers Bancorp Inc | Goldman Sachs | (26.628) |
| (5.778) | CTI BioPharma Corp | Morgan Stanley | (2.485) | 1.814 | Cutera Inc | HSBC | (7.836) |
| 6.520 | CTO Newco Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 10.367 | (94.900) | CVB Financial Corp | Barclays Bank | (42.705) |
| 3.212 | CTO Newco Inc (REIT) | Barclays Bank | 10.118 | (43.118) | CVB Financial Corp | Goldman Sachs | (46.999) |
| 9.396 | CTO Newco Inc (REIT) | Goldman Sachs | 14.940 | (103.614) | CVB Financial Corp | HSBC | (92.216) |
| 6.832 | CTO Newco Inc (REIT) | HSBC | 38.737 | 229 | CVR Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 595 |
| 9.414 | CTO Newco Inc (REIT) | Morgan Stanley | 29.654 | 5.965 | CVR Energy Inc | Barclays Bank | 18.372 |
| (11.308) | CTS Corp | Barclays Bank | (28.948) | 913 | CVR Energy Inc | Goldman Sachs | 2.792 |
| (19.478) | CTS Corp | Goldman Sachs | (62.914) | 1.424 | CVR Energy Inc | HSBC | 4.295 |
| (8.364) | CTS Corp | HSBC | (34.460) | 9.116 | CVS Health Corp | Barclays Bank | 15.059 |
| (4.385) | CTS Corp | Morgan Stanley | (11.226) | 22.090 | CVS Health Corp | Goldman Sachs | (23.983) |
| 83.489 | CubeSmart (REIT) | Goldman Sachs | 172.822 | 926 | CVS Health Corp | HSBC | (1.500) |
| 21.834 | CubeSmart (REIT) | HSBC | 71.179 | 10.563 | CVS Health Corp | Morgan Stanley | 17.640 |
| 12.509 | CubeSmart (REIT) | Morgan Stanley | 30.147 | (2.141) | CyberOptics Corp | Barclays Bank | (4.025) |
| 7.085 | Cue Biopharma Inc | Barclays Bank | 1.913 | (5.977) | CyberOptics Corp | Morgan Stanley | (11.237) |
| 14.598 | Cue Biopharma Inc | Goldman Sachs | 3.212 | (11.088) | Cyclerion Therapeutics Inc | HSBC | (276) |
| 2.945 | Cue Biopharma Inc | HSBC | (501) | (28.686) | Cyclerion Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (625) |
| 10.487 | Cue Biopharma Inc | Morgan Stanley | 2.831 | 37.047 | Cymabay Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.595 |
| 5.884 | Cue Health Inc | Barclays Bank | (530) | 7.092 | Cymabay Therapeutics Inc | Barclays Bank | 106 |
| (991) | Cullen/Frost Bankers Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.867) | 51.159 | Cymabay Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 10.488 |
| (10.710) | Cullen/Frost Bankers Inc | Barclays Bank | (37.378) | 13.324 | Cymabay Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 200 |
| (10.316) | Cullen/Frost Bankers Inc | Goldman Sachs | (19.910) | 11.920 | Cytek Biosciences Inc | Barclays Bank | (3.576) |
| (13.471) | Cullen/Frost Bankers Inc | HSBC | 28.196 | 2.776 | Cytek Biosciences Inc | Morgan Stanley | (833) |
| (11.884) | Cullen/Frost Bankers Inc | Morgan Stanley | (41.475) | (13.710) | Cytokinetics Inc | Barclays Bank | (9.323) |
| 4.995 | Cullinan Oncology Inc | Barclays Bank | 849 | (2.602) | Cytokinetics Inc | HSBC | (14.467) |
| 4.852 | Cullinan Oncology Inc | Goldman Sachs | 2.055 | (30.111) | CytomX Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 3.613 |
| 6.187 | Cullinan Oncology Inc | HSBC | 10.250 | (5.451) | CytoSorbents Corp | Bank of America Merrill Lynch | 709 |
| 3.960 | Cullinan Oncology Inc | Morgan Stanley | 673 | (46.950) | CytoSorbents Corp | Barclays Bank | — |
| 9.874 | Culp Inc | Barclays Bank | 2.172 | (14.430) | CytoSorbents Corp | Goldman Sachs | 1.876 |
| 11.998 | Culp Inc | Goldman Sachs | (3.119) | (3.901) | CytoSorbents Corp | Morgan Stanley | — |
| 16.166 | Culp Inc | HSBC | (7.598) | (27.058) | Cytxera Technologies Inc | HSBC | (95.244) |
| 6.426 | Culp Inc | Morgan Stanley | 1.414 | (140) | Daily Journal Corp | Bank of America Merrill Lynch | (4.472) |
| 3.430 | Cummins Inc | Bank of America Merrill Lynch | 15.401 | (259) | Daily Journal Corp | Barclays Bank | (2.691) |
| (1.388) | Cummins Inc | Bank of America Merrill Lynch | (15.320) | 22.600 | Daktronics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.664 |
| 13.183 | Cummins Inc | Barclays Bank | 111.265 | 123.670 | Daktronics Inc | Barclays Bank | 27.207 |
| 8.949 | Cummins Inc | Goldman Sachs | 40.181 | 77.280 | Daktronics Inc | Goldman Sachs | 14.683 |
| (2.683) | Cummins Inc | Goldman Sachs | (27.197) | 64.783 | Daktronics Inc | HSBC | 9.717 |
| (598) | Cummins Inc | HSBC | (2.931) | 47.595 | Daktronics Inc | Morgan Stanley | 10.471 |
| (746) | Cummins Inc | Morgan Stanley | (6.296) | (1.733) | Dana Inc | Barclays Bank | (1.924) |
| 15.269 | Cumulus Media Inc 'A' | Barclays Bank | (13.895) | (48.545) | Dana Inc | Goldman Sachs | (66.432) |
| 14.767 | Cumulus Media Inc 'A' | HSBC | (50.208) | (14.386) | Dana Inc | HSBC | (18.392) |
| 2.131 | CureVac NV | Bank of America Merrill Lynch | 7.480 | (13.905) | Dana Inc | Morgan Stanley | (15.435) |
| 7.929 | CureVac NV | Barclays Bank | (1.031) | 5.402 | Danaher Corp | Bank of America Merrill Lynch | 72.560 |
| 1.953 | CureVac NV | Goldman Sachs | 2.868 | 5.676 | Danaher Corp | Barclays Bank | 50.824 |
| 2.941 | CureVac NV | HSBC | 6.126 | 2.650 | Danaher Corp | Goldman Sachs | 38.714 |
| 3.359 | CureVac NV | Morgan Stanley | 1.119 | 843 | Danaher Corp | HSBC | 16.082 |
| 6.616 | CuriosityStream Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.125) | 6.342 | Danaher Corp | Morgan Stanley | 56.254 |
| 5.396 | CuriosityStream Inc | Barclays Bank | (270) | (14.588) | Danimer Scientific Inc | Barclays Bank | (656) |
| 5.946 | CuriosityStream Inc | Goldman Sachs | (1.011) | 209 | Darden Restaurants Inc | Bank of America Merrill Lynch | (401) |
| 3.116 | CuriosityStream Inc | HSBC | (1.059) | 3.050 | Darden Restaurants Inc | Barclays Bank | 24.552 |
| (21.005) | Curis Inc | Barclays Bank | 1.218 | (6.167) | Darden Restaurants Inc | Barclays Bank | (49.644) |
| (3.022) | Curis Inc | Goldman Sachs | 449 | 2.959 | Darden Restaurants Inc | Goldman Sachs | (2.531) |
| (4.618) | Curis Inc | HSBC | 652 | 8.252 | Darden Restaurants Inc | HSBC | 881 |
| 2.712 | Curo Group Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 380 | 2.813 | Darden Restaurants Inc | Morgan Stanley | 18.176 |
| 4.339 | Curo Group Holdings Corp | Barclays Bank | (87) | (427) | Darden Restaurants Inc | Morgan Stanley | (3.437) |
| 3.789 | Curo Group Holdings Corp | HSBC | 38 | (14.940) | DarioHealth Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.092) |
| 3.670 | Curo Group Holdings Corp | Morgan Stanley | (73) | | | | |
| 6.108 | Curtiss-Wright Corp | Barclays Bank | 14.720 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (9.003) | DarioHealth Corp | Barclays Bank | (1.260) | (36.039) | Delta Air Lines Inc | Goldman Sachs | (80.145) |
| (2.964) | Darling Ingredients Inc | Barclays Bank | (8.507) | 32.258 | Delta Air Lines Inc | Goldman Sachs | 67.522 |
| (13.353) | Darling Ingredients Inc | Goldman Sachs | (74.643) | (4.494) | Delta Air Lines Inc | HSBC | (7.942) |
| (11.319) | Darling Ingredients Inc | HSBC | (106.399) | 5.459 | Delta Air Lines Inc | HSBC | 15.804 |
| 1.597 | DASAN Zhone Solutions Inc | Bank of America | | (7.914) | Delta Apparel Inc | Barclays Bank | 4.828 |
| | | Merrill Lynch | 3.504 | (1.823) | Delta Apparel Inc | Goldman Sachs | 2.935 |
| 6.239 | DASAN Zhone Solutions Inc | Barclays Bank | 16.533 | (4.000) | Delta Apparel Inc | HSBC | 2.040 |
| 9.687 | DASAN Zhone Solutions Inc | Goldman Sachs | 33.614 | (8.580) | Delta Apparel Inc | Morgan Stanley | 5.234 |
| 1.781 | DASAN Zhone Solutions Inc | HSBC | 8.638 | (3.641) | Deluxe Corp | Bank of America | |
| 2.278 | DASAN Zhone Solutions Inc | Morgan Stanley | 6.037 | | | Merrill Lynch | 2.075 |
| (17.390) | Daseke Inc | Bank of America | | (13.139) | Deluxe Corp | Barclays Bank | (1.577) |
| | | Merrill Lynch | 2.087 | (7.803) | Deluxe Corp | Goldman Sachs | 4.448 |
| (4.710) | Daseke Inc | Barclays Bank | (1.743) | (14.352) | Deluxe Corp | HSBC | 36.311 |
| (28.294) | Daseke Inc | Goldman Sachs | 3.395 | 1.176 | Denali Therapeutics Inc | Bank of America | |
| (5.048) | Datadog Inc 'A' | Barclays Bank | (14.033) | | | Merrill Lynch | 1.376 |
| (7.323) | Datadog Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.515 | 14.586 | Denali Therapeutics Inc | Barclays Bank | 583 |
| (1.049) | Datadog Inc 'A' | HSBC | 860 | 1.261 | Denali Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.475 |
| (5.823) | Datadog Inc 'A' | Morgan Stanley | (16.188) | 3.706 | Denali Therapeutics Inc | HSBC | 6.078 |
| 2.241 | Datto Holding Corp | HSBC | 2.656 | 8.163 | Denali Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 327 |
| 12.377 | Dave & Buster's Entertainment Inc | Barclays Bank | 36.512 | (1.327) | Denbury Inc | Barclays Bank | (4.990) |
| 2.825 | Dave & Buster's Entertainment Inc | Goldman Sachs | 876 | (4.364) | Denbury Inc | Goldman Sachs | (38.927) |
| (13.028) | DaVita Inc | Barclays Bank | (35.176) | (2.546) | Denbury Inc | HSBC | (27.624) |
| (1.217) | DaVita Inc | Goldman Sachs | 3.590 | (18.639) | Denny's Corp | Barclays Bank | (12.115) |
| 2.805 | Day One Biopharmaceuticals Inc | Bank of America | | (41.121) | Denny's Corp | Goldman Sachs | (18.093) |
| | | Merrill Lynch | (5.891) | (29.426) | Denny's Corp | HSBC | (5.591) |
| 1.792 | Day One Biopharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (2.634) | 1.085 | DENTSPLY SIRONA Inc | Bank of America | |
| 4.953 | Day One Biopharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (10.401) | | | Merrill Lynch | 1.302 |
| 1.589 | Day One Biopharmaceuticals Inc | HSBC | (3.162) | 24.255 | DENTSPLY SIRONA Inc | Barclays Bank | 23.285 |
| 5.163 | Day One Biopharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (7.590) | 13.080 | DENTSPLY SIRONA Inc | Goldman Sachs | 15.696 |
| 1.440 | Decibel Therapeutics Inc | HSBC | 706 | 14.923 | DENTSPLY SIRONA Inc | HSBC | 5.843 |
| 37.289 | Deciphera Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (15.288) | (12.091) | DermTech Inc | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | 15.466 | | | Merrill Lynch | 2.660 |
| 7.915 | Deciphera Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (3.245) | (13.779) | DermTech Inc | Barclays Bank | (12.677) |
| (220) | Deckers Outdoor Corp | Bank of America | | (7.451) | DermTech Inc | HSBC | (3.055) |
| | | Merrill Lynch | (6.041) | 2.416 | Design Therapeutics Inc | Barclays Bank | (918) |
| (2.323) | Deckers Outdoor Corp | Barclays Bank | (42.581) | 713 | Design Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (271) |
| (1.300) | Deckers Outdoor Corp | Goldman Sachs | (35.698) | 3.407 | Designer Brands Inc 'A' | Bank of America | |
| (1.465) | Deckers Outdoor Corp | HSBC | (43.159) | | | Merrill Lynch | 5.655 |
| (809) | Deckers Outdoor Corp | Morgan Stanley | (14.829) | 3.607 | Designer Brands Inc 'A' | Barclays Bank | 6.781 |
| 676 | Deere & Co | Bank of America | | 10.242 | Designer Brands Inc 'A' | Goldman Sachs | 15.875 |
| | | Merrill Lynch | 1.750 | 15.349 | Designer Brands Inc 'A' | HSBC | 32.386 |
| (1.447) | Deere & Co | Barclays Bank | (34.439) | (10.603) | Desktop Metal Inc 'A' | Barclays Bank | (265) |
| 1.737 | Deere & Co | Barclays Bank | 41.341 | (41.390) | Desktop Metal Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.035) |
| (3.591) | Deere & Co | Goldman Sachs | 54.906 | (4.298) | Destination XL Group Inc | Bank of America | |
| (3.893) | Definitive Healthcare Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (559) |
| | | Merrill Lynch | (9.110) | (19.846) | Destination XL Group Inc | Barclays Bank | (7.938) |
| (6.086) | Definitive Healthcare Corp | HSBC | (11.717) | (32.091) | Destination XL Group Inc | Goldman Sachs | (4.172) |
| (4.617) | Definitive Healthcare Corp | Morgan Stanley | (6.476) | (9.340) | Devon Energy Corp | Bank of America | |
| 8.546 | Delek US Holdings Inc | Barclays Bank | 13.246 | | | Merrill Lynch | (63.512) |
| 7.388 | Delek US Holdings Inc | Goldman Sachs | 11.747 | 16.316 | Devon Energy Corp | Barclays Bank | 109.807 |
| 1.275 | Delek US Holdings Inc | HSBC | 5.112 | (6.043) | Devon Energy Corp | HSBC | (43.200) |
| (3.030) | Dell Technologies Inc 'C' | Bank of America | | (731) | Dexcom Inc | Barclays Bank | 4.934 |
| | | Merrill Lynch | (11.302) | (1.316) | Dexcom Inc | Goldman Sachs | 9.778 |
| 41.319 | Dell Technologies Inc 'C' | Barclays Bank | 311.545 | (1.376) | Dexcom Inc | HSBC | 9.718 |
| (8.882) | Dell Technologies Inc 'C' | Barclays Bank | (66.970) | (1.762) | Dexcom Inc | Morgan Stanley | 11.893 |
| 17.362 | Dell Technologies Inc 'C' | Goldman Sachs | 64.760 | (19.756) | DHI Group Inc | Barclays Bank | 593 |
| (20.870) | Delta Air Lines Inc | Bank of America | | (6.990) | DHI Group Inc | Goldman Sachs | 489 |
| | | Merrill Lynch | (62.088) | (26.141) | DHT Holdings Inc | Barclays Bank | (5.490) |
| (15.399) | Delta Air Lines Inc | Barclays Bank | (25.023) | (34.355) | DHT Holdings Inc | Goldman Sachs | (12.024) |
| 15.461 | Delta Air Lines Inc | Barclays Bank | 25.124 | (37.392) | DHT Holdings Inc | HSBC | (40.009) |
| | | | | (1.911) | Diamond Hill Investment Group Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (11.218) |
| | | | | (2.354) | Diamond Hill Investment Group Inc | Barclays Bank | (15.277) |
| | | | | 20.061 | Diamond Offshore Drilling Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 20.863 |
| | | | | 41.008 | Diamond Offshore Drilling Inc | Barclays Bank | 36.497 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-------------------------------|---|---|-------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 29.841 | Diamond Offshore Drilling Inc | Goldman Sachs | 31.035 | 3.182 | Digital Turbine Inc | HSBC | 4.076 |
| 77.124 | Diamond Offshore Drilling Inc | HSBC | 95.634 | 1.927 | Digital Turbine Inc | Morgan Stanley | 867 |
| 6.227 | Diamond Offshore Drilling Inc | Morgan Stanley | 5.542 | (8.665) | DigitalBridge Group Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.217) |
| 2.497 | Diamondback Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 66.370 | (29.311) | DigitalBridge Group Inc (REIT) | Barclays Bank | (3.224) |
| (405) | Diamondback Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (10.765) | (17.940) | DigitalBridge Group Inc (REIT) | Goldman Sachs | (4.308) |
| 1.974 | Diamondback Energy Inc | Barclays Bank | 42.974 | (62.579) | DigitalBridge Group Inc (REIT) | HSBC | (19.341) |
| (1.117) | Diamondback Energy Inc | Barclays Bank | (24.317) | (230) | DigitalOcean Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.597) |
| 5.574 | Diamondback Energy Inc | Goldman Sachs | 148.157 | 1.784 | DigitalOcean Holdings Inc | Barclays Bank | 11.846 |
| (1.054) | Diamondback Energy Inc | Goldman Sachs | (28.015) | (266) | DigitalOcean Holdings Inc | Barclays Bank | (1.766) |
| 2.578 | Diamondback Energy Inc | HSBC | 72.259 | (13.119) | DigitalOcean Holdings Inc | Goldman Sachs | (148.874) |
| (3.751) | Diamondback Energy Inc | HSBC | (111.737) | (6.370) | DigitalOcean Holdings Inc | HSBC | (103.449) |
| 4.106 | Diamondback Energy Inc | Morgan Stanley | 89.388 | (5.880) | DigitalOcean Holdings Inc | Morgan Stanley | (39.043) |
| 18.961 | DiamondRock Hospitality Co (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 6.636 | (1.049) | Dillard's Inc 'A' | Barclays Bank | (1.254) |
| 21.814 | DiamondRock Hospitality Co (REIT) | Goldman Sachs | 7.635 | 252 | Dillard's Inc 'A' | Barclays Bank | 12.313 |
| 49.148 | DiamondRock Hospitality Co (REIT) | HSBC | 25.021 | (374) | Dillard's Inc 'A' | Goldman Sachs | 10.375 |
| 9.175 | DiamondRock Hospitality Co (REIT) | Morgan Stanley | 6.606 | 1.047 | Dillard's Inc 'A' | Goldman Sachs | (29.044) |
| 1.421 | DICE Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.444) | (1.633) | Dillard's Inc 'A' | HSBC | 17.800 |
| 2.017 | DICE Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (4.054) | (6.715) | Dime Community Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (13.430) |
| 677 | DICE Therapeutics Inc | HSBC | (1.489) | (22.769) | Dime Community Bancshares Inc | Barclays Bank | (37.797) |
| 1.027 | DICE Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (2.321) | (26.858) | Dime Community Bancshares Inc | Goldman Sachs | (53.716) |
| 4.062 | Dick's Sporting Goods Inc | Bank of America Merrill Lynch | (37.045) | (17.675) | Dime Community Bancshares Inc | HSBC | 11.312 |
| 3.587 | Dick's Sporting Goods Inc | Barclays Bank | 21.557 | (23.038) | Dime Community Bancshares Inc | Morgan Stanley | (38.243) |
| 4.693 | Dick's Sporting Goods Inc | Goldman Sachs | (42.800) | (3.667) | Dine Brands Global Inc | Bank of America Merrill Lynch | (17.358) |
| 7.619 | Dick's Sporting Goods Inc | HSBC | (62.090) | (1.741) | Dine Brands Global Inc | Barclays Bank | (10.742) |
| 2.380 | Dick's Sporting Goods Inc | Morgan Stanley | 14.304 | (7.704) | Dine Brands Global Inc | Goldman Sachs | (37.210) |
| (3.901) | Diebold Nixdorf Inc | Barclays Bank | (390) | (8.075) | Dine Brands Global Inc | HSBC | (46.512) |
| (33.648) | Diebold Nixdorf Inc | Goldman Sachs | 2.692 | (2.234) | Dine Brands Global Inc | Morgan Stanley | (13.784) |
| (24.290) | Diebold Nixdorf Inc | HSBC | 16.517 | (3.637) | Diodes Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.838) |
| (7.513) | Digi International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.982) | (3.624) | Diodes Inc | Barclays Bank | (8.661) |
| (1.817) | Digi International Inc | Barclays Bank | 836 | (5.556) | Diodes Inc | Goldman Sachs | (9.710) |
| (26.141) | Digi International Inc | Goldman Sachs | (13.855) | (5.134) | Diodes Inc | HSBC | (11.923) |
| (11.508) | Digi International Inc | HSBC | (26.583) | (815) | Diodes Inc | Morgan Stanley | (1.948) |
| (1.095) | Digi International Inc | Morgan Stanley | 504 | 8.932 | Discover Financial Services | Bank of America Merrill Lynch | 81.996 |
| (780) | Digimarc Corp | Bank of America Merrill Lynch | 796 | 5.010 | Discover Financial Services | Barclays Bank | 20.391 |
| (7.136) | Digimarc Corp | Barclays Bank | (357) | 1.158 | Discover Financial Services | Goldman Sachs | 10.630 |
| (12.409) | Digimarc Corp | Goldman Sachs | 12.657 | 3.386 | Discover Financial Services | HSBC | 15.748 |
| (1.606) | Digital Landscape Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (337) | 11.511 | Discover Financial Services | Morgan Stanley | 46.850 |
| (22.849) | Digital Landscape Group Inc | Barclays Bank | 15.080 | 6.613 | DISH Network Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 10.966 |
| (23.109) | Digital Landscape Group Inc | Goldman Sachs | (4.853) | (20.280) | DISH Network Corp 'A' | Barclays Bank | (38.938) |
| 7.862 | Digital Media Solutions Inc 'A' | Barclays Bank | 1.179 | 20.308 | DISH Network Corp 'A' | Barclays Bank | 38.991 |
| 8.878 | Digital Media Solutions Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.308 | (3.045) | DISH Network Corp 'A' | HSBC | (3.898) |
| (145) | Digital Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.483) | 5.220 | DISH Network Corp 'A' | Morgan Stanley | 10.022 |
| (1.778) | Digital Realty Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | (9.103) | (10.381) | Distribution Solutions Group Inc | Barclays Bank | 3.633 |
| (820) | Digital Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (8.389) | (5.308) | Distribution Solutions Group Inc | Goldman Sachs | 4.140 |
| (3.198) | Digital Realty Trust Inc (REIT) | HSBC | (16.821) | (3.343) | Distribution Solutions Group Inc | HSBC | 29.084 |
| (5.547) | Digital Realty Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (28.401) | (2.877) | Distribution Solutions Group Inc | Morgan Stanley | 1.007 |
| 10.392 | Digital Turbine Inc | Barclays Bank | 4.677 | (2.166) | Diversey Holdings Ltd | Barclays Bank | (1.191) |
| (3.558) | Digital Turbine Inc | Goldman Sachs | (783) | (8.267) | Diversey Holdings Ltd | HSBC | (18.849) |
| | | | | (21.214) | Diversified Healthcare Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.697) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (44.639) | Diversified Healthcare Trust (REIT) | Barclays Bank | (6.696) | 7.654 | Donegal Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.521 |
| (84.355) | Diversified Healthcare Trust (REIT) | Goldman Sachs | (6.748) | 19.217 | Donegal Group Inc 'A' | HSBC | 23.253 |
| (55.134) | Diversified Healthcare Trust (REIT) | HSBC | (9.373) | 24.588 | Donegal Group Inc 'A' | Morgan Stanley | 4.672 |
| (14.390) | Diversified Healthcare Trust (REIT) | Morgan Stanley | (2.159) | 1.450 | Donnelley Financial Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.089 |
| (3.492) | DLH Holdings Corp | Goldman Sachs | (349) | 4.386 | Donnelley Financial Solutions Inc | Barclays Bank | 6.798 |
| (1.085) | DMC Global Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.848) | 5.784 | Donnelley Financial Solutions Inc | Goldman Sachs | 16.311 |
| (3.084) | DMC Global Inc | Barclays Bank | (7.155) | 4.992 | Donnelley Financial Solutions Inc | HSBC | 25.995 |
| (9.302) | DMC Global Inc | Goldman Sachs | (50.138) | 1.538 | Donnelley Financial Solutions Inc | Morgan Stanley | 2.384 |
| (6.054) | DMC Global Inc | HSBC | (30.149) | (594) | DoorDash Inc 'A' | Barclays Bank | (6.029) |
| (1.581) | DMC Global Inc | Morgan Stanley | (3.668) | (2.232) | DoorDash Inc 'A' | Goldman Sachs | (27.163) |
| 12.789 | DocGo Inc | Barclays Bank | 12.150 | (5.523) | DoorDash Inc 'A' | HSBC | (69.723) |
| 6.274 | DocGo Inc | HSBC | 6.149 | (10.042) | DoorDash Inc 'A' | Morgan Stanley | (101.926) |
| 2.403 | DocGo Inc | Morgan Stanley | 2.283 | (34.185) | Dorian LPG Ltd | Barclays Bank | (35.552) |
| (2.298) | DocuSign Inc | Bank of America Merrill Lynch | (18.039) | (18.820) | Dorian LPG Ltd | Goldman Sachs | (18.632) |
| (3.536) | DocuSign Inc | Barclays Bank | (20.261) | 2.378 | Dorman Products Inc | Barclays Bank | 8.466 |
| (3.687) | DocuSign Inc | Goldman Sachs | (34.958) | 6.026 | Dorman Products Inc | Goldman Sachs | 1.145 |
| (1.734) | DocuSign Inc | HSBC | (24.605) | 3.139 | Dorman Products Inc | HSBC | 6.278 |
| (4.323) | DocuSign Inc | Morgan Stanley | (25.504) | (1.126) | DoubleVerify Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.554) |
| (8.242) | Dolby Laboratories Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (20.339) | 1.351 | DoubleVerify Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.864 |
| (11.669) | Dolby Laboratories Inc 'A' | Barclays Bank | (25.788) | (18.629) | DoubleVerify Holdings Inc | Goldman Sachs | (25.708) |
| 7.333 | Dolby Laboratories Inc 'A' | Barclays Bank | 16.206 | (4.991) | DoubleVerify Holdings Inc | HSBC | (14.873) |
| (6.337) | Dolby Laboratories Inc 'A' | Goldman Sachs | (15.808) | 2.748 | DoubleVerify Holdings Inc | HSBC | 8.189 |
| (554) | Dolby Laboratories Inc 'A' | HSBC | (915) | (1.715) | DoubleVerify Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.166 |
| (10.875) | Dolby Laboratories Inc 'A' | Morgan Stanley | (24.034) | 4.328 | DoubleVerify Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.943) |
| 278 | Dollar General Corp | Bank of America Merrill Lynch | 5.650 | 5.048 | Douglas Dynamics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6.260 |
| (3.362) | Dollar General Corp | Barclays Bank | (91.850) | 14.180 | Douglas Dynamics Inc | Barclays Bank | 11.202 |
| 4.083 | Dollar General Corp | Goldman Sachs | (32.959) | 10.776 | Douglas Dynamics Inc | Goldman Sachs | 13.964 |
| (1.275) | Dollar General Corp | Morgan Stanley | (34.833) | 12.953 | Douglas Dynamics Inc | HSBC | 9.235 |
| 3.656 | Dollar General Corp | Morgan Stanley | 99.882 | 2.738 | Douglas Dynamics Inc | Morgan Stanley | 2.163 |
| (9.973) | Dollar Tree Inc | Barclays Bank | (330.106) | (8.580) | Douglas Elliman Inc | Bank of America Merrill Lynch | 343 |
| (360) | Dollar Tree Inc | Goldman Sachs | (590) | (20.802) | Douglas Elliman Inc | Barclays Bank | (1.248) |
| (1.249) | Dollar Tree Inc | Morgan Stanley | (36.585) | (29.002) | Douglas Elliman Inc | Goldman Sachs | 1.160 |
| 13.272 | Doma Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.522 | (9.088) | Douglas Elliman Inc | HSBC | 1.454 |
| 13.822 | Doma Holdings Inc | HSBC | 5.529 | (3.430) | Douglas Elliman Inc | Morgan Stanley | (206) |
| 3.173 | Doma Holdings Inc | Morgan Stanley | 412 | 45.497 | Douglas Emmett Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 23.316 |
| (3.445) | Dominion Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.101) | 15.915 | Douglas Emmett Inc (REIT) | Barclays Bank | 3.625 |
| (27.080) | Dominion Energy Inc | Barclays Bank | (33.308) | 34.852 | Douglas Emmett Inc (REIT) | Goldman Sachs | 18.853 |
| (9.937) | Dominion Energy Inc | Goldman Sachs | (3.715) | 38.899 | Douglas Emmett Inc (REIT) | HSBC | 15.204 |
| (62.275) | Dominion Energy Inc | Morgan Stanley | (76.599) | 19.275 | Douglas Emmett Inc (REIT) | Morgan Stanley | 5.124 |
| (1.632) | Domino's Pizza Inc | Bank of America Merrill Lynch | (51.344) | (4.689) | Dova Pharmaceuticals Inc ¹¹ | HSBC | — |
| 1.525 | Domino's Pizza Inc | Barclays Bank | 29.707 | (13.883) | Dover Corp | Bank of America Merrill Lynch | 9.440 |
| (1.915) | Domino's Pizza Inc | Barclays Bank | (37.304) | (9.865) | Dover Corp | Barclays Bank | (18.645) |
| 965 | Domino's Pizza Inc | Goldman Sachs | 25.129 | (5.783) | Dover Corp | Goldman Sachs | 670 |
| (1.854) | Domino's Pizza Inc | Goldman Sachs | (47.721) | (8.307) | Dover Corp | HSBC | 10.743 |
| 2.685 | Domino's Pizza Inc | HSBC | 77.570 | (8.330) | Dover Corp | Morgan Stanley | (15.744) |
| (395) | Domino's Pizza Inc | HSBC | (11.412) | (6.309) | Dow Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.344) |
| 4.271 | Domo Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 1.666 | (45.003) | Dow Inc | Barclays Bank | (45.903) |
| 2.244 | Domo Inc 'B' | Barclays Bank | 4.959 | (34.908) | Dow Inc | Goldman Sachs | (18.501) |
| 3.108 | Domo Inc 'B' | Goldman Sachs | 2.311 | (1.084) | Dow Inc | HSBC | (2.163) |
| 373 | Domo Inc 'B' | Morgan Stanley | 824 | (27.150) | Dow Inc | Morgan Stanley | (27.693) |
| 8.944 | Donaldson Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 16.189 | (4.510) | Doximity Inc 'A' | Barclays Bank | (11.952) |
| 52.971 | Donaldson Co Inc | Barclays Bank | 84.754 | (5.972) | Doximity Inc 'A' | Goldman Sachs | (17.618) |
| 45.141 | Donaldson Co Inc | Goldman Sachs | 81.705 | (9.172) | Doximity Inc 'A' | HSBC | (38.469) |
| 30.431 | Donaldson Co Inc | HSBC | 41.925 | (4.014) | Doximity Inc 'A' | Morgan Stanley | (10.637) |
| 17.236 | Donaldson Co Inc | Morgan Stanley | 26.823 | (10.220) | DR Horton Inc | Barclays Bank | (62.751) |
| 36.445 | Donegal Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 16.765 | 17.184 | DR Horton Inc | Barclays Bank | 105.510 |
| 35.388 | Donegal Group Inc 'A' | Barclays Bank | 6.724 | (59.962) | DR Horton Inc | Goldman Sachs | (318.401) |
| | | | | 6.133 | DR Horton Inc | Goldman Sachs | 31.953 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|-------------------------------|---|---|-------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (49.503) | DR Horton Inc | HSBC | (180.686) | (42.189) | Dun & Bradstreet Holdings Inc | Barclays Bank | (16.032) |
| (7.342) | DR Horton Inc | Morgan Stanley | (45.080) | (125.198) | Dun & Bradstreet Holdings Inc | Goldman Sachs | (152.742) |
| 5.810 | DR Horton Inc | Morgan Stanley | 29.832 | (11.524) | Dun & Bradstreet Holdings Inc | HSBC | (31.115) |
| 3.560 | DraftKings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 5.091 | (2.113) | Duolingo Inc | Barclays Bank | (9.551) |
| 30.176 | DraftKings Inc 'A' | Barclays Bank | (905) | 10.735 | DuPont de Nemours Inc | Barclays Bank | 26.301 |
| 22.458 | DraftKings Inc 'A' | Goldman Sachs | 32.115 | (14.918) | DuPont de Nemours Inc | Barclays Bank | (36.599) |
| 7.409 | DraftKings Inc 'A' | HSBC | (26.821) | (2.248) | DuPont de Nemours Inc | Goldman Sachs | (4.749) |
| 12.068 | DraftKings Inc 'A' | Morgan Stanley | (362) | 27.499 | DuPont de Nemours Inc | HSBC | 98.721 |
| 2.878 | Dril-Quip Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9.224 | (1.434) | DuPont de Nemours Inc | HSBC | (5.234) |
| 10.825 | Dril-Quip Inc | Barclays Bank | 28.548 | 13.132 | DuPont de Nemours Inc | Morgan Stanley | 32.173 |
| 4.193 | Dril-Quip Inc | Goldman Sachs | 14.584 | (52.906) | Durect Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3.497) |
| 769 | Dril-Quip Inc | HSBC | 2.153 | (33.312) | Durect Corp | Barclays Bank | (1.749) |
| 1.028 | Dril-Quip Inc | Morgan Stanley | 2.724 | (94.579) | Durect Corp | Goldman Sachs | (6.252) |
| 13.174 | Drive Shack Inc | Bank of America Merrill Lynch | (66) | 1.405 | DXC Technology Co | Bank of America Merrill Lynch | 7.713 |
| (1.919) | Driven Brands Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.557) | 18.443 | DXC Technology Co | Barclays Bank | 93.321 |
| (11.358) | Driven Brands Holdings Inc | Barclays Bank | (28.849) | 6.019 | DXC Technology Co | Goldman Sachs | 33.044 |
| (17.618) | Driven Brands Holdings Inc | Goldman Sachs | (50.564) | 1.014 | DXC Technology Co | HSBC | 7.027 |
| (3.340) | Driven Brands Holdings Inc | HSBC | (9.185) | 2.858 | DXC Technology Co | Morgan Stanley | 14.461 |
| 2.339 | Driven Brands Holdings Inc | HSBC | 6.432 | (10.383) | DXP Enterprises Inc | Barclays Bank | (14.536) |
| (4.703) | Driven Brands Holdings Inc | Morgan Stanley | (11.946) | (4.691) | DXP Enterprises Inc | Goldman Sachs | (9.757) |
| 2.787 | Driven Brands Holdings Inc | Morgan Stanley | 7.079 | (4.002) | DXP Enterprises Inc | HSBC | (32.976) |
| (6.178) | Dropbox Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (3.583) | 72 | Dyadic International Inc | Barclays Bank | 9 |
| (5.846) | Dropbox Inc 'A' | Barclays Bank | (2.397) | (4.680) | Dycom Industries Inc | Barclays Bank | (55.383) |
| (96.116) | Dropbox Inc 'A' | Goldman Sachs | (55.747) | (762) | Dycom Industries Inc | Goldman Sachs | (10.455) |
| (24.174) | Dropbox Inc 'A' | HSBC | (8.944) | (3.326) | Dynatrace Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.313 |
| (32.644) | Dropbox Inc 'A' | Morgan Stanley | (13.384) | (6.573) | Dynatrace Inc | Barclays Bank | 4.876 |
| 15.967 | DT Midstream Inc | Barclays Bank | 27.304 | 10.339 | Dynatrace Inc | Goldman Sachs | 37.841 |
| (6.715) | DT Midstream Inc | Barclays Bank | (11.483) | 6.675 | Dynatrace Inc | HSBC | 34.977 |
| 9.020 | DT Midstream Inc | Goldman Sachs | 21.648 | (7.124) | Dynatrace Inc | HSBC | (32.857) |
| (6.492) | DT Midstream Inc | Goldman Sachs | (10.951) | (3.047) | Dynatrace Inc | Morgan Stanley | 2.499 |
| 3.565 | DT Midstream Inc | HSBC | 14.723 | (5.949) | Dynavax Technologies Corp | Bank of America Merrill Lynch | (13.266) |
| 1.663 | DTE Energy Co | Bank of America Merrill Lynch | 3.559 | (12.359) | Dynavax Technologies Corp | Barclays Bank | (7.910) |
| 31.449 | DTE Energy Co | Barclays Bank | 54.092 | (6.100) | Dynavax Technologies Corp | Goldman Sachs | (13.603) |
| 42.211 | DTE Energy Co | Goldman Sachs | 94.155 | (11.469) | Dynavax Technologies Corp | HSBC | (44.500) |
| 50.894 | DTE Energy Co | HSBC | 141.412 | 2.813 | Dyne Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.250) |
| 3.398 | DTE Energy Co | Morgan Stanley | 5.845 | 14.800 | Dyne Therapeutics Inc | Barclays Bank | (6.216) |
| 1.945 | Duck Creek Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.112 | 3.161 | Dyne Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (2.529) |
| 12.359 | Duck Creek Technologies Inc | Barclays Bank | 4.449 | 11.005 | Dyne Therapeutics Inc | HSBC | (12.216) |
| 4.409 | Duck Creek Technologies Inc | Goldman Sachs | 7.054 | 9.160 | Dyne Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (3.847) |
| 7.870 | Duck Creek Technologies Inc | HSBC | 21.056 | (95.409) | Dynex Capital Inc (REIT) | Barclays Bank | (22.898) |
| 4.041 | Duck Creek Technologies Inc | Morgan Stanley | 1.455 | (31.657) | Dynex Capital Inc (REIT) | Morgan Stanley | (7.598) |
| 13.382 | Duckhorn Portfolio Inc | Goldman Sachs | (3.212) | 18.407 | E2open Parent Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.731 |
| 18.051 | Duckhorn Portfolio Inc | HSBC | 2.347 | 21.439 | E2open Parent Holdings Inc | Barclays Bank | 4.288 |
| 1.081 | Ducommun Inc | Bank of America Merrill Lynch | (605) | 10.138 | E2open Parent Holdings Inc | HSBC | 2.535 |
| 15.472 | Ducommun Inc | Barclays Bank | 24.291 | 4.154 | E2open Parent Holdings Inc | Morgan Stanley | 831 |
| 11.278 | Ducommun Inc | Goldman Sachs | (6.316) | (30.095) | Eagle Bancorp Inc | Barclays Bank | (13.242) |
| 4.614 | Ducommun Inc | HSBC | (12.827) | (41.083) | Eagle Bancorp Inc | Goldman Sachs | (29.169) |
| 943 | Ducommun Inc | Morgan Stanley | 1.481 | 7.335 | Eagle Bancorp Montana Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.447 |
| (50.304) | Duke Energy Corp | Bank of America Merrill Lynch | (131.797) | 9.274 | Eagle Bancorp Montana Inc | Barclays Bank | 1.391 |
| (47.541) | Duke Energy Corp | Barclays Bank | (87.475) | 12.346 | Eagle Bancorp Montana Inc | Goldman Sachs | 5.803 |
| (23.214) | Duke Energy Corp | HSBC | (53.034) | 6.341 | Eagle Bancorp Montana Inc | HSBC | (1.015) |
| (56.262) | Duke Energy Corp | Morgan Stanley | (103.522) | 15.154 | Eagle Bancorp Montana Inc | Morgan Stanley | 2.273 |
| (22.395) | Duke Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | (46.806) | (5.028) | Eagle Bulk Shipping Inc | Barclays Bank | (2.981) |
| (22.331) | Duke Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | 7.146 | (454) | Eagle Bulk Shipping Inc | Goldman Sachs | (781) |
| 2.331 | Duluth Holdings Inc 'B' | Goldman Sachs | 1.166 | 747 | Eagle Materials Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6.738 |
| 3.244 | Duluth Holdings Inc 'B' | HSBC | 195 | (43.736) | Eagle Materials Inc | Barclays Bank | (251.482) |
| 6.196 | Duluth Holdings Inc 'B' | Morgan Stanley | 9.046 | (13.022) | Eagle Materials Inc | Goldman Sachs | (117.458) |
| | | | | 2.290 | Eagle Materials Inc | Goldman Sachs | 20.656 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|----------------------------------|---|---|----------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.142 | Eagle Materials Inc | Morgan Stanley | 6.193 | (791) | Ebix Inc | HSBC | (313) |
| (1.149) | Eagle Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.298) | 31.280 | EchoStar Corp 'A' | Barclays Bank | 72.569 |
| (2.886) | Eagle Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (3.059) | 21.070 | EchoStar Corp 'A' | Goldman Sachs | 68.899 |
| (949) | Eagle Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (1.898) | 6.706 | EchoStar Corp 'A' | HSBC | 18.240 |
| (826) | Eagle Pharmaceuticals Inc | HSBC | (3.486) | 949 | Ecolab Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.151 |
| 7.944 | Eargo Inc | Barclays Bank | 1.549 | 17.237 | Ecolab Inc | Barclays Bank | 24.821 |
| 5.785 | Eargo Inc | Goldman Sachs | (1.012) | 456 | Ecolab Inc | Goldman Sachs | (139) |
| 1.864 | Eargo Inc | Morgan Stanley | 363 | 28.680 | Ecolab Inc | HSBC | (17.954) |
| (7.659) | Earthstone Energy Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (30.789) | 2.241 | Ecolab Inc | Morgan Stanley | 3.227 |
| (20.654) | Earthstone Energy Inc 'A' | Barclays Bank | (42.960) | 4.588 | Ecovyst Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.973 |
| (8.730) | Earthstone Energy Inc 'A' | Goldman Sachs | (35.095) | 21.930 | Ecovyst Inc | Barclays Bank | 877 |
| (10.941) | Earthstone Energy Inc 'A' | Morgan Stanley | (22.757) | 31.154 | Ecovyst Inc | Goldman Sachs | 13.396 |
| 4.086 | East West Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.475 | 25.951 | Ecovyst Inc | HSBC | 22.577 |
| 8.784 | East West Bancorp Inc | Barclays Bank | 15.460 | 2.007 | Ecovyst Inc | Morgan Stanley | 80 |
| 21.985 | East West Bancorp Inc | Goldman Sachs | 29.459 | (5.976) | Edgewell Personal Care Co | Bank of America Merrill Lynch | 3.944 |
| 7.074 | East West Bancorp Inc | HSBC | 7.711 | (14.048) | Edgewell Personal Care Co | Barclays Bank | (21.634) |
| 583 | East West Bancorp Inc | Morgan Stanley | 1.026 | (14.170) | Edgewell Personal Care Co | Goldman Sachs | 9.352 |
| 71.356 | Easterly Government Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | 10.703 | (1.729) | Edgewell Personal Care Co | HSBC | 5.498 |
| 112.026 | Easterly Government Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 45.931 | 6.148 | Edgewise Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.886) |
| 10.273 | Easterly Government Properties Inc (REIT) | HSBC | 8.834 | 8.055 | Edgewise Therapeutics Inc | Barclays Bank | (8.861) |
| (96.731) | Eastern Bankshares Inc | Barclays Bank | (79.319) | 10.023 | Edgewise Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (3.296) |
| (100.880) | Eastern Bankshares Inc | Goldman Sachs | (96.845) | 3.802 | Edgewise Therapeutics Inc | HSBC | (3.681) |
| (9.560) | Eastern Bankshares Inc | HSBC | (5.067) | 8.320 | Edison International | Bank of America Merrill Lynch | 7.629 |
| (14.594) | Eastern Co | Bank of America Merrill Lynch | (22.621) | 9.696 | Edison International | Barclays Bank | 24.787 |
| (11.685) | Eastern Co | Barclays Bank | (5.258) | (37.949) | Edison International | Goldman Sachs | (99.806) |
| (14.491) | Eastern Co | Goldman Sachs | (22.461) | 10.435 | Edison International | Goldman Sachs | 27.444 |
| (2.590) | Eastern Co | HSBC | 2.202 | (13.402) | Edison International | HSBC | 11.258 |
| (1.315) | Eastern Co | Morgan Stanley | (592) | 7.801 | Edison International | HSBC | 21.850 |
| 2.190 | EastGroup Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (9.204) | 1.981 | Editas Medicine Inc | Bank of America Merrill Lynch | 971 |
| 20.592 | EastGroup Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | 95.135 | 9.393 | Editas Medicine Inc | Barclays Bank | 6.951 |
| 14.349 | EastGroup Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (69.383) | 12.372 | Editas Medicine Inc | Goldman Sachs | 6.781 |
| 4.678 | EastGroup Properties Inc (REIT) | HSBC | (9.469) | 9.241 | Editas Medicine Inc | HSBC | 4.689 |
| 4.455 | EastGroup Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 20.583 | 4.549 | Edwards Lifesciences Corp | Bank of America Merrill Lynch | 15.050 |
| (2.642) | Eastman Chemical Co | Bank of America Merrill Lynch | (16.513) | (3.294) | Edwards Lifesciences Corp | Bank of America Merrill Lynch | (13.011) |
| (5.150) | Eastman Chemical Co | Barclays Bank | (32.600) | 3.840 | Edwards Lifesciences Corp | Barclays Bank | 14.562 |
| 7.764 | Eastman Chemical Co | Barclays Bank | 37.952 | 6.813 | Edwards Lifesciences Corp | Goldman Sachs | 29.501 |
| (4.685) | Eastman Chemical Co | Goldman Sachs | (29.281) | (4.280) | Edwards Lifesciences Corp | HSBC | (22.213) |
| 3.822 | Eastman Chemical Co | Goldman Sachs | 17.077 | 7.906 | Edwards Lifesciences Corp | Morgan Stanley | 22.930 |
| (469) | Eastman Chemical Co | HSBC | (2.898) | (2.554) | Edwards Lifesciences Corp | Morgan Stanley | (9.578) |
| 665 | Eastman Chemical Co | HSBC | 4.110 | 8.681 | eGain Corp | Barclays Bank | 1.042 |
| (10.813) | Eastman Chemical Co | Morgan Stanley | (68.446) | 17.608 | eGain Corp | Goldman Sachs | 1.056 |
| 2.481 | Eastman Chemical Co | Morgan Stanley | 15.705 | 2.617 | eHealth Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.125) |
| (69.342) | Eastman Kodak Co | Barclays Bank | (15.255) | 3.152 | eHealth Inc | Barclays Bank | 2.459 |
| (30.578) | Eastman Kodak Co | HSBC | 8.868 | 4.900 | eHealth Inc | Goldman Sachs | (2.107) |
| 1.871 | Eaton Corp Plc | Bank of America Merrill Lynch | (3.031) | 8.977 | Eiger | Goldman Sachs | (3.052) |
| 40.311 | Eaton Corp Plc | Barclays Bank | 29.722 | 7.335 | Eiger | BioPharmaceuticals Inc HSBC | (3.227) |
| 10.391 | Eaton Corp Plc | Goldman Sachs | (16.833) | 43.231 | El Pollo Loco Holdings Inc | Barclays Bank | 10.808 |
| 4.594 | Eaton Corp Plc | HSBC | 2.288 | 5.412 | El Pollo Loco Holdings Inc | Goldman Sachs | (433) |
| (1.246) | eBay Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.427) | 8.798 | El Pollo Loco Holdings Inc | HSBC | (2.287) |
| 3.882 | eBay Inc | Barclays Bank | 11.751 | 18.014 | El Pollo Loco Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.504 |
| (4.203) | eBay Inc | Barclays Bank | (11.138) | 98 | Elah Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (294) |
| 18.936 | eBay Inc | Goldman Sachs | 50.102 | 87 | Elah Holdings Inc | Morgan Stanley | (348) |
| (9.555) | eBay Inc | Goldman Sachs | (20.904) | 1.619 | Elanco Animal Health Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.085 |
| 1.739 | eBay Inc | HSBC | 2.225 | (22.905) | Elanco Animal Health Inc | Barclays Bank | (7.732) |
| (18.010) | Ebix Inc | Barclays Bank | 13.147 | 1.998 | Elanco Animal Health Inc | Barclays Bank | 579 |
| | | | | 5.944 | Elanco Animal Health Inc | Goldman Sachs | 3.982 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (1.729) | Elanco Animal Health Inc | HSBC | (324) | (16.114) | EMCORE Corp | Goldman Sachs | (2.256) |
| 11.975 | Elanco Animal Health Inc | HSBC | 25.626 | (7.503) | EMCORE Corp | HSBC | (1.200) |
| (2.299) | Elanco Animal Health Inc | Morgan Stanley | (667) | 35.290 | Emerald Holding Inc | Bank of America | |
| 6.100 | Elanco Animal Health Inc | Morgan Stanley | 1.769 | | | Merrill Lynch | 13.057 |
| 4.536 | Elastic NV | Bank of America | | 960 | Emergent BioSolutions Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 16.149 | | | Merrill Lynch | 5.136 |
| 6.609 | Elastic NV | Barclays Bank | 15.663 | 6.711 | Emergent BioSolutions Inc | Barclays Bank | (18.120) |
| 6.273 | Elastic NV | Goldman Sachs | 22.053 | 6.699 | Emergent BioSolutions Inc | HSBC | 22.138 |
| 9.332 | Elastic NV | HSBC | 41.807 | (14.586) | Emerson Electric Co | Barclays Bank | (38.471) |
| 2.983 | Elastic NV | Morgan Stanley | 7.070 | (51.872) | Emerson Electric Co | Goldman Sachs | (171.565) |
| (11.484) | Electromed Inc | Goldman Sachs | 8.958 | (12.826) | Emerson Electric Co | HSBC | (41.967) |
| (3.329) | Electromed Inc | HSBC | 3.595 | 113.968 | Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Barclays Bank | 37.609 |
| (6.328) | Electronic Arts Inc | Goldman Sachs | (64.862) | 26.992 | Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT) | HSBC | 779 |
| 5.633 | Electronic Arts Inc | Goldman Sachs | 57.738 | 23.806 | Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Morgan Stanley | 7.856 |
| (3.457) | Element Solutions Inc | Bank of America | | (12.923) | Employers Holdings Inc | Barclays Bank | 4.782 |
| | | Merrill Lynch | (2.869) | (17.284) | Employers Holdings Inc | Goldman Sachs | (10.889) |
| (60.269) | Element Solutions Inc | Barclays Bank | (30.738) | (5.246) | Employers Holdings Inc | HSBC | (6.243) |
| (31.848) | Element Solutions Inc | Goldman Sachs | (24.946) | (4.473) | Employers Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.655 |
| (64.037) | Element Solutions Inc | Morgan Stanley | (32.659) | (7.667) | Enact Holdings Inc | Bank of America | |
| 10.003 | Elevate Credit Inc | Goldman Sachs | 3.401 | | | Merrill Lynch | (8.587) |
| 1.319 | Elevate Credit Inc | HSBC | 488 | (10.979) | Enact Holdings Inc | Barclays Bank | (1.098) |
| 9.673 | Elevate Credit Inc | Morgan Stanley | 1.257 | (22.508) | Enact Holdings Inc | Goldman Sachs | (25.209) |
| 392 | Elevation Oncology Inc | Barclays Bank | (298) | (37.748) | Enact Holdings Inc | HSBC | (54.735) |
| 352 | Elevation Oncology Inc | Goldman Sachs | (436) | 3.006 | Enanta Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| 278 | Elevation Oncology Inc | HSBC | (261) | | | Merrill Lynch | (28.377) |
| 115 | Elevation Oncology Inc | Morgan Stanley | (87) | 4.282 | Enanta Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (40.422) |
| (7.667) | elf Beauty Inc | Bank of America | | 1.220 | Enanta Pharmaceuticals Inc | HSBC | (16.592) |
| | | Merrill Lynch | (33.165) | 3.167 | Enanta Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (9.944) |
| (2.191) | elf Beauty Inc | Barclays Bank | (9.399) | (2.382) | Enbridge Inc | Bank of America | |
| (17.810) | elf Beauty Inc | Goldman Sachs | (50.937) | | | Merrill Lynch | (4.431) |
| (3.704) | elf Beauty Inc | HSBC | (14.077) | (2.277) | Encompass Health Corp | Bank of America | |
| (1.055) | elf Beauty Inc | Morgan Stanley | (4.526) | | | Merrill Lynch | (2.677) |
| (280) | Eli Lilly & Co | Bank of America | | (7.258) | Encompass Health Corp | Barclays Bank | (6.097) |
| | | Merrill Lynch | (3.693) | (32.131) | Encompass Health Corp | Goldman Sachs | (11.246) |
| (389) | Eli Lilly & Co | Barclays Bank | (3.878) | (2.801) | Encompass Health Corp | HSBC | (3.473) |
| (2.571) | Eli Lilly & Co | Goldman Sachs | (35.026) | 1.458 | Encore Capital Group Inc | Bank of America | |
| (1.326) | Eli Lilly & Co | Morgan Stanley | (13.220) | | | Merrill Lynch | 1.881 |
| (13.910) | Ellington Residential Mortgage (REIT) | Barclays Bank | (3.895) | 10.172 | Encore Capital Group Inc | Barclays Bank | 25.125 |
| (22.111) | Ellington Residential Mortgage (REIT) | Goldman Sachs | (3.096) | 7.114 | Encore Capital Group Inc | Goldman Sachs | 9.048 |
| (10.401) | Ellington Residential Mortgage (REIT) | HSBC | (832) | 5.377 | Encore Capital Group Inc | HSBC | (11.507) |
| (8.968) | Ellington Residential Mortgage (REIT) | Morgan Stanley | (2.511) | 782 | Encore Capital Group Inc | Morgan Stanley | 1.932 |
| (6.350) | Eloxx Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 316 | 2.942 | Encore Wire Corp | Barclays Bank | 17.770 |
| (19.449) | Eloxx Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 401 | 1.794 | Encore Wire Corp | Goldman Sachs | 1.328 |
| (6.669) | Eloxx Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 331 | 1.823 | Encore Wire Corp | HSBC | 182 |
| (32.324) | Embark Technology Inc | Barclays Bank | 3.717 | (2.407) | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | Bank of America | |
| (2.342) | Embecka Corp | Bank of America | | 6.915 | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | Merrill Lynch | (7.245) |
| | | Merrill Lynch | (328) | | | Bank of America | |
| (6.999) | Embecka Corp | Barclays Bank | 7.629 | (3.879) | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | Merrill Lynch | 20.814 |
| 10.198 | Embecka Corp | Goldman Sachs | 1.428 | | | Goldman Sachs | (11.676) |
| 2.268 | Embecka Corp | HSBC | (8.278) | 9.633 | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 28.995 |
| 12.150 | Embecka Corp | Morgan Stanley | (13.244) | (2.185) | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | HSBC | (9.199) |
| 9.949 | EMCOR Group Inc | Bank of America | | 9.504 | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | HSBC | 43.813 |
| | | Merrill Lynch | 39.504 | (5.324) | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | (4.046) |
| (532) | EMCOR Group Inc | Bank of America | | 4.729 | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 3.594 |
| | | Merrill Lynch | (2.293) | 24.326 | Endo International Plc | Barclays Bank | 2.693 |
| 5.333 | EMCOR Group Inc | Barclays Bank | 20.398 | 34.982 | Endo International Plc | Goldman Sachs | (22.514) |
| (8.857) | EMCOR Group Inc | Barclays Bank | (34.365) | 6.449 | Energizer Holdings Inc | Bank of America | |
| 8.087 | EMCOR Group Inc | Goldman Sachs | 34.855 | | | Merrill Lynch | (11.284) |
| (5.143) | EMCOR Group Inc | Goldman Sachs | (22.166) | 4.267 | Energizer Holdings Inc | Barclays Bank | (4.523) |
| 13.814 | EMCOR Group Inc | HSBC | 37.906 | 14.598 | Energizer Holdings Inc | Goldman Sachs | (38.247) |
| (3.543) | EMCOR Group Inc | HSBC | (11.883) | 36.725 | Energizer Holdings Inc | HSBC | (113.230) |
| 2.040 | EMCOR Group Inc | Morgan Stanley | 5.368 | | | | |
| (2.823) | EMCOR Group Inc | Morgan Stanley | (10.953) | | | | |
| (21.126) | EMCORE Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (2.426) | | | | |
| (24.699) | EMCORE Corp | Barclays Bank | (4.693) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|-----------------|---|---|-------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 2.054 | Ennergizer Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.177) | 26.451 | Entergy Corp | Barclays Bank | 71.973 |
| 4.546 | Energy Fuels Inc | Bank of America | | 34.597 | Entergy Corp | Goldman Sachs | 58.615 |
| | | Merrill Lynch | 3.228 | 30.608 | Entergy Corp | HSBC | 13.335 |
| 5.474 | Energy Fuels Inc | Barclays Bank | 1.697 | 3.029 | Entergy Corp | Morgan Stanley | 8.330 |
| 11.245 | Energy Fuels Inc | Goldman Sachs | 7.984 | 3.532 | Enterprise Bancorp Inc | Barclays Bank | 5.651 |
| 7.593 | Energy Fuels Inc | HSBC | 5.847 | 11.997 | Enterprise Bancorp Inc | Goldman Sachs | 5.159 |
| 1.847 | Energy Fuels Inc | Morgan Stanley | 573 | 16.791 | Enterprise Bancorp Inc | Morgan Stanley | 26.866 |
| (36.590) | Energy Recovery Inc | Barclays Bank | (42.810) | (585) | Enterprise Financial Services Corp | Bank of America | |
| (22.852) | Energy Recovery Inc | Goldman Sachs | (60.786) | | Enterprise Financial Services Corp | Merrill Lynch | (1.825) |
| (22.922) | Energy Recovery Inc | HSBC | (54.130) | (30.053) | Enterprise Financial Services Corp | Barclays Bank | (37.011) |
| (1.156) | Enerpac Tool Group Corp | Bank of America | | (13.949) | Enterprise Financial Services Corp | Goldman Sachs | (43.521) |
| | | Merrill Lynch | 231 | (12.568) | Enterprise Financial Services Corp | HSBC | (19.103) |
| (19.553) | Enerpac Tool Group Corp | Barclays Bank | 1.173 | (484) | Enterprise Financial Services Corp | Morgan Stanley | 51 |
| (30.128) | Enerpac Tool Group Corp | Goldman Sachs | 6.026 | 5.887 | Entravision Communications Corp 'A' | Bank of America | |
| (35.728) | Enerpac Tool Group Corp | Morgan Stanley | 2.144 | 13.762 | Entravision Communications Corp 'A' | Merrill Lynch | 1.766 |
| (4.333) | EnerSys | Barclays Bank | (22.792) | 14.393 | Entravision Communications Corp 'A' | Barclays Bank | 413 |
| (43.272) | EnerSys | Goldman Sachs | (277.374) | (44.864) | Envela Corp | Goldman Sachs | 4.318 |
| (4.205) | EnerSys | HSBC | (25.735) | (15.392) | Envela Corp | Bank of America | (14.356) |
| (7.361) | EnerSys | Morgan Stanley | (38.719) | (14.311) | Envela Corp | Merrill Lynch | (2.906) |
| 18.037 | Eneti Inc | Barclays Bank | 9.379 | 712 | Envista Holdings Corp | Goldman Sachs | (4.580) |
| 10.036 | Eneti Inc | HSBC | 12.043 | | Envista Holdings Corp | Bank of America | |
| (5.026) | Enfusion Inc 'A' | Barclays Bank | (2.312) | (7.526) | Envista Holdings Corp | Merrill Lynch | 833 |
| (32.453) | Enfusion Inc 'A' | HSBC | 18.174 | 6.254 | Envista Holdings Corp | Bank of America | (12.643) |
| 5.054 | EngageSmart Inc | Barclays Bank | 606 | (7.465) | Envista Holdings Corp | Goldman Sachs | 7.317 |
| 13.183 | EngageSmart Inc | Goldman Sachs | 19.115 | 5.836 | Envista Holdings Corp | Goldman Sachs | (5.745) |
| 12.845 | EngageSmart Inc | HSBC | 20.295 | (2.210) | Envista Holdings Corp | HSBC | 7.712 |
| 40.399 | EnLink Midstream LLC (Unit) | Bank of America | | 8.121 | Envista Holdings Corp | HSBC | (2.622) |
| | | Merrill Lynch | 35.753 | (1.041) | Envista Holdings Corp | Morgan Stanley | 4.629 |
| 30.149 | EnLink Midstream LLC (Unit) | Barclays Bank | 27.285 | (12.491) | Enzo Biochem Inc | Morgan Stanley | (1.085) |
| 12.707 | EnLink Midstream LLC (Unit) | Goldman Sachs | 11.246 | (7.486) | Enzo Biochem Inc | Barclays Bank | 1.499 |
| 56.775 | Ennis Inc | Bank of America | 21.007 | 31.023 | EOG Resources Inc | Barclays Bank | 368.994 |
| | | Merrill Lynch | 3.740 | 22.722 | EOG Resources Inc | HSBC | 490.530 |
| 6.448 | Ennis Inc | Barclays Bank | 3.740 | 450 | EOG Resources Inc | Morgan Stanley | 5.360 |
| 26.613 | Ennis Inc | Goldman Sachs | 9.847 | (116) | EPAM Systems Inc | Barclays Bank | (1.029) |
| 24.776 | Ennis Inc | HSBC | 9.167 | 261 | EPAM Systems Inc | Goldman Sachs | 3.323 |
| 4.175 | Ennis Inc | Morgan Stanley | 2.422 | (750) | EPAM Systems Inc | Goldman Sachs | (9.852) |
| 5.655 | Enochian Biosciences Inc | Goldman Sachs | (4.581) | (158) | EPAM Systems Inc | Morgan Stanley | (1.401) |
| 8.072 | Enova International Inc | Barclays Bank | 4.440 | (33.571) | Epizyme Inc | Barclays Bank | 1.390 |
| 9.766 | Enova International Inc | Goldman Sachs | 7.032 | (63.386) | Epizyme Inc | Goldman Sachs | 3.740 |
| 2.583 | Enova International Inc | Morgan Stanley | 1.421 | (3.655) | Epizyme Inc | HSBC | 655 |
| 7.707 | Enovis Corp | Bank of America | | (9.180) | Epizyme Inc | Morgan Stanley | 380 |
| | | Merrill Lynch | 10.890 | 34.641 | ePlus Inc | Barclays Bank | 2.771 |
| 32.754 | Enovis Corp | Barclays Bank | 20.963 | (2.922) | EPR Properties (REIT) | Bank of America | |
| 11.514 | Enovis Corp | Goldman Sachs | 22.735 | 3.268 | EPR Properties (REIT) | Merrill Lynch | (2.601) |
| 3.812 | Enovis Corp | HSBC | 7.440 | | EPR Properties (REIT) | Bank of America | |
| 3.072 | Enovis Corp | Morgan Stanley | 2.513 | (38.235) | EPR Properties (REIT) | Merrill Lynch | 1.869 |
| (696) | Enphase Energy Inc | Bank of America | | 3.140 | EPR Properties (REIT) | Barclays Bank | (43.970) |
| | | Merrill Lynch | (21.026) | (13.495) | EPR Properties (REIT) | Barclays Bank | 3.611 |
| (3.811) | Enphase Energy Inc | Barclays Bank | (67.112) | 1.020 | EPR Properties (REIT) | Goldman Sachs | (12.011) |
| (852) | Enphase Energy Inc | HSBC | (15.393) | 2.013 | EPR Properties (REIT) | HSBC | 520 |
| (497) | Enphase Energy Inc | Morgan Stanley | (8.752) | 5.075 | EQRx Inc | Morgan Stanley | 2.315 |
| 5.190 | EnPro Industries Inc | Barclays Bank | 14.843 | 3.886 | EQRx Inc | Barclays Bank | 5.735 |
| 3.361 | EnPro Industries Inc | Goldman Sachs | (571) | (8.547) | EQT Corp | Goldman Sachs | 3.614 |
| 3.313 | EnPro Industries Inc | HSBC | 15.093 | 2.946 | EQT Corp | Barclays Bank | (30.000) |
| (1.311) | Ensign Group Inc | Bank of America | | 8.690 | EQT Corp | Barclays Bank | 10.340 |
| | | Merrill Lynch | (4.379) | (4.721) | EQT Corp | Goldman Sachs | 64.277 |
| 6.215 | Ensign Group Inc | Bank of America | | (1.027) | Equifax Inc | HSBC | (54.008) |
| | | Merrill Lynch | 20.758 | 3.091 | Equifax Inc | Barclays Bank | (4.077) |
| 15.561 | Ensign Group Inc | Barclays Bank | 39.369 | 2.023 | Equifax Inc | Goldman Sachs | 15.331 |
| 9.851 | Ensign Group Inc | Goldman Sachs | 32.902 | (3.422) | Equifax Inc | HSBC | 2.670 |
| 9.907 | Ensign Group Inc | HSBC | 48.258 | | | HSBC | (8.708) |
| 3.406 | Ensign Group Inc | Morgan Stanley | 8.617 | | | | |
| 4.485 | Enstar Group Ltd | Barclays Bank | 41.352 | | | | |
| 2.073 | Enstar Group Ltd | Goldman Sachs | 5.929 | | | | |
| 705 | Enstar Group Ltd | HSBC | (1.466) | | | | |
| (9.049) | Entegris Inc | Barclays Bank | (41.082) | | | | |
| 1.846 | Entegris Inc | Barclays Bank | 8.381 | | | | |
| (195) | Entegris Inc | Morgan Stanley | (885) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|----------------------------------|---|---|---------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (2.208) | Equifax Inc | Morgan Stanley | (8.766) | 25.192 | ESC WAR IND* | Barclays Bank | 6.741 |
| 791 | Equinix Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 24.490 | 63.725 | ESC WAR IND* | Goldman Sachs | — |
| 1.174 | Equinix Inc (REIT) | Barclays Bank | 21.707 | 41.059 | ESC WAR IND* | Morgan Stanley | 10.987 |
| 2.362 | Equinix Inc (REIT) | Goldman Sachs | 88.232 | (13.745) | Escalade Inc | Bank of America | |
| 2.396 | Equinix Inc (REIT) | HSBC | 66.681 | (5.486) | Escalade Inc | Merrill Lynch | (1.924) |
| 1.541 | Equinix Inc (REIT) | Morgan Stanley | 28.493 | (8.717) | Escalade Inc | Barclays Bank | (3.346) |
| 7.124 | Equitable Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 19.805 | (15.527) | Escalade Inc | Goldman Sachs | (1.220) |
| 30.715 | Equitable Holdings Inc | Barclays Bank | 49.144 | (2.437) | ESCO Technologies Inc | Morgan Stanley | (9.471) |
| 30.346 | Equitable Holdings Inc | Goldman Sachs | 84.362 | (7.574) | ESCO Technologies Inc | Bank of America | |
| 16.391 | Equitable Holdings Inc | HSBC | 33.930 | (4.180) | ESCO Technologies Inc | Merrill Lynch | (3.461) |
| 40.777 | Equitable Holdings Inc | Morgan Stanley | 65.243 | (2.650) | ESCO Technologies Inc | Barclays Bank | (8.559) |
| (6.948) | Equitrans Midstream Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3.474) | (40.015) | ESCO Technologies Inc | Goldman Sachs | (5.936) |
| 71.436 | Equitrans Midstream Corp | Goldman Sachs | 35.718 | (39.940) | Escrow New York (REIT)* | HSBC | (11.872) |
| (37.458) | Equitrans Midstream Corp | Goldman Sachs | (18.729) | (21.172) | Escrow New York (REIT)* | Bank of America | |
| 14.806 | Equitrans Midstream Corp | HSBC | 11.253 | 376 | Esperion Therapeutics Inc | Merrill Lynch | (38) |
| (24.612) | Equitrans Midstream Corp | HSBC | (16.109) | 24.915 | Esperion Therapeutics Inc | Barclays Bank | (9.717) |
| 23.152 | Equitrans Midstream Corp | Morgan Stanley | 8.335 | 5.615 | Esperion Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (562) |
| (6.393) | Equitrans Midstream Corp | Morgan Stanley | (2.301) | 17.619 | Esperion Therapeutics Inc | HSBC | 8.105 |
| 1.293 | Equity Bancshares Inc 'A' | Barclays Bank | 1.047 | 8.681 | Esperion Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (3.386) |
| 2.059 | Equity Bancshares Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.651 | (2.463) | Esquire Financial | Bank of America | |
| 958 | Equity Bancshares Inc 'A' | HSBC | 1.375 | (8.289) | Esquire Financial | Merrill Lynch | (6.379) |
| (34.327) | Equity Commonwealth (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (39.476) | (8.289) | Esquire Financial | Barclays Bank | (9.947) |
| (72.742) | Equity Commonwealth (REIT) | Barclays Bank | (71.287) | (1.820) | Esquire Financial | Goldman Sachs | (4.714) |
| (39.245) | Equity Commonwealth (REIT) | Goldman Sachs | (45.132) | (2.190) | Esquire Financial | HSBC | (2.694) |
| (118.979) | Equity Commonwealth (REIT) | HSBC | (117.789) | (2.980) | Esquire Financial | Morgan Stanley | (3.576) |
| (25.551) | Equity Commonwealth (REIT) | Morgan Stanley | (25.040) | 2.839 | ESSA Bancorp Inc | Bank of America | |
| 51.962 | Equity LifeStyle Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | 199.535 | 3.412 | ESSA Bancorp Inc | Merrill Lynch | 483 |
| 41.964 | Equity LifeStyle Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 178.766 | 5.380 | ESSA Bancorp Inc | Barclays Bank | 102 |
| 21.184 | Equity LifeStyle Properties Inc (REIT) | HSBC | 132.824 | 16.405 | ESSA Bancorp Inc | Goldman Sachs | 915 |
| 20.546 | Equity Residential (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 64.053 | 9.132 | ESSA Bancorp Inc | HSBC | (7.874) |
| 3.783 | Equity Residential (REIT) | Barclays Bank | 5.939 | 2.482 | Essent Group Ltd | Morgan Stanley | 274 |
| 28.006 | Equity Residential (REIT) | Goldman Sachs | 85.978 | 14.574 | Essent Group Ltd | Bank of America | |
| 31.655 | Equity Residential (REIT) | HSBC | 107.442 | (37.936) | Essent Group Ltd | Merrill Lynch | 4.244 |
| 6.126 | Equity Residential (REIT) | Morgan Stanley | 9.618 | 96.627 | Essent Group Ltd | Barclays Bank | 17.781 |
| 3.082 | Erasca Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.541) | (7.250) | Essent Group Ltd | Goldman Sachs | (64.871) |
| 2.740 | Erasca Inc | Barclays Bank | (192) | 8.178 | Essent Group Ltd | Goldman Sachs | 153.261 |
| 3.112 | Erasca Inc | Goldman Sachs | (1.556) | (5.280) | Essent Group Ltd | HSBC | (7.685) |
| 11.280 | Erasca Inc | HSBC | (7.783) | 5.184 | Essent Group Ltd | HSBC | 8.441 |
| 6.297 | Erasca Inc | Morgan Stanley | (441) | 5.837 | Essential Properties | Morgan Stanley | (6.442) |
| 1.363 | Erie Indemnity Co 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 3.395 | 5.837 | Essential Properties | Morgan Stanley | 6.324 |
| 1.537 | Erie Indemnity Co 'A' | Barclays Bank | 5.533 | 44.286 | Essential Properties | Bank of America | |
| 2.147 | Erie Indemnity Co 'A' | Goldman Sachs | 6.656 | 73.371 | Essential Properties | Merrill Lynch | 4.244 |
| 2.093 | Erie Indemnity Co 'A' | HSBC | 4.035 | 44.653 | Essential Properties | Barclays Bank | 17.781 |
| 3.253 | Erie Indemnity Co 'A' | Morgan Stanley | 11.655 | 7.542 | Essential Properties | Goldman Sachs | (12.473) |
| 8.755 | Eros STX Global Corp | Bank of America Merrill Lynch | 5.691 | 11.346 | Essential Properties | HSBC | 33.043 |
| 21.731 | Eros STX Global Corp | Barclays Bank | 14.994 | 22.339 | Essential Properties | Morgan Stanley | 6.788 |
| 20.674 | Eros STX Global Corp | Goldman Sachs | 13.438 | (3.378) | Essential Properties | Bank of America | |
| 3.202 | Eros STX Global Corp | HSBC | 1.569 | (47.529) | Essential Properties | Merrill Lynch | 4.538 |
| 6.412 | Eros STX Global Corp | Morgan Stanley | 4.424 | 8.722 | Essential Utilities Inc | Barclays Bank | (4.244) |
| (2.051) | Esab Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.559 | 7.285 | Essential Utilities Inc | Goldman Sachs | (1.351) |
| (10.866) | Esab Corp | Barclays Bank | 2.499 | (6.863) | Essex Property Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 4.399 |
| (25.782) | Esab Corp | Goldman Sachs | 19.594 | (736) | Essex Property Trust Inc (REIT) | HSBC | (113.687) |
| (4.537) | Esab Corp | HSBC | (13.520) | 11.346 | Essential Utilities Inc | HSBC | 22.302 |
| (12.306) | Esab Corp | Morgan Stanley | 2.831 | 22.339 | Essential Utilities Inc | Morgan Stanley | (1.384) |
| | | | | (3.378) | Essential Utilities Inc | Barclays Bank | 21.515 |
| | | | | 10.998 | Essential Utilities Inc | Goldman Sachs | 5.744 |
| | | | | (47.529) | Essential Utilities Inc | HSBC | |
| | | | | 8.722 | Essential Utilities Inc | HSBC | |
| | | | | 7.285 | Essential Utilities Inc | Morgan Stanley | |
| | | | | (6.863) | Essex Property Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | |
| | | | | (736) | Essex Property Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------|-----------------|---|---|--------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (6.358) | Essex Property Trust Inc (REIT) | HSBC | 75.565 | 2.191 | Everi Holdings Inc | Morgan Stanley | 849 |
| (4.829) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Bank of America | | 12.616 | EverQuote Inc 'A' | Barclays Bank | 1.640 |
| | | Merrill Lynch | (99.931) | 7.020 | EverQuote Inc 'A' | Goldman Sachs | 491 |
| (4.922) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Barclays Bank | (91.648) | 583 | EverQuote Inc 'A' | HSBC | (1.137) |
| 623 | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Goldman Sachs | 12.360 | (5.093) | Eversource Energy | Bank of America | |
| (1.335) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | HSBC | (25.234) | 51.846 | Eversource Energy | Merrill Lynch | (13.313) |
| (374) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Morgan Stanley | (6.964) | (11.535) | Eversource Energy | Barclays Bank | 48.735 |
| 2.731 | Ethan Allen Interiors Inc | Bank of America | | 646 | Eversource Energy | Barclays Bank | (10.843) |
| | | Merrill Lynch | (2.622) | (7.638) | Eversource Energy | Goldman Sachs | (529) |
| 24.400 | Ethan Allen Interiors Inc | Barclays Bank | 40.504 | 283 | Eversource Energy | Goldman Sachs | (22.608) |
| 24.292 | Ethan Allen Interiors Inc | Goldman Sachs | (23.320) | 4.052 | Eversource Energy | HSBC | (42) |
| 15.787 | Ethan Allen Interiors Inc | HSBC | (25.417) | (3.118) | Everspin Technologies Inc | HSBC | (6.848) |
| 3.434 | Ethan Allen Interiors Inc | Morgan Stanley | 5.700 | (7.448) | Everspin Technologies Inc | Barclays Bank | (1.372) |
| (17.433) | Eton Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 4.707 | (3.708) | EVERTEC Inc | Goldman Sachs | (1.936) |
| 3.484 | Etsy Inc | Barclays Bank | 30.900 | | | Bank of America | |
| 5.391 | Etsy Inc | HSBC | 11.360 | (12.918) | EVERTEC Inc | Merrill Lynch | (1.112) |
| 4.987 | Euronet Worldwide Inc | Barclays Bank | 26.780 | (19.217) | EVERTEC Inc | Barclays Bank | (1.033) |
| 5.945 | Euronet Worldwide Inc | HSBC | 93.515 | (10.074) | EVERTEC Inc | Goldman Sachs | (5.765) |
| 1.435 | Euronet Worldwide Inc | Morgan Stanley | 7.706 | (2.995) | EVI Industries Inc | HSBC | 907 |
| (5.288) | European Wax Center Inc 'A' | Bank of America | | (1.887) | Evo Payments Inc 'A' | Barclays Bank | (689) |
| | | Merrill Lynch | (2.448) | | | Bank of America | |
| (9.226) | European Wax Center Inc 'A' | Barclays Bank | (11.062) | (12.284) | Evo Payments Inc 'A' | Merrill Lynch | (1.528) |
| (4.551) | European Wax Center Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.867) | (1.093) | Evo Payments Inc 'A' | Barclays Bank | 7.739 |
| 13.647 | Evans Bancorp Inc | Barclays Bank | 19.993 | (3.983) | Evo Payments Inc 'A' | Goldman Sachs | (885) |
| 8.500 | Evans Bancorp Inc | Goldman Sachs | 9.563 | (14.577) | Evo Payments Inc 'A' | HSBC | (4.262) |
| 3.020 | Evans Bancorp Inc | HSBC | 3.367 | 6.806 | Evolent Health Inc 'A' | Morgan Stanley | 9.184 |
| 4.196 | Evans Bancorp Inc | Morgan Stanley | 6.147 | 7.148 | Evolent Health Inc 'A' | Barclays Bank | (4.696) |
| (6.617) | Evelo Biosciences Inc | Barclays Bank | (2.514) | 6.521 | Evolent Health Inc 'A' | Goldman Sachs | — |
| 5.122 | Eventbrite Inc 'A' | Bank of America | | 9.568 | Evolus Inc | HSBC | 15.390 |
| | | Merrill Lynch | 543 | 764 | Evolus Inc | Barclays Bank | 14.287 |
| 19.362 | Eventbrite Inc 'A' | Barclays Bank | (4.453) | 84.319 | Evolution Petroleum Corp | HSBC | 2.261 |
| 22.095 | Eventbrite Inc 'A' | Goldman Sachs | 11.580 | 64.454 | Evolution Petroleum Corp | Goldman Sachs | 53.121 |
| 7.813 | Eventbrite Inc 'A' | HSBC | 11.329 | (2.172) | Evoqua Water Technologies Corp | Morgan Stanley | 43.184 |
| 8.999 | Eventbrite Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.070) | 1.417 | Evoqua Water Technologies Corp | Bank of America | |
| (2.401) | Everbridge Inc | Barclays Bank | (1.773) | (32.577) | Evoqua Water Technologies Corp | Merrill Lynch | (956) |
| 1.824 | Everbridge Inc | Barclays Bank | 1.970 | 6.038 | Evoqua Water Technologies Corp | Bank of America | |
| (5.193) | Everbridge Inc | Goldman Sachs | (19.591) | (8.777) | Evoqua Water Technologies Corp | Barclays Bank | 26.713 |
| (7.810) | Everbridge Inc | HSBC | (41.907) | 17.258 | Evoqua Water Technologies Corp | Barclays Bank | (4.951) |
| 1.669 | Everbridge Inc | HSBC | 5.713 | (5.847) | Evoqua Water Technologies Corp | Barclays Bank | (4.976) |
| 1.747 | EverCommerce Inc | Bank of America | | (3.574) | Evoqua Water Technologies Corp | Goldman Sachs | (431) |
| | | Merrill Lynch | 280 | 2.204 | Evoqua Water Technologies Corp | Goldman Sachs | 7.593 |
| 5.323 | EverCommerce Inc | Barclays Bank | 213 | 1.467 | EW Scripps Co 'A' | HSBC | (4.976) |
| 6.782 | EverCommerce Inc | Goldman Sachs | 1.085 | 56.167 | EW Scripps Co 'A' | Morgan Stanley | 2.931 |
| 4.189 | EverCommerce Inc | HSBC | (4.231) | 16.740 | EW Scripps Co 'A' | Bank of America | |
| 2.171 | Evercore Inc 'A' | Bank of America | | (3.083) | Exact Sciences Corp | Merrill Lynch | (16.288) |
| | | Merrill Lynch | 9.502 | (2.439) | Exact Sciences Corp | Goldman Sachs | 7.031 |
| 2.625 | Evercore Inc 'A' | Barclays Bank | 8.583 | (8.194) | Exact Sciences Corp | Bank of America | |
| 2.507 | Evercore Inc 'A' | Goldman Sachs | 9.124 | (3.817) | Exact Sciences Corp | Merrill Lynch | (5.437) |
| 4.184 | Evercore Inc 'A' | HSBC | 11.845 | (2.422) | Exact Sciences Corp | Barclays Bank | 1.415 |
| 4.617 | Evercore Inc 'A' | Morgan Stanley | 12.376 | 9.606 | Exagen Inc | Goldman Sachs | (7.128) |
| 453 | Everest Re Group Ltd | Bank of America | | 5.389 | Exagen Inc | HSBC | (5.698) |
| | | Merrill Lynch | 2.601 | 8.916 | Exagen Inc | Morgan Stanley | 1.405 |
| 4.375 | Everest Re Group Ltd | Barclays Bank | 33.471 | 4.899 | Exagen Inc | Bank of America | |
| 5.057 | Everest Re Group Ltd | Goldman Sachs | (2.966) | 21.705 | Exelixis Inc | Merrill Lynch | 4.611 |
| 5.563 | Everest Re Group Ltd | HSBC | 2.134 | 32.838 | Exelixis Inc | Barclays Bank | 2.317 |
| 4.432 | Everest Re Group Ltd | Morgan Stanley | 31.575 | 7.984 | Exelixis Inc | Goldman Sachs | 4.280 |
| 28.849 | Everygy Inc | Bank of America | | | | HSBC | (4.311) |
| | | Merrill Lynch | 50.343 | | | Bank of America | |
| 23.570 | Everygy Inc | Barclays Bank | 34.108 | | | Merrill Lynch | 4.611 |
| 52.251 | Everygy Inc | Goldman Sachs | 109.706 | | | Barclays Bank | 2.317 |
| 9.254 | Everygy Inc | HSBC | 20.681 | | | Goldman Sachs | 4.280 |
| 1.957 | Everygy Inc | Morgan Stanley | 2.877 | | | HSBC | (4.311) |
| 16.249 | Everi Holdings Inc | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 17.215 | | | Merrill Lynch | (44.746) |
| 6.005 | Everi Holdings Inc | Barclays Bank | 6.786 | | | Barclays Bank | 17.733 |
| 24.218 | Everi Holdings Inc | Goldman Sachs | 28.334 | | | Goldman Sachs | 2.758 |
| 9.128 | Everi Holdings Inc | HSBC | 17.691 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|---------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 52.474 | Exelixis Inc | HSBC | (75.821) | (12.621) | F5 Inc | Goldman Sachs | 37.439 |
| (14.388) | Exelon Corp | Barclays Bank | (18.129) | (4.985) | F5 Inc | HSBC | 16.152 |
| (121.424) | Exelon Corp | Goldman Sachs | (276.847) | (1.244) | F5 Inc | Morgan Stanley | (5.984) |
| (91.969) | Exelon Corp | HSBC | (222.565) | (4.915) | Fabrinet | Barclays Bank | (10.911) |
| (6.620) | ExlService Holdings Inc | Bank of America | | (4.956) | Fabrinet | Goldman Sachs | 7.894 |
| | | Merrill Lynch | (55.038) | (4.597) | Fabrinet | HSBC | (430) |
| (4.848) | ExlService Holdings Inc | Barclays Bank | (49.692) | (2.259) | Fabrinet | Morgan Stanley | (5.015) |
| (7.464) | ExlService Holdings Inc | Goldman Sachs | (59.350) | 876 | FactSet Research Systems Inc | Bank of America | |
| (4.261) | ExlService Holdings Inc | HSBC | (40.655) | 7.368 | FactSet Research Systems Inc | Merrill Lynch | 8.848 |
| (3.872) | ExlService Holdings Inc | Morgan Stanley | (39.688) | 5.335 | FactSet Research Systems Inc | Barclays Bank | 76.038 |
| (10.748) | eXp World Holdings Inc | Bank of America | | 5.335 | FactSet Research Systems Inc | Goldman Sachs | 53.883 |
| | | Merrill Lynch | (5.804) | 3.881 | FactSet Research Systems Inc | HSBC | 72.613 |
| (20.433) | eXp World Holdings Inc | Barclays Bank | (2.247) | 1.060 | FactSet Research Systems Inc | Morgan Stanley | 10.939 |
| (2.639) | eXp World Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.425) | 1.764 | Fair Isaac Corp | Barclays Bank | 3.263 |
| (15.126) | eXp World Holdings Inc | HSBC | (5.445) | 1.931 | Fair Isaac Corp | Morgan Stanley | 3.572 |
| 1.472 | Expedia Group Inc | Bank of America | | 12.413 | Falcon Minerals Corp | Barclays Bank | 7.448 |
| | | Merrill Lynch | 6.609 | 14.744 | Falcon Minerals Corp | HSBC | 9.584 |
| 1.909 | Expedia Group Inc | Barclays Bank | 12.809 | 14.473 | Farfetch Ltd 'A' | Bank of America | |
| 6.424 | Expedia Group Inc | Goldman Sachs | 33.862 | (7.690) | Farfetch Ltd 'A' | Merrill Lynch | 16.792 |
| 3.709 | Expedia Group Inc | HSBC | 6.460 | (5.203) | Farfetch Ltd 'A' | Bank of America | (5.306) |
| 63 | Expedia Group Inc | Morgan Stanley | 423 | 20.507 | Farfetch Ltd 'A' | Merrill Lynch | (7.909) |
| 1.116 | Expeditors International of Washington Inc | Bank of America | | (8.132) | Farfetch Ltd 'A' | Goldman Sachs | 36.884 |
| | | Merrill Lynch | (1.266) | 8.227 | Farfetch Ltd 'A' | Goldman Sachs | (5.611) |
| 16.127 | Expeditors International of Washington Inc | Barclays Bank | 35.802 | (2.426) | Farfetch Ltd 'A' | HSBC | 10.738 |
| (2.876) | Expeditors International of Washington Inc | Barclays Bank | (6.385) | (8.862) | Farfetch Ltd 'A' | HSBC | (1.577) |
| (2.817) | Expeditors International of Washington Inc | Goldman Sachs | 4.274 | (2.282) | Farmer Bros Co | Morgan Stanley | (13.470) |
| 2.406 | Expeditors International of Washington Inc | HSBC | 6.696 | (11.384) | Farmer Bros Co | Goldman Sachs | 753 |
| (599) | Expeditors International of Washington Inc | HSBC | 1.574 | 3.480 | Farmers & Merchants Bancorp Inc | Morgan Stanley | (1.708) |
| (350) | Exponent Inc | Bank of America | | 7.284 | Farmers & Merchants Bancorp Inc | Barclays Bank | 4.594 |
| | | Merrill Lynch | (403) | 3.602 | Farmers & Merchants Bancorp Inc | Goldman Sachs | 7.794 |
| (4.261) | Exponent Inc | Barclays Bank | (8.011) | 11.735 | Farmers National Banc Corp | HSBC | 4.683 |
| (7.552) | Exponent Inc | Goldman Sachs | (8.684) | 33.907 | Farmers National Banc Corp | Bank of America | |
| (5.052) | Exponent Inc | HSBC | (4.597) | 73.841 | Farmers National Banc Corp | Merrill Lynch | 7.745 |
| (32.789) | Express Inc | Goldman Sachs | 22.297 | 7.814 | Farmers National Banc Corp | Barclays Bank | 24.413 |
| (13.889) | Express Inc | HSBC | 8.195 | (35.478) | Farmland Partners Inc (REIT) | Goldman Sachs | 48.735 |
| (4.925) | Expro Group Holdings NV | Barclays Bank | (5.516) | (7.245) | Farmland Partners Inc (REIT) | HSBC | 2.726 |
| (1.051) | Expro Group Holdings NV | Goldman Sachs | (1.902) | (11.212) | Farmland Partners Inc (REIT) | Morgan Stanley | (784) |
| (4.018) | Expro Group Holdings NV | HSBC | (10.407) | (1.482) | FARO Technologies Inc | Barclays Bank | 1.686 |
| (7.290) | Exterran Corp | Bank of America | | (2.594) | FARO Technologies Inc | Goldman Sachs | 6.331 |
| | | Merrill Lynch | (2.868) | (6.136) | FARO Technologies Inc | HSBC | 7.793 |
| (3.279) | Exterran Corp | Barclays Bank | (2.263) | (8.635) | Fastenal Co | Bank of America | |
| (3.432) | Exterran Corp | Goldman Sachs | (1.201) | (40.768) | Fastenal Co | Merrill Lynch | (6.198) |
| (7.744) | Exterran Corp | HSBC | (5.885) | (61.135) | Fastenal Co | Barclays Bank | (46.884) |
| 17.316 | Extra Space Storage Inc (REIT) | Barclays Bank | 52.641 | (77.631) | Fastenal Co | Goldman Sachs | (17.034) |
| 7.508 | Extra Space Storage Inc (REIT) | Goldman Sachs | (9.760) | (10.604) | Fastenal Co | HSBC | (13.485) |
| 12.078 | Extreme Networks Inc | Barclays Bank | 2.103 | 15.384 | Fastly Inc 'A' | Morgan Stanley | (12.195) |
| 22.717 | Extreme Networks Inc | Goldman Sachs | 9.002 | 21.840 | Fastly Inc 'A' | Barclays Bank | 17.076 |
| 18.364 | Extreme Networks Inc | HSBC | 10.039 | 15.974 | Fastly Inc 'A' | Goldman Sachs | 30.541 |
| 4.632 | Extreme Networks Inc | Morgan Stanley | 1.621 | 16.131 | Fastly Inc 'A' | HSBC | 23.374 |
| 38.552 | Exxon Mobil Corp | Barclays Bank | 199.314 | 3.616 | Fate Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 17.905 |
| 40.888 | Exxon Mobil Corp | Goldman Sachs | 331.602 | (3.134) | Fate Therapeutics Inc | Barclays Bank | 2.061 |
| 950 | Exxon Mobil Corp | HSBC | 9.275 | | | Goldman Sachs | (1.661) |
| 76.158 | EZCORP Inc 'A' | Barclays Bank | 36.937 | | | | |
| 53.184 | EZCORP Inc 'A' | Goldman Sachs | 28.719 | | | | |
| 3.378 | F45 Training Holdings Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (1.993) | | | | |
| 7.758 | F45 Training Holdings Inc | Barclays Bank | 7.215 | | | | |
| 2.553 | F45 Training Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.506) | | | | |
| 13.983 | F45 Training Holdings Inc | HSBC | 2.711 | | | | |
| 5.407 | F45 Training Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.751 | | | | |
| (6.269) | F5 Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 24.511 | | | | |
| (1.964) | F5 Inc | Barclays Bank | (9.447) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 7.799 | Fate Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 5.259 | 27.283 | Fidelity National Information Services Inc | Goldman Sachs | 219.082 |
| (975) | Fate Therapeutics Inc | HSBC | (800) | | | | |
| 11.914 | Fate Therapeutics Inc | HSBC | 6.611 | 2.533 | Fidelity National Information Services Inc | HSBC | 24.798 |
| 2.629 | Fate Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.499 | 7.550 | Fiesta Restaurant Group Inc | Barclays Bank | 2.869 |
| 1.683 | Fathom Holdings Inc | Barclays Bank | 1.447 | 2.988 | Fiesta Restaurant Group Inc | Goldman Sachs | 1.315 |
| 1.126 | Fathom Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.599 | 7.108 | Fiesta Restaurant Group Inc | HSBC | 9.880 |
| 779 | Fathom Holdings Inc | Morgan Stanley | 670 | 16.274 | Fiesta Restaurant Group Inc | Morgan Stanley | 6.184 |
| (1.614) | FB Financial Corp | Barclays Bank | (2.857) | 9.293 | Fifth Third Bancorp | Bank of America | |
| (850) | FB Financial Corp | HSBC | (3.743) | | | Merrill Lynch | 30.667 |
| (5.502) | FB Financial Corp | Morgan Stanley | (9.739) | (27.492) | Fifth Third Bancorp | Barclays Bank | (59.933) |
| 23.876 | Federal Agricultural Mortgage Corp 'C' | Barclays Bank | 44.887 | 12.162 | Fifth Third Bancorp | Barclays Bank | 26.513 |
| 3.979 | Federal Agricultural Mortgage Corp 'C' | Goldman Sachs | 4.258 | (43.965) | Fifth Third Bancorp | Goldman Sachs | (140.529) |
| (2.750) | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Bank of America | | 9.631 | Fifth Third Bancorp | Goldman Sachs | 31.782 |
| | | Merrill Lynch | 2.173 | (7.939) | Fifth Third Bancorp | HSBC | (13.393) |
| 483 | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Bank of America | | 8.060 | Fifth Third Bancorp | HSBC | 17.651 |
| | | Merrill Lynch | (382) | (8.038) | Fifth Third Bancorp | Morgan Stanley | (5.908) |
| (11.461) | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Barclays Bank | (59.253) | 15.530 | Figs Inc 'A' | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (2.347) |
| 6.157 | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Barclays Bank | 31.832 | 5.672 | Figs Inc 'A' | Barclays Bank | 2.779 |
| (8.418) | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Barclays Bank | | 10.999 | Figs Inc 'A' | Goldman Sachs | (5.500) |
| | | Goldman Sachs | 6.650 | 6.883 | Figs Inc 'A' | HSBC | (27.074) |
| 1.769 | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Goldman Sachs | (1.398) | 5.159 | Figs Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.528 |
| (532) | Federal Realty Investment Trust (REIT) | HSBC | (2.968) | (15.428) | Financial Institutions Inc | Goldman Sachs | (13.731) |
| 4.094 | Federal Realty Investment Trust (REIT) | HSBC | 13.346 | (2.597) | Financial Institutions Inc | Morgan Stanley | (2.052) |
| (10.252) | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Morgan Stanley | (53.003) | 2.170 | Finwise Bancorp | Goldman Sachs | 803 |
| | | | | 2.495 | Finwise Bancorp | HSBC | (998) |
| 2.326 | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Morgan Stanley | 12.025 | 5.453 | First Advantage Corp | Bank of America | |
| (25.838) | Federal Signal Corp | Barclays Bank | (38.757) | | | Merrill Lynch | (2.345) |
| (34.079) | Federal Signal Corp | Goldman Sachs | (68.158) | 3.716 | First Advantage Corp | Barclays Bank | 520 |
| (23.989) | Federal Signal Corp | HSBC | (18.951) | 5.093 | First Advantage Corp | Goldman Sachs | (2.716) |
| (32.860) | Federated Hermes Inc | Barclays Bank | (51.590) | 7.756 | First Advantage Corp | HSBC | (5.778) |
| (21.212) | Federated Hermes Inc | Goldman Sachs | (50.696) | 7.310 | First Advantage Corp | Morgan Stanley | 1.101 |
| (8.920) | Federated Hermes Inc | HSBC | (39.962) | (2.103) | First American Financial Corp | Bank of America | |
| (12.382) | Federated Hermes Inc | Morgan Stanley | (19.440) | | | Merrill Lynch | 42 |
| (1.109) | FedEx Corp | Bank of America | | 10.047 | First American Financial Corp | Barclays Bank | 904 |
| | | Merrill Lynch | (11.212) | (6.797) | First American Financial Corp | Barclays Bank | (612) |
| (2.071) | FedEx Corp | Barclays Bank | (24.739) | (2.603) | First American Financial Corp | Goldman Sachs | 52 |
| (2.121) | FedEx Corp | Goldman Sachs | (21.443) | 1.819 | First American Financial Corp | Morgan Stanley | 164 |
| (5.909) | FedEx Corp | HSBC | (68.308) | (3.999) | First American Financial Corp | Morgan Stanley | (360) |
| (5.709) | FedEx Corp | Morgan Stanley | (85.072) | (2.878) | First Bancorp | Bank of America | |
| 820 | FedNat Holding Co | Barclays Bank | 4 | | | Merrill Lynch | (3.684) |
| 2.420 | FedNat Holding Co | Goldman Sachs | 69 | (61.940) | First Bancorp | Barclays Bank | (69.373) |
| 15.476 | FedNat Holding Co | Morgan Stanley | 67 | (7.123) | First Bancorp | Barclays Bank | (5.200) |
| 11.002 | Fennec Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (1.540) | (55.653) | First Bancorp | Goldman Sachs | (81.781) |
| 38.895 | Fennec Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 4.278 | (14.444) | First Bancorp | Goldman Sachs | (18.488) |
| 5.398 | FibroGen Inc | Bank of America | | (7.663) | First Bancorp | HSBC | 843 |
| | | Merrill Lynch | 2.591 | (10.834) | First BanCorp | Bank of America | |
| 25.969 | FibroGen Inc | Goldman Sachs | 12.465 | | | Merrill Lynch | (11.752) |
| 9.491 | FibroGen Inc | HSBC | 16.894 | (9.572) | First BanCorp | Morgan Stanley | (10.721) |
| 1.647 | FibroGen Inc | Morgan Stanley | 1.598 | 9.170 | First Bancorp Inc | Barclays Bank | 11.921 |
| 491 | Fidelity D&D Bancorp Inc | Barclays Bank | 439 | 6.410 | First Bancorp Inc | Goldman Sachs | 7.127 |
| 220 | Fidelity D&D Bancorp Inc | Goldman Sachs | 525 | 834 | First Bancorp Inc | HSBC | 1.365 |
| 264 | Fidelity D&D Bancorp Inc | HSBC | 556 | 8.291 | First Bancorp Inc | Morgan Stanley | 10.778 |
| 171 | Fidelity D&D Bancorp Inc | Morgan Stanley | 153 | 10.789 | First Bancshares Inc | Bank of America | |
| 39.681 | Fidelity National Financial Inc | Barclays Bank | 51.188 | | | Merrill Lynch | (1.187) |
| 32.895 | Fidelity National Financial Inc | Goldman Sachs | 30.922 | 23.466 | First Bancshares Inc | Barclays Bank | 2.816 |
| 10.725 | Fidelity National Financial Inc | HSBC | 16.409 | 18.172 | First Bancshares Inc | Goldman Sachs | (1.999) |
| 360 | Fidelity National Financial Inc | Morgan Stanley | 464 | 31.539 | First Bancshares Inc | HSBC | (69.972) |
| | | | | 4.558 | First Bancshares Inc | Morgan Stanley | 547 |
| | | | | 31.626 | First Bank | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 7.274 |
| | | | | 17.854 | First Bank | Barclays Bank | 6.249 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 11.783 | First Bank | Goldman Sachs | 2.710 | 1.063 | First Financial Corp | Morgan Stanley | 457 |
| 5.743 | First Busey Corp | Bank of America | | 20.158 | First Financial | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 4.959 | | Northwest Inc | Merrill Lynch | 9.071 |
| 36.234 | First Busey Corp | Barclays Bank | 17.621 | 34.941 | First Financial | | |
| 34.089 | First Busey Corp | Goldman Sachs | 39.108 | | Northwest Inc | Goldman Sachs | 15.723 |
| 21.722 | First Busey Corp | HSBC | 13.943 | 20.420 | First Foundation Inc | Bank of America | |
| 16.465 | First Busey Corp | Morgan Stanley | 8.240 | | Merrill Lynch | | 24.431 |
| 12.789 | First Business Financial Services Inc | Bank of America | | 49.862 | First Foundation Inc | Barclays Bank | 32.410 |
| | | Merrill Lynch | 6.650 | 26.311 | First Foundation Inc | Goldman Sachs | 29.728 |
| 20.501 | First Business Financial Services Inc | Barclays Bank | 23.576 | 9.161 | First Foundation Inc | HSBC | 3.357 |
| 18.804 | First Business Financial Services Inc | Goldman Sachs | 9.778 | 2.139 | First Foundation Inc | Morgan Stanley | 1.390 |
| 13.953 | First Business Financial Services Inc | | | (2.362) | First Guaranty Bancshares Inc | Bank of America | |
| 825 | First Capital Inc | HSBC | (11.162) | (2.425) | First Guaranty Bancshares Inc | Merrill Lynch | (1.772) |
| | | Bank of America | | (19.429) | First Hawaiian Inc | Morgan Stanley | (3.662) |
| | | Merrill Lynch | (91) | | | Bank of America | |
| 244 | First Capital Inc | Barclays Bank | 205 | (76.331) | First Hawaiian Inc | Merrill Lynch | (24.869) |
| 251 | First Capital Inc | Morgan Stanley | 211 | (73.879) | First Hawaiian Inc | Barclays Bank | (65.645) |
| (402) | First Citizens BancShares Inc 'A' | Bank of America | | (17.297) | First Hawaiian Inc | Goldman Sachs | (94.565) |
| | | Merrill Lynch | (16.695) | (31.933) | First Hawaiian Inc | HSBC | (15.568) |
| (2.174) | First Citizens BancShares Inc 'A' | Barclays Bank | (64.220) | 29.370 | First Horizon Corp | Morgan Stanley | (27.462) |
| (923) | First Citizens BancShares Inc 'A' | | | 34.011 | First Industrial Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 41.118 |
| (1.261) | First Citizens BancShares Inc 'A' | Goldman Sachs | (38.333) | 60.265 | First Industrial Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America | |
| (607) | First Citizens BancShares Inc 'A' | HSBC | (57.892) | 127.317 | First Industrial Realty Trust Inc (REIT) | Merrill Lynch | (8.503) |
| (1.802) | First Commonwealth Financial Corp | | | (3.981) | First Internet Bancorp | Barclays Bank | 71.715 |
| | | Bank of America | (17.931) | (2.462) | First Internet Bancorp | Goldman Sachs | (31.830) |
| (23.791) | First Commonwealth Financial Corp | Merrill Lynch | (118) | (12.090) | First Internet Bancorp | Barclays Bank | (4.817) |
| | | Barclays Bank | (11.896) | 33.770 | First Interstate BancSystem Inc 'A' | Goldman Sachs | (4.678) |
| (40.491) | First Commonwealth Financial Corp | | | 69.589 | First Interstate BancSystem Inc 'A' | HSBC | (20.916) |
| (2.602) | First Commonwealth Financial Corp | Goldman Sachs | (31.970) | 41.997 | First Interstate BancSystem Inc 'A' | Bank of America | |
| (2.186) | First Commonwealth Financial Corp | HSBC | (1.171) | 6.683 | First Interstate BancSystem Inc 'A' | Merrill Lynch | 126.340 |
| 19.517 | First Community Bankshares Inc | | | 20.603 | First Interstate BancSystem Inc 'A' | Barclays Bank | 228.512 |
| | | Morgan Stanley | (1.093) | (11.220) | First Merchants Corp | Barclays Bank | 228.512 |
| 15.800 | First Community Bankshares Inc | Barclays Bank | 9.954 | (28.910) | First Merchants Corp | Goldman Sachs | 162.114 |
| 53.619 | First Community Bankshares Inc | Goldman Sachs | 24.490 | (15.938) | First Merchants Corp | HSBC | 25.690 |
| 30.106 | First Community Bankshares Inc | HSBC | 26.809 | (1.399) | First Merchants Corp | Morgan Stanley | 67.895 |
| 6.014 | First Community Corp | | | (27.612) | First Mid Bancshares Inc | Bank of America | |
| 275 | First Community Corp | Morgan Stanley | 15.354 | | | Merrill Lynch | (19.630) |
| 17.313 | First Community Corp | Barclays Bank | (60) | (29.242) | First Mid Bancshares Inc | Barclays Bank | (28.064) |
| (11.609) | First Financial Bancorp | Goldman Sachs | 8 | (2.689) | First Mid Bancshares Inc | HSBC | (12.045) |
| | | Morgan Stanley | (173) | (13.824) | First Mid Bancshares Inc | Morgan Stanley | (1.413) |
| (30.343) | First Financial Bancorp | Bank of America | | 58.552 | First Northwest Bancorp | Bank of America | |
| (83.695) | First Financial Bancorp | Merrill Lynch | (9.840) | | | Merrill Lynch | 61.480 |
| (27.701) | First Financial Bancorp | Barclays Bank | (4.855) | 4.939 | First Northwest Bancorp | Barclays Bank | (296) |
| (12.814) | First Financial Bancorp | Goldman Sachs | (71.623) | 9.608 | First Northwest Bancorp | Goldman Sachs | 10.088 |
| 1.150 | First Financial Bankshares Inc | HSBC | (6.560) | 1.307 | First Northwest Bancorp | HSBC | (1.137) |
| | | Morgan Stanley | (1.096) | 4.985 | First Northwest Bancorp | Morgan Stanley | (299) |
| 45.577 | First Financial Bankshares Inc | Bank of America | 610 | 3.510 | First of Long Island Corp | Bank of America | |
| 38.016 | First Financial Bankshares Inc | Merrill Lynch | | | | Merrill Lynch | 1.088 |
| 14.177 | First Financial Bankshares Inc | Barclays Bank | 11.394 | 12.553 | First of Long Island Corp | Barclays Bank | 5.398 |
| 9.615 | First Financial Bankshares Inc | Goldman Sachs | 20.148 | 31.183 | First of Long Island Corp | Goldman Sachs | 9.667 |
| 42.918 | First Financial Corp | HSBC | (4.638) | 17.344 | First of Long Island Corp | HSBC | 2.081 |
| | | | | 9.205 | First of Long Island Corp | Morgan Stanley | 3.958 |
| 7.939 | First Financial Corp | | | (3.731) | First Republic Bank | Bank of America | |
| 2.114 | First Financial Corp | Morgan Stanley | 3.724 | | | Merrill Lynch | (62.942) |
| 4.102 | First Financial Corp | Bank of America | | 11.870 | First Republic Bank | Barclays Bank | 80.953 |
| | | Merrill Lynch | 40.343 | (3.528) | First Republic Bank | Barclays Bank | (24.061) |
| | | Barclays Bank | 3.414 | (827) | First Republic Bank | Goldman Sachs | (13.951) |
| | | Goldman Sachs | 1.987 | 1.855 | First Republic Bank | HSBC | 21.388 |
| | | HSBC | 2.256 | (3.205) | First Republic Bank | HSBC | (36.954) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 19.817 | First Savings Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 27.347 | (5.497) | FleetCor Technologies Inc | Goldman Sachs | (113.348) |
| 2.544 | First Savings Financial Group Inc | Barclays Bank | 2.976 | 398 | FleetCor Technologies Inc | Goldman Sachs | 7.595 |
| 6.417 | First Savings Financial Group Inc | Goldman Sachs | 8.855 | (1.515) | FleetCor Technologies Inc | HSBC | (42.460) |
| 966 | First Savings Financial Group Inc | HSBC | 1.710 | 204 | FleetCor Technologies Inc | HSBC | 4.824 |
| 1.167 | First Savings Financial Group Inc | Morgan Stanley | 1.365 | (1.685) | FleetCor Technologies Inc | Morgan Stanley | (14.862) |
| (6.865) | First Solar Inc | Barclays Bank | (43.044) | 525 | FleetCor Technologies Inc | Morgan Stanley | 4.631 |
| (5.643) | First Solar Inc | Goldman Sachs | (36.873) | 97.789 | Flex Ltd | Barclays Bank | 78.231 |
| (5.761) | First Solar Inc | HSBC | (23.505) | 62.238 | Flex Ltd | Goldman Sachs | 52.022 |
| 1.768 | First United Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.829 | 4.385 | Flex Ltd | HSBC | 2.127 |
| 4.382 | First United Corp | Barclays Bank | 8.764 | (12.671) | Flex Ltd | HSBC | (8.743) |
| 20.049 | First United Corp | Goldman Sachs | 32.078 | 9.889 | Flex Ltd | Morgan Stanley | 7.911 |
| 17.228 | First United Corp | Morgan Stanley | 34.456 | (3.576) | Flexsteel Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 39 |
| 3.140 | First Watch Restaurant Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6.563 | (11.802) | Flexsteel Industries Inc | Barclays Bank | (8.497) |
| 15.650 | First Watch Restaurant Group Inc | Barclays Bank | 17.528 | (1.067) | Flexsteel Industries Inc | Goldman Sachs | (128) |
| 2.935 | First Watch Restaurant Group Inc | Goldman Sachs | 6.134 | (3.070) | Flexsteel Industries Inc | Morgan Stanley | (2.210) |
| 11.104 | First Watch Restaurant Group Inc | HSBC | 41.529 | (337) | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 650 |
| 4.569 | First Watch Restaurant Group Inc | Morgan Stanley | 5.117 | 662 | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 3.608 |
| 2.372 | First Western Financial Inc | Barclays Bank | 2.657 | (9.819) | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (55.974) |
| 4.850 | First Western Financial Inc | Goldman Sachs | 922 | 1.412 | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | 7.879 |
| 10.254 | First Western Financial Inc | HSBC | (2.358) | (2.282) | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (10.493) |
| (1.323) | FirstCash Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (900) | 2.238 | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | HSBC | 7.122 |
| (1.646) | FirstCash Holdings Inc | Barclays Bank | (3.276) | (357) | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.992) |
| (5.816) | FirstCash Holdings Inc | Goldman Sachs | (3.955) | 2.643 | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 14.748 |
| (858) | FirstCash Holdings Inc | HSBC | (446) | (76.369) | Flotek Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.964) |
| (3.009) | FirstCash Holdings Inc | Morgan Stanley | (5.988) | (11.910) | Flotek Industries Inc | Goldman Sachs | (774) |
| (704) | FirstEnergy Corp | Bank of America Merrill Lynch | (781) | (38.629) | Flotek Industries Inc | HSBC | (7.533) |
| (50.813) | FirstEnergy Corp | Goldman Sachs | (56.402) | (72.024) | Flotek Industries Inc | Morgan Stanley | (7.563) |
| (88.823) | FirstEnergy Corp | HSBC | (61.288) | (24.881) | Flowers Foods Inc | Barclays Bank | (23.637) |
| (44.660) | FirstEnergy Corp | Morgan Stanley | (7.146) | 30.119 | Flowers Foods Inc | Barclays Bank | 28.613 |
| (4.949) | Fiserv Inc | Bank of America Merrill Lynch | (20.390) | (14.009) | Flowers Foods Inc | Goldman Sachs | 560 |
| (20.841) | Fiserv Inc | Barclays Bank | (32.095) | 15.334 | Flowers Foods Inc | Goldman Sachs | 8.808 |
| (7.209) | Fiserv Inc | Goldman Sachs | (29.702) | (21.198) | Flowers Foods Inc | HSBC | 4.664 |
| (16.363) | Fiserv Inc | HSBC | (100.519) | 20.871 | Flowers Foods Inc | HSBC | (2.878) |
| 15.780 | Fisker Inc | Goldman Sachs | (8.448) | 3.611 | Flowers Foods Inc | Morgan Stanley | 3.430 |
| 6.822 | Fisker Inc | Morgan Stanley | 5.460 | (10.587) | Flowerserve Corp | Bank of America Merrill Lynch | (10.905) |
| (1.795) | Five Below Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12.906 | (3.697) | Flowerserve Corp | Barclays Bank | (3.179) |
| (1.567) | Five Below Inc | Barclays Bank | (27.125) | (56.722) | Flowerserve Corp | Goldman Sachs | (58.424) |
| (2.616) | Five Below Inc | Goldman Sachs | (7.055) | 7.767 | Fluence Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 14.135 |
| (3.735) | Five Below Inc | HSBC | (20.899) | 10.841 | Fluence Energy Inc | Barclays Bank | 7.263 |
| (573) | Five Below Inc | Morgan Stanley | (9.919) | 3.610 | Fluence Energy Inc | HSBC | 3.646 |
| (2.284) | Five Star Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (1.873) | 20.543 | Fluent Inc | Goldman Sachs | 822 |
| (2.094) | Five Star Bancorp | Barclays Bank | 1.361 | 4.407 | Fluent Inc | Morgan Stanley | 88 |
| (4.620) | Five Star Bancorp | Goldman Sachs | (2.922) | 26.030 | Fluor Corp | Goldman Sachs | 18.221 |
| (6.296) | Five Star Bancorp | HSBC | 5.603 | 4.802 | Fluor Corp | HSBC | 13.734 |
| 8.639 | Five Star Senior Living Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.333 | 9.057 | Flushing Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 6.521 |
| 21.349 | Five Star Senior Living Inc | Barclays Bank | 5.124 | 18.862 | Flushing Financial Corp | Barclays Bank | 7.922 |
| 3.112 | Five Star Senior Living Inc | Goldman Sachs | 840 | 27.036 | Flushing Financial Corp | Goldman Sachs | 19.466 |
| 3.189 | Five Star Senior Living Inc | Morgan Stanley | 765 | 15.514 | Flushing Financial Corp | HSBC | 11.004 |
| (2.889) | Five9 Inc | Barclays Bank | (13.578) | 6.342 | Flushing Financial Corp | Morgan Stanley | 2.664 |
| (6.196) | Five9 Inc | Goldman Sachs | (32.095) | (7.261) | Flywire Corp | Barclays Bank | (7.406) |
| (5.487) | Five9 Inc | HSBC | (31.551) | (6.786) | Flywire Corp | HSBC | 19.204 |
| (2.773) | Five9 Inc | Morgan Stanley | (13.033) | (2.715) | Flywire Corp | Morgan Stanley | (2.769) |
| 2.089 | FleetCor Technologies Inc | Barclays Bank | 18.425 | (3.214) | FMC Corp | Bank of America Merrill Lynch | (21.277) |
| | | | | (2.005) | FMC Corp | Barclays Bank | (261) |
| | | | | 3.204 | FMC Corp | Goldman Sachs | 21.210 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 17.954 | FMC Corp | HSBC | 174.692 | 3.837 | Fortive Corp | Goldman Sachs | 7.343 |
| (1.352) | FMC Corp | Morgan Stanley | (176) | 7.040 | Fortive Corp | HSBC | 12.960 |
| (91.315) | FNB Corp | Bank of America | | (83.042) | Fortress Biotech Inc | Barclays Bank | (1.553) |
| | | Merrill Lynch | (41.245) | 5.825 | Fortune Brands Home & Security Inc | Barclays Bank | 9.145 |
| (85.096) | FNB Corp | Barclays Bank | (32.049) | (1.553) | Fortune Brands Home & Security Inc | Barclays Bank | (2.438) |
| (51.207) | FNB Corp | Goldman Sachs | (22.556) | 31.681 | Fortune Brands Home & Security Inc | Goldman Sachs | 12.672 |
| (76.647) | FNB Corp | HSBC | (41.102) | (2.714) | Fortune Brands Home & Security Inc | Goldman Sachs | (1.086) |
| (58.900) | FNB Corp | Morgan Stanley | (21.204) | 2.567 | Fortune Brands Home & Security Inc | HSBC | (3.665) |
| (5.147) | Focus Financial Partners Inc 'A' | Bank of America | | 1.750 | Fortune Brands Home & Security Inc | Morgan Stanley | 2.748 |
| (12.204) | Focus Financial Partners Inc 'A' | Merrill Lynch | (5.444) | (7.510) | Fortune Brands Home & Security Inc | Morgan Stanley | (11.791) |
| (19.453) | Focus Financial Partners Inc 'A' | Barclays Bank | (5.248) | (6.616) | Forward Air Corp | Barclays Bank | 4.367 |
| (15.064) | Focus Financial Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | (30.347) | (7.149) | Forward Air Corp | Goldman Sachs | 19.874 |
| (4.791) | Focus Financial Partners Inc 'A' | HSBC | (33.690) | (19.495) | Fossil Group Inc | Goldman Sachs | 6.043 |
| 966 | Foghorn Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (2.060) | (14.853) | Fossil Group Inc | HSBC | 6.632 |
| 10.600 | Foghorn Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.758 | (6.395) | Fossil Group Inc | Morgan Stanley | (3.261) |
| 4.050 | FONAR Corp | HSBC | 32.224 | 53.790 | Four Corners Property Trust Inc (REIT) | Bank of America | |
| 5.305 | FONAR Corp | Goldman Sachs | (1.134) | 5.564 | Four Corners Property Trust Inc (REIT) | Merrill Lynch | 37.653 |
| (1.843) | Foot Locker Inc | Morgan Stanley | 265 | 37.556 | Four Corners Property Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 6.009 |
| | | Bank of America | | 41.609 | Four Corners Property Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 26.289 |
| 32.431 | Foot Locker Inc | Merrill Lynch | (3.741) | 29.444 | Four Corners Property Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 70.725 |
| (12.379) | Foot Locker Inc | HSBC | 131.670 | 25.058 | Fox Corp 'A' | Morgan Stanley | 31.800 |
| 7.082 | Ford Motor Co | HSBC | (51.474) | 22.288 | Fox Corp 'A' | Bank of America | |
| | | Bank of America | | 76.737 | Fox Corp 'A' | Merrill Lynch | 42.849 |
| (20.957) | Ford Motor Co | Merrill Lynch | 5.568 | 30.094 | Fox Corp 'A' | Barclays Bank | 26.968 |
| 11.624 | Ford Motor Co | Barclays Bank | (13.203) | 31.872 | Fox Corp 'A' | Goldman Sachs | 131.220 |
| 7.560 | Ford Motor Co | Goldman Sachs | 4.766 | 802 | Fox Factory Holding Corp | HSBC | 65.780 |
| (8.442) | Ford Motor Co | HSBC | (463) | (1.211) | Fox Factory Holding Corp | Morgan Stanley | 38.565 |
| (5.060) | Forestar Group Inc | Morgan Stanley | (5.318) | 1.146 | Fox Factory Holding Corp | Bank of America | |
| | | Bank of America | | (2.717) | Fox Factory Holding Corp | Merrill Lynch | 3.500 |
| (10.048) | Forestar Group Inc | Merrill Lynch | (4.453) | (484) | Fox Factory Holding Corp | Barclays Bank | (126) |
| (19.858) | Forestar Group Inc | Barclays Bank | (4.220) | (2.729) | Fox Factory Holding Corp | Barclays Bank | 299 |
| (12.519) | Forestar Group Inc | Goldman Sachs | (17.089) | 204 | Fox Factory Holding Corp | Goldman Sachs | 1.399 |
| (7.057) | Forestar Group Inc | HSBC | (15.663) | (839) | Fox Factory Holding Corp | HSBC | (2.989) |
| (1.560) | Forian Inc | Morgan Stanley | (2.964) | 4.939 | Franchise Group Inc | HSBC | 353 |
| | | Bank of America | | (8.487) | Franklin BSP Realty Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 92 |
| (1.240) | Forian Inc | Merrill Lynch | (679) | (11.448) | Franklin BSP Realty Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 13.138 |
| 17.946 | Forma Therapeutics Holdings Inc | Barclays Bank | (564) | 18.488 | Franklin Covey Co | Bank of America | |
| | | Bank of America | | 10.311 | Franklin Covey Co | Merrill Lynch | 31.708 |
| 9.641 | Forma Therapeutics Holdings Inc | Merrill Lynch | (14.716) | 966 | Franklin Covey Co | Barclays Bank | 75.494 |
| | | Barclays Bank | | 13.267 | Franklin Electric Co Inc | Goldman Sachs | 20.117 |
| 9.569 | Forma Therapeutics Holdings Inc | Barclays Bank | (2.217) | 18.718 | Franklin Electric Co Inc | HSBC | 29.013 |
| | | Goldman Sachs | | 5.278 | Franklin Electric Co Inc | Morgan Stanley | 9.975 |
| 19.135 | Forma Therapeutics Holdings Inc | Goldman Sachs | (7.847) | (15.039) | Franklin Resources Inc | Bank of America | |
| 12.244 | Forma Therapeutics Holdings Inc | HSBC | (10.142) | (38.988) | Franklin Resources Inc | Merrill Lynch | (36.244) |
| (6.131) | FormFactor Inc | Morgan Stanley | (2.816) | (28.703) | Franklin Resources Inc | Barclays Bank | (52.244) |
| | | Bank of America | | (6.140) | Franklin Resources Inc | Goldman Sachs | (69.174) |
| (16.254) | FormFactor Inc | Merrill Lynch | (9.748) | (2.334) | Franklin Resources Inc | HSBC | (12.619) |
| (11.683) | FormFactor Inc | Barclays Bank | (20.968) | (44.111) | Franklin Street Properties Corp (REIT) | Morgan Stanley | (3.128) |
| (3.849) | FormFactor Inc | Goldman Sachs | (18.576) | | | Bank of America | |
| (6.340) | FormFactor Inc | HSBC | (10.200) | | | Merrill Lynch | 566 |
| (6.340) | FormFactor Inc | Morgan Stanley | (8.179) | | | | |
| 18.918 | Forrester Research Inc | Barclays Bank | 37.079 | | | | |
| 20.305 | Forrester Research Inc | Goldman Sachs | 26.803 | | | | |
| 1.442 | Forte Biosciences Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 317 | | | | |
| 651 | Forte Biosciences Inc | Barclays Bank | 137 | | | | |
| 20.247 | Forte Biosciences Inc | Goldman Sachs | 4.454 | | | | |
| 12.755 | Forte Biosciences Inc | HSBC | 829 | | | | |
| 762 | Fortinet Inc | Barclays Bank | 4.527 | | | | |
| 11.390 | Fortitude Gold Corp | Barclays Bank | (399) | | | | |
| 21.664 | Fortitude Gold Corp | Morgan Stanley | (758) | | | | |
| 4.761 | Fortive Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 13.712 | | | | |
| 13.206 | Fortive Corp | Barclays Bank | 30.770 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (42.859) | Franklin Street Properties Corp (REIT) | Barclays Bank | (2.143) | (18.253) | FuelCell Energy Inc | Morgan Stanley | (7.301) |
| (21.540) | Franklin Street Properties Corp (REIT) | Goldman Sachs | (461) | (4.109) | Fulgent Genetics Inc | Barclays Bank | 2.219 |
| (56.086) | Franklin Street Properties Corp (REIT) | HSBC | 7.185 | (5.226) | Fulgent Genetics Inc | HSBC | (27.489) |
| (4.806) | Franklin Street Properties Corp (REIT) | Morgan Stanley | (240) | (30.242) | Full House Resorts Inc | Goldman Sachs | (1.815) |
| 26.263 | Freeport-McMoRan Inc | Bank of America | | 14.598 | Fulton Financial Corp | Bank of America | |
| 15.030 | Freeport-McMoRan Inc | Barclays Bank | 121.860 | | Fulton Financial Corp | Merrill Lynch | 10.803 |
| 17.100 | Freeport-McMoRan Inc | Goldman Sachs | 21.643 | 115.182 | Fulton Financial Corp | Barclays Bank | 33.403 |
| 18.577 | Freeport-McMoRan Inc | Morgan Stanley | 79.344 | 111.644 | Fulton Financial Corp | Goldman Sachs | 82.617 |
| (11.542) | FreightCar America Inc | Bank of America | 26.751 | 145.409 | Fulton Financial Corp | HSBC | 27.628 |
| | | Merrill Lynch | (3.001) | 52.232 | Fulton Financial Corp | Morgan Stanley | 15.147 |
| 1.856 | Frequency Therapeutics Inc | Bank of America | (269) | 7.022 | Funko Inc 'A' | Barclays Bank | 10.322 |
| | | Merrill Lynch | (1.391) | 2.260 | Funko Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.085 |
| 13.244 | Frequency Therapeutics Inc | Barclays Bank | (1.391) | (24.466) | FutureFuel Corp | Bank of America | |
| 27.970 | Frequency Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (4.056) | (32.625) | FutureFuel Corp | Merrill Lynch | (12.478) |
| 18.304 | Frequency Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.922) | (28.056) | FutureFuel Corp | Barclays Bank | (8.809) |
| (12.332) | Fresh Del Monte Produce Inc | Barclays Bank | (18.991) | (3.528) | FutureFuel Corp | Goldman Sachs | (14.309) |
| (14.149) | Fresh Del Monte Produce Inc | Goldman Sachs | (3.396) | (11.711) | FVCBankcorp Inc | Morgan Stanley | (953) |
| (10.739) | Fresh Del Monte Produce Inc | HSBC | (7.732) | (1.603) | FVCBankcorp Inc | Barclays Bank | (7.495) |
| (20.526) | Fresh Del Monte Produce Inc | Morgan Stanley | (31.610) | (1.603) | FVCBankcorp Inc | Goldman Sachs | (1.170) |
| (4.449) | Freshpet Inc | Barclays Bank | (46.536) | (27.591) | FVCBankcorp Inc | HSBC | (6.346) |
| (5.151) | Freshpet Inc | Goldman Sachs | (30.843) | 29.012 | G1 Therapeutics Inc | Barclays Bank | 7.833 |
| (1.323) | Freshpet Inc | HSBC | (18.337) | 8.815 | G1 Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 6.022 |
| (3.245) | Freshpet Inc | Morgan Stanley | (33.943) | 17.578 | G1 Therapeutics Inc | HSBC | 6.328 |
| (63.674) | Freshworks Inc 'A' | Barclays Bank | — | 5.431 | G1 Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.466 |
| (8.424) | Freshworks Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.117) | 3.939 | Gaia Inc | Bank of America | |
| (18.170) | Freshworks Inc 'A' | Morgan Stanley | — | | Gaia Inc | Merrill Lynch | 788 |
| 7.468 | frontdoor Inc | Barclays Bank | (4.406) | 18.639 | Gaia Inc | Goldman Sachs | 3.728 |
| (11.730) | frontdoor Inc | Morgan Stanley | 6.921 | 2.423 | Gaia Inc | HSBC | 606 |
| 2.270 | frontdoor Inc | Morgan Stanley | (1.339) | 2.331 | Gaia Inc | Morgan Stanley | 326 |
| (1.465) | Frontier Communications Parent Inc | Bank of America | | 1.284 | Galera Therapeutics Inc | Bank of America | |
| (30.868) | Frontier Communications Parent Inc | Merrill Lynch | (4.673) | | Galera Therapeutics Inc | Merrill Lynch | (167) |
| (47.241) | Frontier Communications Parent Inc | Barclays Bank | (82.726) | 11.512 | Galera Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.497) |
| (19.815) | Frontier Communications Parent Inc | Goldman Sachs | (150.699) | 13.030 | Galera Therapeutics Inc | HSBC | 2.215 |
| 36.239 | Frontier Group Holdings Inc | Barclays Bank | 43.124 | 3.813 | Galera Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (572) |
| 68.115 | Frontier Group Holdings Inc | Goldman Sachs | 69.477 | (9.367) | GAMCO Investors Inc 'A' | Bank of America | |
| 84.784 | Frontier Group Holdings Inc | HSBC | 130.323 | (5.727) | GAMCO Investors Inc 'A' | Merrill Lynch | (6.182) |
| 31.050 | Frontier Group Holdings Inc | Morgan Stanley | 36.949 | (2.552) | GAMCO Investors Inc 'A' | Barclays Bank | (515) |
| (18.424) | Frontline Ltd | Barclays Bank | (17.871) | (3.352) | GAMCO Investors Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.684) |
| 2.045 | FRP Holdings Inc | Goldman Sachs | 8.548 | (29.029) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | HSBC | — |
| 13.774 | FS Bancorp Inc | Bank of America | | (53.668) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 23.967 | (42.812) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | Merrill Lynch | (61.243) |
| 14.698 | FS Bancorp Inc | Barclays Bank | 17.932 | (32.760) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (136.853) |
| 796 | FS Bancorp Inc | Goldman Sachs | 1.385 | (32.760) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (87.337) |
| 14.798 | FS Bancorp Inc | HSBC | 10.951 | (32.760) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | HSBC | (114.745) |
| 14.436 | FS Bancorp Inc | Morgan Stanley | 17.612 | (51.131) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (130.384) |
| 532 | F-star Therapeutics Inc' | Goldman Sachs | 213 | (6.059) | GAN Ltd | Barclays Bank | (1.272) |
| 532 | F-star Therapeutics Inc' | Goldman Sachs | 213 | (22.888) | GAN Ltd | Goldman Sachs | 3.891 |
| 7.956 | FTC Solar Inc | Barclays Bank | 2.944 | 13.817 | Gannett Co Inc | Bank of America | |
| 11.307 | FTC Solar Inc | Goldman Sachs | 15.378 | | Gannett Co Inc | Merrill Lynch | (829) |
| (2.984) | FTI Consulting Inc | Bank of America | | 21.338 | Gannett Co Inc | Barclays Bank | 2.562 |
| | | Merrill Lynch | 13.219 | 12.975 | Gannett Co Inc | Goldman Sachs | 1.020 |
| (5.481) | FTI Consulting Inc | Barclays Bank | (15.840) | 18.099 | Gannett Co Inc | HSBC | 3.184 |
| (1.804) | FTI Consulting Inc | Goldman Sachs | 7.992 | 4.245 | Gannett Co Inc | Morgan Stanley | 340 |
| (7.926) | FTI Consulting Inc | HSBC | 19.114 | 6.307 | Gap Inc | Bank of America | |
| (4.124) | FuelCell Energy Inc | Bank of America | | | Gap Inc | Merrill Lynch | 1.654 |
| | | Merrill Lynch | (3.052) | 9.865 | Gap Inc | Barclays Bank | 5.327 |
| (77.403) | FuelCell Energy Inc | Goldman Sachs | (57.278) | (13.172) | Gap Inc | Goldman Sachs | 21.734 |
| | | | | 13.157 | Gap Inc | Goldman Sachs | (21.709) |
| | | | | 30.399 | Gap Inc | HSBC | (49.854) |
| | | | | 4.734 | Garmin Ltd | Bank of America | |
| | | | | | Garmin Ltd | Merrill Lynch | 13.918 |
| | | | | 12.478 | Garmin Ltd | Barclays Bank | 35.437 |
| | | | | 18.375 | Garmin Ltd | Goldman Sachs | 54.022 |
| | | | | 4.261 | Garmin Ltd | HSBC | 6.434 |
| | | | | 9.561 | Garmin Ltd | Morgan Stanley | 27.153 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 812 | Gartner Inc | Bank of America | | (18.827) | Genie Energy Ltd 'B' | Goldman Sachs | (9.414) |
| | | Merrill Lynch | 7.056 | (7.176) | Genie Energy Ltd 'B' | HSBC | (12.271) |
| 1.661 | Gartner Inc | Barclays Bank | 19.799 | (13.576) | Genie Energy Ltd 'B' | Morgan Stanley | (9.367) |
| 2.270 | Gartner Inc | Goldman Sachs | 19.726 | (64.713) | Genius Brands | | |
| 3.487 | Gartner Inc | HSBC | 79.504 | | International Inc | Barclays Bank | 602 |
| 529 | Gartner Inc | Morgan Stanley | 6.306 | (63.035) | Genius Brands | | |
| (17.336) | Gates Industrial Corp Plc | Barclays Bank | (3.641) | | International Inc | Morgan Stanley | 586 |
| (3.503) | Gates Industrial Corp Plc | Goldman Sachs | (911) | 4.441 | Genpact Ltd | Bank of America | |
| (4.526) | Gates Industrial Corp Plc | HSBC | (3.757) | | Merrill Lynch | | 6.750 |
| (33.158) | Gates Industrial Corp Plc | Morgan Stanley | (3.271) | 6.904 | Genpact Ltd | Barclays Bank | 14.706 |
| (30.614) | Gatos Silver Inc | Barclays Bank | (4.898) | 34.929 | Genpact Ltd | Goldman Sachs | 53.092 |
| (26.880) | Gatos Silver Inc | HSBC | (11.558) | 12.458 | Genpact Ltd | HSBC | 53.694 |
| 1.232 | GATX Corp | Bank of America | | 4.072 | Genpact Ltd | Morgan Stanley | 8.674 |
| | | Merrill Lynch | (6.961) | 5.618 | Genprex Inc | Barclays Bank | (449) |
| 13.457 | GATX Corp | Barclays Bank | (15.626) | 4.965 | Genprex Inc | Goldman Sachs | (149) |
| 2.020 | GATX Corp | HSBC | (1.475) | 9.799 | Genprex Inc | HSBC | 980 |
| 3.686 | GATX Corp | Morgan Stanley | (4.239) | 4.105 | Genprex Inc | Morgan Stanley | (328) |
| 37.950 | GCM Grosvenor Inc 'A' | Barclays Bank | 7.970 | (26.428) | Genprex Inc | Bank of America | |
| 39.501 | GCM Grosvenor Inc 'A' | Goldman Sachs | 11.455 | | Genprex Inc | Merrill Lynch | (40.594) |
| 40.017 | GCM Grosvenor Inc 'A' | HSBC | (12.005) | (26.002) | Genprex Inc | Barclays Bank | (33.283) |
| 10.233 | GCM Grosvenor Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.149 | (60.588) | Genprex Inc | Goldman Sachs | (104.314) |
| (60.317) | Genasys Inc | Bank of America | | (66.264) | Genprex Inc | HSBC | (119.938) |
| | | Merrill Lynch | (57.301) | (28.964) | Genprex Inc | Morgan Stanley | (37.074) |
| (16.015) | Genasys Inc | Barclays Bank | (9.929) | (1.079) | Genprex Inc | Bank of America | |
| (6.728) | Genasys Inc | Goldman Sachs | (6.392) | | Genprex Inc | Merrill Lynch | (1.597) |
| (18.950) | Genasys Inc | HSBC | (4.548) | (7.239) | Genprex Inc | Barclays Bank | (652) |
| (5.637) | Genasys Inc | Morgan Stanley | (3.495) | (5.630) | Genprex Inc | Goldman Sachs | (8.332) |
| 79 | Genco Shipping & Trading Ltd | Bank of America | | (5.250) | Genprex Inc | HSBC | (3.255) |
| | | Merrill Lynch | 292 | 999 | Genuine Parts Co | Bank of America | |
| 7.969 | Genco Shipping & Trading Ltd | | | | Genuine Parts Co | Merrill Lynch | 659 |
| 5.178 | Genco Shipping & Trading Ltd | Goldman Sachs | 29.485 | 8.526 | Genuine Parts Co | Goldman Sachs | 5.627 |
| | | HSBC | 26.045 | 9.309 | Genuine Parts Co | HSBC | 46.452 |
| 14.041 | Gencon Industries Inc | Bank of America | | 1.389 | Genuine Parts Co | Morgan Stanley | 10.126 |
| | | Merrill Lynch | 7.301 | (14.635) | Genworth Financial Inc 'A' | Bank of America | |
| 11.115 | Gencon Industries Inc | Barclays Bank | 2.223 | (24.127) | Genworth Financial Inc 'A' | Merrill Lynch | (1.192) |
| 17.670 | Gencon Industries Inc | Goldman Sachs | 9.188 | (46.036) | Genworth Financial Inc 'A' | Barclays Bank | (3.137) |
| 5.858 | Gencon Industries Inc | HSBC | 3.515 | (20.133) | Genworth Financial Inc 'A' | Goldman Sachs | (5.110) |
| 13.313 | Gencon Industries Inc | Morgan Stanley | 2.663 | (10.122) | Genworth Financial Inc 'A' | HSBC | (1.034) |
| 467 | Generac Holdings Inc | Barclays Bank | 7.869 | (10.773) | Geospace Technologies Corp | Bank of America | |
| (859) | Generac Holdings Inc | Goldman Sachs | (23.777) | (10.773) | Geospace Technologies Corp | Merrill Lynch | (11.843) |
| (708) | Generac Holdings Inc | HSBC | (14.217) | (16.314) | Geospace Technologies Corp | Barclays Bank | (5.817) |
| (490) | Generac Holdings Inc | Morgan Stanley | (8.257) | | Geospace Technologies Corp | Goldman Sachs | (19.087) |
| 797 | Generac Holdings Inc | Morgan Stanley | 13.429 | (7.864) | Geospace Technologies Corp | Morgan Stanley | (4.247) |
| (4.641) | General Electric Co | Bank of America | | (5.508) | German American Bancorp Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (21.469) | | German American Bancorp Inc | Merrill Lynch | (14.813) |
| (27.867) | General Electric Co | Barclays Bank | (93.633) | (1.774) | German American Bancorp Inc | Barclays Bank | (1.721) |
| (61.216) | General Mills Inc | Goldman Sachs | 273.024 | (2.635) | German American Bancorp Inc | Goldman Sachs | (4.919) |
| (56.592) | General Mills Inc | HSBC | 250.261 | (1.652) | German American Bancorp Inc | HSBC | (763) |
| (28.877) | General Mills Inc | Morgan Stanley | (39.783) | (38.702) | German American Bancorp Inc | Morgan Stanley | (36.775) |
| 40.906 | General Motors Co | Bank of America | | (193.284) | German American Bancorp Inc | Barclays Bank | (19.328) |
| | | Merrill Lynch | 48.269 | (11.763) | Geron Corp | Bank of America | |
| (2.221) | General Motors Co | Bank of America | | | Getty Realty Corp (REIT) | Merrill Lynch | (9.881) |
| | | Merrill Lynch | (2.621) | (33.100) | Getty Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | (26.811) |
| (223) | General Motors Co | Goldman Sachs | (709) | (34.924) | Getty Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | (29.336) |
| (10.060) | General Motors Co | HSBC | (7.105) | (25.735) | Getty Realty Corp (REIT) | HSBC | (53.132) |
| 19.020 | General Motors Co | Morgan Stanley | 43.366 | (3.009) | Getty Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | (2.437) |
| (2.853) | Generation Bio Co | Bank of America | | (79.115) | Gevo Inc | Barclays Bank | (34.019) |
| | | Merrill Lynch | 856 | 4.792 | Gibraltar Industries Inc | Bank of America | |
| (4.612) | Generation Bio Co | Barclays Bank | (600) | | Gibraltar Industries Inc | Merrill Lynch | 18.689 |
| (6.518) | Generation Bio Co | Goldman Sachs | 1.955 | 8.918 | Gibraltar Industries Inc | Barclays Bank | 12.753 |
| (2.860) | Generation Bio Co | HSBC | 86 | 9.675 | Gibraltar Industries Inc | Goldman Sachs | 37.732 |
| (781) | Genesco Inc | Bank of America | | 8.835 | Gibraltar Industries Inc | HSBC | (3.357) |
| | | Merrill Lynch | 1.078 | 15.937 | G-III Apparel Group Ltd | Barclays Bank | 32.352 |
| (3.062) | Genesco Inc | Barclays Bank | (8.839) | | | | |
| (7.863) | Genesco Inc | Goldman Sachs | 10.780 | | | | |
| (5.533) | Genesco Inc | HSBC | 5.694 | | | | |
| (33.193) | Genie Energy Ltd 'B' | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (16.597) | | | | |
| (5.009) | Genie Energy Ltd 'B' | Barclays Bank | (3.456) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 17.755 | G-III Apparel Group Ltd | Goldman Sachs | 2.663 | 4.940 | Global Payments Inc | Goldman Sachs | 52.216 |
| 14.870 | G-III Apparel Group Ltd | HSBC | (1.222) | 6.977 | Global Payments Inc | HSBC | 82.275 |
| 4.461 | G-III Apparel Group Ltd | Morgan Stanley | 9.056 | 12.798 | Global Water Resources Inc | Barclays Bank | 6.015 |
| (19.283) | Gilead Sciences Inc | Barclays Bank | (4.628) | 25.004 | Global Water Resources Inc | Goldman Sachs | 24.254 |
| (15.056) | Gilead Sciences Inc | Goldman Sachs | (24.993) | 14.225 | Global Water Resources Inc | Morgan Stanley | 6.686 |
| (33.725) | Gilead Sciences Inc | HSBC | (83.644) | (2.125) | GLOBALFOUNDRIES Inc | Barclays Bank | (8.914) |
| (10.480) | Ginkgo Bioworks Holdings Inc | Barclays Bank | (4.244) | (123) | GLOBALFOUNDRIES Inc | HSBC | (794) |
| (48.128) | Ginkgo Bioworks Holdings Inc | Goldman Sachs | (31.524) | (16.972) | GLOBALFOUNDRIES Inc | Morgan Stanley | (71.198) |
| (12.267) | Ginkgo Bioworks Holdings Inc | Morgan Stanley | (4.968) | (125.494) | Globalstar Inc | Barclays Bank | (8.785) |
| (5.792) | Gitlab Inc 'A' | Barclays Bank | (19.924) | 747 | Globant SA | Bank of America | |
| (5.989) | Gitlab Inc 'A' | Goldman Sachs | (8.744) | (1.131) | Globant SA | Merrill Lynch | 11.877 |
| (4.213) | Gitlab Inc 'A' | Morgan Stanley | (14.493) | 726 | Globant SA | Barclays Bank | (4.886) |
| 13.496 | Glacier Bancorp Inc | Bank of America | | (1.736) | Globant SA | Barclays Bank | 1.358 |
| 24.563 | Glacier Bancorp Inc | Merrill Lynch | 36.590 | (529) | Globant SA | Goldman Sachs | (14.443) |
| 8.372 | Glacier Bancorp Inc | Barclays Bank | 40.038 | 864 | Globant SA | HSBC | (10.128) |
| 4.086 | Glacier Bancorp Inc | Goldman Sachs | 11.794 | (279) | Globant SA | HSBC | 8.354 |
| 9.277 | Glacier Bancorp Inc | HSBC | 7.240 | 2.498 | Globus Medical Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.924) |
| (2.086) | Gladstone Commercial Corp (REIT) | Morgan Stanley | 15.122 | 13.008 | Globus Medical Inc 'A' | Bank of America | |
| (71.567) | Gladstone Commercial Corp (REIT) | Merrill Lynch | (1.631) | 2.791 | Globus Medical Inc 'A' | Merrill Lynch | 5.720 |
| (55.718) | Gladstone Commercial Corp (REIT) | Barclays Bank | (46.519) | 9.297 | Globus Medical Inc 'A' | Barclays Bank | 5.073 |
| (4.535) | Gladstone Commercial Corp (REIT) | Goldman Sachs | (10.586) | (8.222) | GlycoMimetics Inc | Goldman Sachs | 6.391 |
| (19.784) | Gladstone Commercial Corp (REIT) | HSBC | (3.409) | (52.340) | GlycoMimetics Inc | HSBC | 55.038 |
| 2.830 | Gladstone Land Corp (REIT) | Morgan Stanley | (12.860) | 5.043 | GMS Inc | Bank of America | |
| (50.233) | Glatfelter Corp | Goldman Sachs | 2.179 | 9.411 | GMS Inc | Merrill Lynch | 9.305 |
| (15.658) | Glatfelter Corp | Barclays Bank | (28.633) | 4.104 | GMS Inc | Barclays Bank | 21.269 |
| (6.239) | Glatfelter Corp | Goldman Sachs | (13.466) | 5.283 | GMS Inc | Goldman Sachs | 8.537 |
| (663) | Glaukos Corp | HSBC | (3.057) | 239 | GoDaddy Inc 'A' | HSBC | 9.973 |
| (671) | Glaukos Corp | Bank of America | (1.618) | 8.608 | GoDaddy Inc 'A' | Bank of America | |
| (2.613) | Glaukos Corp | Merrill Lynch | (242) | (1.535) | GoDaddy Inc 'A' | Merrill Lynch | 796 |
| (7.125) | Glaukos Corp | Barclays Bank | (242) | 2.177 | GoDaddy Inc 'A' | Barclays Bank | 24.102 |
| (1.046) | Glaukos Corp | Goldman Sachs | (6.376) | 6.471 | GoDaddy Inc 'A' | Barclays Bank | (4.298) |
| (1.304) | Global Blood Therapeutics Inc | HSBC | (39.540) | 5.215 | GoDaddy Inc 'A' | Goldman Sachs | 7.467 |
| (757) | Global Blood Therapeutics Inc | Merrill Lynch | (1.618) | (8.076) | Gogo Inc | HSBC | 26.670 |
| (4.912) | Global Blood Therapeutics Inc | Barclays Bank | (242) | (6.160) | Gogo Inc | Morgan Stanley | 13.535 |
| (8.381) | Global Blood Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (11.347) | 57.878 | GoHealth Inc 'A' | Barclays Bank | (15.910) |
| (2.279) | Global Blood Therapeutics Inc | HSBC | (15.020) | 74.716 | GoHealth Inc 'A' | Morgan Stanley | (12.135) |
| 3.201 | Global Indemnity Group LLC 'A' | Morgan Stanley | 3.236 | 69.842 | GoHealth Inc 'A' | Bank of America | |
| 10.458 | Global Indemnity Group LLC 'A' | Barclays Bank | 1.440 | 104.264 | GoHealth Inc 'A' | Merrill Lynch | 12.305 |
| 2.515 | Global Indemnity Group LLC 'A' | Goldman Sachs | 14.223 | 41.351 | GoHealth Inc 'A' | Barclays Bank | 14.196 |
| 3.905 | Global Indemnity Group LLC 'A' | HSBC | 2.440 | 1.476 | Golar LNG Ltd | Goldman Sachs | 14.848 |
| (2.100) | Global Industrial Co | Morgan Stanley | 1.757 | 3.856 | Golar LNG Ltd | HSBC | 19.852 |
| (9.707) | Global Industrial Co | Bank of America | (1.932) | 6.814 | Golar LNG Ltd | Morgan Stanley | 7.857 |
| (3.007) | Global Industrial Co | Merrill Lynch | (20.773) | 4.627 | Golar LNG Ltd | Barclays Bank | 2.849 |
| (9.186) | Global Medical Inc (REIT) | Barclays Bank | (6.435) | 29.466 | Gold Resource Corp | Goldman Sachs | 8.290 |
| (67.443) | Global Medical Inc (REIT) | HSBC | (33.047) | 48.144 | Gold Resource Corp | HSBC | 35.773 |
| (117.089) | Global Medical Inc (REIT) | Goldman Sachs | (1.171) | 28.944 | Gold Resource Corp | Morgan Stanley | 8.930 |
| (107.204) | Global Medical Inc (REIT) | HSBC | (20.369) | 79.651 | Gold Resource Corp | Barclays Bank | (2.652) |
| (10.955) | Global Medical Inc (REIT) | Morgan Stanley | (5.368) | (27.711) | Golden Bull Ltd | Goldman Sachs | (3.370) |
| 20.367 | Global Payments Inc | Barclays Bank | 111.815 | 5.159 | Golden Entertainment Inc | HSBC | 4.342 |
| | | | | 5.351 | Golden Entertainment Inc | Morgan Stanley | (7.169) |
| | | | | 718 | Golden Entertainment Inc | Barclays Bank | (4.018) |
| | | | | 2.842 | Golden Entertainment Inc | Bank of America | |
| | | | | 1.252 | Golden Entertainment Inc | Merrill Lynch | 11.040 |
| | | | | (9.896) | Golden Entertainment Inc | Barclays Bank | 24.240 |
| | | | | (3.348) | Golden Entertainment Inc | Goldman Sachs | 1.537 |
| | | | | (197) | GoodRx Holdings Inc 'A' | HSBC | 11.721 |
| | | | | (18.231) | GoodRx Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 5.672 |
| | | | | (12.490) | GoodRx Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (99.851) |
| | | | | (10.633) | GoodRx Holdings Inc 'A' | HSBC | (65.587) |
| | | | | (11.995) | GoodRx Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.988) |
| | | | | 8.136 | Goodyear Tire & Rubber Co | Barclays Bank | 7.657 |
| | | | | 35.294 | Goodyear Tire & Rubber Co | Goldman Sachs | 4.621 |
| | | | | | | HSBC | 31.368 |
| | | | | | | Morgan Stanley | 5.038 |
| | | | | | | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 7.039 |
| | | | | | | Barclays Bank | 25.059 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-----------------|---|---|--------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 17.292 | Goodyear Tire & Rubber Co | Goldman Sachs | 11.532 | (53.995) | Graphic Packaging Holding Co | Morgan Stanley | (90.712) |
| 64.361 | Goodyear Tire & Rubber Co | HSBC | 77.627 | (8.416) | Graphite Bio Inc | Morgan Stanley | (168) |
| 29.355 | Goodyear Tire & Rubber Co | Morgan Stanley | 20.842 | (5.211) | Gray Television Inc | Barclays Bank | 2.814 |
| (7.673) | Goosehead Insurance Inc 'A' | Barclays Bank | (29.387) | (48.898) | Gray Television Inc | HSBC | (57.211) |
| (5.873) | Goosehead Insurance Inc 'A' | Goldman Sachs | (29.952) | (120.488) | Great Lakes Dredge & Dock Corp | Barclays Bank | (24.098) |
| (4.631) | Goosehead Insurance Inc 'A' | HSBC | (14.473) | (80.238) | Great Lakes Dredge & Dock Corp | Goldman Sachs | (48.143) |
| (1.381) | Goosehead Insurance Inc 'A' | Morgan Stanley | (5.289) | (7.560) | Great Lakes Dredge & Dock Corp | Morgan Stanley | (1.512) |
| 36.589 | GoPro Inc 'A' | Barclays Bank | 6.220 | (5.137) | Great Southern Bancorp Inc | Bank of America | |
| 17.696 | GoPro Inc 'A' | Goldman Sachs | (708) | (10.796) | Great Southern Bancorp Inc | Merrill Lynch | (7.654) |
| (773) | Gorman-Rupp Co | Bank of America | | (24.025) | Great Southern Bancorp Inc | Barclays Bank | (13.495) |
| (9.133) | Gorman-Rupp Co | Merrill Lynch | 487 | (9.374) | Great Southern Bancorp Inc | Goldman Sachs | (35.797) |
| (18.985) | Gorman-Rupp Co | Barclays Bank | (5.114) | (4.367) | Great Southern Bancorp Inc | HSBC | (562) |
| (760) | Gorman-Rupp Co | Goldman Sachs | 11.961 | 1.063 | Great Southern Bancorp Inc | Morgan Stanley | (5.459) |
| (30.142) | Gossamer Bio Inc | Morgan Stanley | (426) | | Green Brick Partners Inc | Bank of America | |
| 5.705 | Graco Inc | Goldman Sachs | 34.362 | 14.421 | Green Brick Partners Inc | Merrill Lynch | 1.658 |
| (23.454) | Graco Inc | Bank of America | | 8.121 | Green Brick Partners Inc | Barclays Bank | 29.851 |
| 8.754 | Graco Inc | Merrill Lynch | 3.203 | 4.341 | Green Brick Partners Inc | Goldman Sachs | 12.669 |
| (8.383) | Graco Inc | Barclays Bank | (43.390) | 9.648 | Green Brick Partners Inc | HSBC | 8.473 |
| 15.668 | Graco Inc | Goldman Sachs | 15.927 | (10.781) | Green Dot Corp 'A' | Morgan Stanley | 19.971 |
| (6.120) | Graco Inc | Goldman Sachs | (18.325) | (3.351) | Green Dot Corp 'A' | Barclays Bank | (4.420) |
| 17.174 | Graco Inc | HSBC | 23.189 | (3.048) | Green Plains Inc | HSBC | (14.342) |
| (10.915) | GrafTech International Ltd | HSBC | (9.259) | (10.009) | Green Plains Inc | Barclays Bank | 2.438 |
| (61.295) | GrafTech International Ltd | Morgan Stanley | 28.162 | (799) | Green Plains Inc | Goldman Sachs | (19.317) |
| (50.846) | GrafTech International Ltd | Bank of America | | (3.986) | Green Plains Inc | Morgan Stanley | 639 |
| (8.488) | GrafTech International Ltd | Merrill Lynch | (3.929) | (9.681) | Greenbrier Cos Inc | Bank of America | |
| (10.974) | Graham Corp | Barclays Bank | (29.422) | (4.723) | Greenbrier Cos Inc | Merrill Lynch | 4.544 |
| (7.047) | Graham Corp | Goldman Sachs | (18.305) | (2.397) | Greene County Bancorp Inc | Barclays Bank | (9.416) |
| (2.287) | Graham Corp | Morgan Stanley | (4.074) | (2.148) | Greene County Bancorp Inc | Goldman Sachs | 11.036 |
| (1.586) | Graham Corp | Bank of America | | (2.856) | Greene County Bancorp Inc | HSBC | (656) |
| (130) | Graham Holdings Co 'B' | Merrill Lynch | (549) | (915) | Greene County Bancorp Inc | Bank of America | |
| (649) | Graham Holdings Co 'B' | Barclays Bank | 5.215 | (6.593) | Greenhill & Co Inc | Merrill Lynch | (12.201) |
| (1.663) | Graham Holdings Co 'B' | Goldman Sachs | (114) | (3.024) | Greenhill & Co Inc | Barclays Bank | (2.812) |
| (34) | Graham Holdings Co 'B' | HSBC | (238) | (8.530) | Greenhill & Co Inc | Goldman Sachs | 1.879 |
| (3.845) | Grand Canyon Education Inc | Barclays Bank | (1.519) | (8.941) | Greenhill & Co Inc | HSBC | (211) |
| (9.365) | Grand Canyon Education Inc | Goldman Sachs | (3.076) | (14.892) | Greenlight Capital Re Ltd 'A' | Morgan Stanley | (13.850) |
| (1.175) | Grand Canyon Education Inc | HSBC | (6.014) | 37.267 | Greenlight Capital Re Ltd 'A' | Barclays Bank | 16.025 |
| 1.411 | Granite Construction Inc | Morgan Stanley | (397) | 28.242 | Greif Inc 'A' | Goldman Sachs | 6.213 |
| 7.851 | Granite Construction Inc | Bank of America | | 2.236 | Greif Inc 'A' | Bank of America | |
| 21.529 | Granite Construction Inc | Merrill Lynch | 2.342 | 7.716 | Greif Inc 'A' | Merrill Lynch | (3.659) |
| 4.167 | Granite Construction Inc | Barclays Bank | 5.025 | 11.183 | Greif Inc 'A' | Barclays Bank | (10.571) |
| 3.391 | Granite Construction Inc | Goldman Sachs | 35.738 | 12.254 | Greif Inc 'A' | Goldman Sachs | (12.189) |
| (7.551) | Granite Point Mortgage Trust Inc (REIT) | HSBC | 10.388 | 1.893 | Greif Inc 'A' | HSBC | 9.873 |
| (10.115) | Granite Point Mortgage Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 2.170 | (6.254) | Greif Inc 'B' | Morgan Stanley | (2.593) |
| (30.498) | Granite Point Mortgage Trust Inc (REIT) | Bank of America | (5.953) | (8.143) | Greif Inc 'B' | Barclays Bank | (1.188) |
| (8.314) | Granite Point Mortgage Trust Inc (REIT) | Merrill Lynch | | (7.923) | Grid Dynamics Holdings Inc | Goldman Sachs | (5.212) |
| (7.172) | Granite Point Mortgage Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | (5.583) | (5.141) | Grid Dynamics Holdings Inc | Barclays Bank | (9.191) |
| (20.157) | Graphic Packaging Holding Co | HSBC | (7.772) | 13.414 | Griffon Corp | HSBC | (3.599) |
| (76.407) | Graphic Packaging Holding Co | Goldman Sachs | (28.045) | 2.437 | Griffon Corp | Barclays Bank | 9.658 |
| (47.053) | Graphic Packaging Holding Co | HSBC | (7.772) | 22.347 | Gritstone bio Inc | Goldman Sachs | 1.852 |
| | | Morgan Stanley | (4.447) | 12.205 | Gritstone bio Inc | Barclays Bank | 4.916 |
| | | Barclays Bank | (33.864) | 4.398 | Gritstone bio Inc | Goldman Sachs | 1.221 |
| | | Goldman Sachs | (109.262) | (2.430) | Grocery Outlet Holding Corp | HSBC | 44 |
| | | HSBC | (53.640) | 4.351 | Grocery Outlet Holding Corp | Bank of America | |
| | | | | (1.990) | Grocery Outlet Holding Corp | Merrill Lynch | (5.346) |
| | | | | | Grocery Outlet Holding Corp | Barclays Bank | (348) |
| | | | | | Grocery Outlet Holding Corp | Goldman Sachs | (6.354) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (4.295) | Grocery Outlet Holding Corp | HSBC | (25.255) | 6.199 | Hackett Group Inc | Barclays Bank | 4.029 |
| 60 | Grocery Outlet Holding Corp | HSBC | 353 | 24.584 | Hackett Group Inc | Goldman Sachs | (27.780) |
| (1.654) | Grocery Outlet Holding Corp | Morgan Stanley | 117 | 35.135 | Hackett Group Inc | HSBC | (132.459) |
| 2.014 | Grocery Outlet Holding Corp | Morgan Stanley | (161) | 18.635 | Hackett Group Inc | Morgan Stanley | 12.113 |
| (676) | Group 1 Automotive Inc | Bank of America Merrill Lynch | 642 | 1.720 | Haemonetics Corp | Goldman Sachs | 9.856 |
| (1.344) | Group 1 Automotive Inc | Goldman Sachs | 9 | (8.314) | Haemonetics Corp | Goldman Sachs | (47.639) |
| (2.797) | Group 1 Automotive Inc | HSBC | (8.243) | (2.395) | Haemonetics Corp | HSBC | (33.674) |
| (1.187) | Group 1 Automotive Inc | Morgan Stanley | (8.576) | (24.621) | Hagerty Inc 'A' | HSBC | (85.927) |
| (575) | Groupon Inc | Bank of America Merrill Lynch | (615) | 10.280 | Hain Celestial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.682) |
| (8.424) | Groupon Inc | Barclays Bank | (25.777) | (5.267) | Hain Celestial Group Inc | Barclays Bank | (5.530) |
| (6.677) | Groupon Inc | Goldman Sachs | (7.144) | 13.544 | Hain Celestial Group Inc | Barclays Bank | 14.221 |
| (44.670) | GrowGeneration Corp | Bank of America Merrill Lynch | (447) | 1.519 | Hain Celestial Group Inc | Goldman Sachs | (987) |
| (35.373) | GrowGeneration Corp | Barclays Bank | (11.673) | (13.788) | Hain Celestial Group Inc | HSBC | 11.858 |
| (18.147) | GrowGeneration Corp | HSBC | (1.633) | 1.139 | Hain Celestial Group Inc | HSBC | 238 |
| (34.014) | GSI Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (22.789) | (12.489) | Hall of Fame Resort & Entertainment Co | Goldman Sachs | 116 |
| (21.599) | GSI Technology Inc | Barclays Bank | (2.808) | (29.482) | Hall of Fame Resort & Entertainment Co | HSBC | 2.132 |
| (36.279) | GSI Technology Inc | Goldman Sachs | (24.307) | 22.036 | Halliburton Co | Barclays Bank | 70.295 |
| (5.803) | GSI Technology Inc | Morgan Stanley | (754) | (17.420) | Halliburton Co | Barclays Bank | (55.476) |
| 27.917 | GTX Inc' | Bank of America Merrill Lynch | 28.615 | 42.305 | Halliburton Co | Goldman Sachs | 167.105 |
| 7.571 | GTX Inc' | Goldman Sachs | 7.753 | (16.538) | Halliburton Co | Goldman Sachs | (65.325) |
| 59 | GTX Inc' | Morgan Stanley | 60 | 41.449 | Halliburton Co | HSBC | 338.224 |
| 880 | Guaranty Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (114) | (3.187) | Halliburton Co | HSBC | (18.132) |
| 9.786 | Guaranty Bancshares Inc | Barclays Bank | 4.599 | 27.467 | Halliburton Co | Morgan Stanley | 87.620 |
| 4.160 | Guaranty Bancshares Inc | Goldman Sachs | 4.493 | 2.420 | Hallmark Financial Services Inc | Goldman Sachs | (12) |
| 6.173 | Guaranty Bancshares Inc | Morgan Stanley | 2.901 | 25.666 | Hallmark Financial Services Inc | Morgan Stanley | 1.925 |
| 2.516 | Guardant Health Inc | Barclays Bank | 7.825 | (664) | Halozyyme Therapeutics Inc | Barclays Bank | (2.032) |
| 5.100 | Guardant Health Inc | Goldman Sachs | 32.379 | 2.155 | Halozyyme Therapeutics Inc | Barclays Bank | 6.594 |
| (3.799) | Guardant Health Inc | Morgan Stanley | (11.815) | (7.832) | Halozyyme Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (44.642) |
| 1.513 | Guardant Health Inc | Morgan Stanley | 4.705 | (19.287) | Halozyyme Therapeutics Inc | HSBC | (193.642) |
| (18.385) | Guess? Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6.991 | 9.805 | Halozyyme Therapeutics Inc | HSBC | 98.442 |
| (39.008) | Guess? Inc | Morgan Stanley | (61.761) | 2.280 | Hamilton Beach Brands Holding Co 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.915 |
| 3.027 | Guidewire Software Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.603 | 5.551 | Hamilton Beach Brands Holding Co 'A' | Barclays Bank | 3.220 |
| 17.366 | Guidewire Software Inc | Barclays Bank | 45.846 | 2.733 | Hamilton Beach Brands Holding Co 'A' | Goldman Sachs | 2.296 |
| 15.870 | Guidewire Software Inc | Goldman Sachs | 13.648 | 3.408 | Hamilton Beach Brands Holding Co 'A' | HSBC | 1.329 |
| 3.837 | Guidewire Software Inc | HSBC | 23.214 | 8.420 | Hamilton Beach Brands Holding Co 'A' | Morgan Stanley | 4.884 |
| 17.261 | Guidewire Software Inc | Morgan Stanley | 45.569 | 1.147 | Hamilton Lane Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 4.968 |
| 130 | Guild Holdings Co 'A' | Barclays Bank | 55 | 3.190 | Hamilton Lane Inc 'A' | Goldman Sachs | 14.753 |
| (32.922) | Gulf Island Fabrication Inc | Goldman Sachs | 5.597 | 15.779 | Hamilton Lane Inc 'A' | HSBC | 63.275 |
| (16.100) | Gulf Island Fabrication Inc | Morgan Stanley | — | 3.113 | Hamilton Lane Inc 'A' | Morgan Stanley | 11.646 |
| 1.145 | Gulfport Energy Corp | Goldman Sachs | 11.204 | 16.199 | Hancock Whitney Corp | Bank of America Merrill Lynch | 47.734 |
| 3.243 | GXO Logistics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.589 | 36.770 | Hancock Whitney Corp | Barclays Bank | 51.110 |
| (7.043) | GXO Logistics Inc | Barclays Bank | (23.383) | 30.545 | Hancock Whitney Corp | Goldman Sachs | 96.828 |
| (2.812) | GXO Logistics Inc | Goldman Sachs | (6.580) | 30.264 | Hancock Whitney Corp | HSBC | 75.660 |
| 3.256 | GXO Logistics Inc | Goldman Sachs | 7.619 | (13.503) | Hanesbrands Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12.693 |
| (1.511) | H&E Equipment Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.855) | 3.798 | Hanesbrands Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.570) |
| (6.296) | H&E Equipment Services Inc | Barclays Bank | (10.829) | (8.508) | Hanesbrands Inc | Barclays Bank | (1.021) |
| (20.254) | H&E Equipment Services Inc | Goldman Sachs | (32.226) | 26.800 | Hanesbrands Inc | Barclays Bank | 3.216 |
| (883) | H&E Equipment Services Inc | HSBC | (819) | (13.351) | Hanesbrands Inc | Goldman Sachs | 12.550 |
| 18.985 | H&R Block Inc | Barclays Bank | 37.400 | 5.518 | Hanesbrands Inc | Goldman Sachs | (5.187) |
| (8.503) | H&R Block Inc | Barclays Bank | (16.751) | (19.316) | Hanesbrands Inc | HSBC | 12.567 |
| 10.935 | Hackett Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (12.357) | 11.183 | Hanesbrands Inc | HSBC | (9.282) |
| | | | | (11.970) | Hanesbrands Inc | Morgan Stanley | (1.436) |
| | | | | 9.426 | Hanger Inc | Barclays Bank | 5.373 |
| | | | | 11.656 | Hanger Inc | Goldman Sachs | 6.061 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|---------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 4.910 | Hanger Inc | HSBC | (495) | 22.886 | Hartford Financial Services Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 62.106 |
| (4.929) | Hanmi Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (6.891) | 20.205 | Hartford Financial Services Group Inc | Barclays Bank | 66.475 |
| (16.908) | Hanmi Financial Corp | Barclays Bank | (12.048) | 6.063 | Hartford Financial Services Group Inc | Goldman Sachs | 16.128 |
| (396) | Hanmi Financial Corp | Goldman Sachs | (297) | 44.769 | Hartford Financial Services Group Inc | HSBC | 57.176 |
| (8.462) | Hanmi Financial Corp | HSBC | (5.712) | 25.640 | Hartford Financial Services Group Inc | Morgan Stanley | 84.650 |
| (5.770) | Hanmi Financial Corp | Morgan Stanley | (2.038) | (7.730) | Harvard Bioscience Inc | Bank of America Merrill Lynch | (464) |
| 1.444 | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 2.845 | (11.835) | Harvard Bioscience Inc | Barclays Bank | 1.065 |
| (2.697) | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (5.313) | (22.751) | Harvard Bioscience Inc | Goldman Sachs | (1.398) |
| (5.762) | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT) | Barclays Bank | (11.230) | (137) | Hasbro Inc | Bank of America Merrill Lynch | 555 |
| 3.865 | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | 7.614 | (2.491) | Hasbro Inc | Barclays Bank | (5.455) |
| (8.412) | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | (16.572) | (15.849) | Hasbro Inc | Goldman Sachs | 59.389 |
| 4.916 | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT) | HSBC | 4.129 | (24.430) | Hasbro Inc | HSBC | 44.124 |
| (6.007) | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT) | HSBC | (5.673) | (2.775) | Hasbro Inc | Morgan Stanley | (6.077) |
| 10.310 | Hanover Insurance Group Inc | Barclays Bank | 20.723 | 1.523 | Haverty Furniture Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | (426) |
| (1.772) | Hanover Insurance Group Inc | Barclays Bank | (3.562) | 7.914 | Haverty Furniture Cos Inc | Barclays Bank | 13.533 |
| 23.566 | Hanover Insurance Group Inc | Goldman Sachs | 68.577 | 8.173 | Haverty Furniture Cos Inc | Goldman Sachs | (2.288) |
| (2.051) | Hanover Insurance Group Inc | Goldman Sachs | (6.279) | 2.776 | Haverty Furniture Cos Inc | HSBC | 56 |
| 6.708 | Hanover Insurance Group Inc | HSBC | (3.220) | 13.643 | Haverty Furniture Cos Inc | Morgan Stanley | 23.330 |
| (957) | Hanover Insurance Group Inc | HSBC | (1.517) | (37.045) | Hawaiian Electric Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (17.781) |
| 11.766 | Hanover Insurance Group Inc | Morgan Stanley | 23.650 | (6.547) | Hawaiian Electric Industries Inc | Barclays Bank | (5.696) |
| (215) | Hanover Insurance Group Inc | Morgan Stanley | (432) | (19.159) | Hawaiian Electric Industries Inc | Goldman Sachs | (9.196) |
| (2.046) | HarborOne Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (104) | (8.733) | Hawaiian Electric Industries Inc | HSBC | (7.074) |
| (6.337) | HarborOne Bancorp Inc | Barclays Bank | (1.774) | (26.311) | Hawaiian Electric Industries Inc | Morgan Stanley | (22.891) |
| (13.325) | HarborOne Bancorp Inc | Goldman Sachs | (6.868) | 6.252 | Hawaiian Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 16.005 |
| (40.037) | HarborOne Bancorp Inc | HSBC | (9.741) | 18.126 | Hawaiian Holdings Inc | Barclays Bank | 21.932 |
| (56.283) | HarborOne Bancorp Inc | Morgan Stanley | (15.755) | 29.903 | Hawaiian Holdings Inc | Goldman Sachs | 76.552 |
| 1.147 | Harley-Davidson Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.537) | 19.079 | Hawaiian Holdings Inc | HSBC | 41.211 |
| 13.038 | Harley-Davidson Inc | Barclays Bank | 35.198 | 3.747 | Hawaiian Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.534 |
| 12.234 | Harley-Davidson Inc | Goldman Sachs | (16.394) | 22.262 | Hawkins Inc | Barclays Bank | 30.054 |
| 3.949 | Harley-Davidson Inc | HSBC | (3.750) | (1.567) | Hawthorn Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.442) |
| 3.520 | Harley-Davidson Inc | Morgan Stanley | 10.349 | (509) | Hawthorn Bancshares Inc | Barclays Bank | (239) |
| 45.708 | Harmonic Inc | Barclays Bank | 20.569 | (378) | Hawthorn Bancshares Inc | Goldman Sachs | (348) |
| 387 | Harmonic Inc | Goldman Sachs | 298 | (3.979) | Hawthorn Bancshares Inc | Morgan Stanley | (1.870) |
| 3.769 | Harmony Biosciences Holdings Inc | Barclays Bank | 10.289 | (18.516) | Haynes International Inc | Goldman Sachs | (44.809) |
| 3.084 | Harmony Biosciences Holdings Inc | Goldman Sachs | 13.724 | (12.186) | Haynes International Inc | HSBC | (15.476) |
| 14.426 | Harpoon Therapeutics Inc | Barclays Bank | (1.010) | (9.819) | Hayward Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (8.542) |
| 10.227 | Harpoon Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (2.966) | (13.492) | Hayward Holdings Inc | Barclays Bank | (9.040) |
| 6.276 | Harpoon Therapeutics Inc | HSBC | 816 | (22.140) | Hayward Holdings Inc | Goldman Sachs | (19.261) |
| 2.213 | Harpoon Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (155) | (32.440) | Hayward Holdings Inc | HSBC | (41.832) |
| 2.467 | Harrow Health Inc | Barclays Bank | 321 | (3.383) | Hayward Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.267) |
| (16.832) | Harsco Corp | Barclays Bank | (5.891) | 3.171 | HB Fuller Co | Bank of America Merrill Lynch | 14.129 |
| (11.026) | Harsco Corp | Goldman Sachs | (3.528) | 17.524 | HB Fuller Co | Barclays Bank | 22.255 |
| (18.616) | Harsco Corp | HSBC | (6.702) | 1.894 | HB Fuller Co | HSBC | 8.450 |
| (308) | Harsco Corp | Morgan Stanley | (108) | 694 | HB Fuller Co | Morgan Stanley | 881 |
| | | | | 36.794 | HBT Financial Inc | Barclays Bank | 30.907 |
| | | | | 25.792 | HBT Financial Inc | Goldman Sachs | 21.149 |
| | | | | 13.473 | HBT Financial Inc | HSBC | 4.581 |
| | | | | 36.220 | HBT Financial Inc | Morgan Stanley | 30.425 |
| | | | | (398) | HCA Healthcare Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.245) |
| | | | | (8.004) | HCA Healthcare Inc | Barclays Bank | (68.034) |
| | | | | (2.899) | HCA Healthcare Inc | Goldman Sachs | (5.508) |
| | | | | (2.129) | HCA Healthcare Inc | HSBC | 22.482 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (480) | HCA Healthcare Inc | Morgan Stanley | (4.388) | 10.998 | HealthStream Inc | Barclays Bank | 11.658 |
| 2.851 | HCI Group Inc | Barclays Bank | 4.191 | 4.726 | HealthStream Inc | Goldman Sachs | 5.766 |
| 3.523 | HCI Group Inc | Goldman Sachs | 11.125 | 14.931 | HealthStream Inc | HSBC | 16.497 |
| 2.384 | HCI Group Inc | HSBC | (6.556) | 5.837 | HealthStream Inc | Morgan Stanley | 6.187 |
| 1.346 | HCI Group Inc | Morgan Stanley | 1.979 | (52.734) | Heartland Express Inc | Barclays Bank | (14.766) |
| 25.006 | Health Catalyst Inc | Bank of America | | (14.098) | Heartland Express Inc | Goldman Sachs | (2.538) |
| | | Merrill Lynch | (2.000) | 7.871 | Heartland Financial USA Inc | Bank of America | |
| 2.219 | Health Catalyst Inc | Barclays Bank | 654 | | | Merrill Lynch | 14.276 |
| 27.446 | Health Catalyst Inc | Goldman Sachs | (2.196) | 36.411 | Heartland Financial USA Inc | Barclays Bank | 38.834 |
| 9.685 | Health Catalyst Inc | HSBC | 15.593 | 37.038 | Heartland Financial USA Inc | Goldman Sachs | 71.854 |
| 2.617 | Health Catalyst Inc | Morgan Stanley | 1.875 | 13.310 | Heartland Financial USA Inc | HSBC | (3.065) |
| 21.655 | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America | | 22.750 | Hecla Mining Co | Barclays Bank | 2.048 |
| | | Merrill Lynch | 3.032 | (41.674) | Hecla Mining Co | Barclays Bank | (3.751) |
| (7.343) | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America | | 40.177 | Hecla Mining Co | Goldman Sachs | 11.651 |
| | | Merrill Lynch | (1.028) | 22.885 | Hecla Mining Co | HSBC | 6.179 |
| (2.119) | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | | | (9.250) | Hecla Mining Co | Morgan Stanley | 292 |
| | | Barclays Bank | — | 13.324 | HEICO Corp | Barclays Bank | 93.135 |
| 23.943 | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | — | 5.175 | HEICO Corp | Goldman Sachs | 32.913 |
| 4.793 | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | | | 12.595 | HEICO Corp | Morgan Stanley | 88.039 |
| | | Goldman Sachs | 1.755 | 1.180 | HEICO Corp 'A' | Bank of America | |
| (6.337) | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | HSBC | 4 | | | Merrill Lynch | 7.469 |
| 11.821 | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | | | 19.873 | HEICO Corp 'A' | Barclays Bank | 133.348 |
| | | Morgan Stanley | — | 16.568 | HEICO Corp 'A' | Goldman Sachs | 104.875 |
| (1.289) | Healthcare Services Group Inc | Bank of America | | 8.633 | HEICO Corp 'A' | HSBC | 63.887 |
| | | Merrill Lynch | 464 | 4.139 | HEICO Corp 'A' | Morgan Stanley | 27.773 |
| (18.148) | Healthcare Services Group Inc | | | 4.198 | Heidrick & Struggles International Inc | | |
| | | Barclays Bank | (1.815) | 6.728 | Heidrick & Struggles International Inc | Barclays Bank | 8.144 |
| (17.259) | Healthcare Services Group Inc | Goldman Sachs | 6.213 | 16.430 | Heidrick & Struggles International Inc | Goldman Sachs | 20.319 |
| (4.184) | Healthcare Services Group Inc | HSBC | (628) | (1.727) | Helen of Troy Ltd | Morgan Stanley | 31.874 |
| (9.633) | Healthcare Services Group Inc | Morgan Stanley | (963) | 2.729 | Helen of Troy Ltd | Bank of America | |
| (89.972) | Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT) | Barclays Bank | (24.292) | (2.005) | Helen of Troy Ltd | Merrill Lynch | (26.021) |
| (47.320) | Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (8.162) | (5.257) | Helen of Troy Ltd | Barclays Bank | (2.366) |
| (9.678) | Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT) | HSBC | (5.423) | 473 | Helen of Troy Ltd | Goldman Sachs | 99.778 |
| (6.207) | Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT) | | | (5.222) | Helen of Troy Ltd | Goldman Sachs | (8.978) |
| | | Morgan Stanley | (1.676) | 3.699 | Helen of Troy Ltd | HSBC | 128.879 |
| (541) | HealthEquity Inc | Bank of America | | (639) | Helen of Troy Ltd | HSBC | (82.963) |
| | | Merrill Lynch | (666) | 22.661 | Heliogen Inc | Morgan Stanley | (754) |
| 2.054 | HealthEquity Inc | Bank of America | | 8.491 | Heliogen Inc | Barclays Bank | 1.813 |
| | | Merrill Lynch | 10.435 | (4.050) | Helios Technologies Inc | HSBC | 6.114 |
| (4.454) | HealthEquity Inc | Barclays Bank | (12.649) | (12.948) | Helios Technologies Inc | Bank of America | |
| 1.909 | HealthEquity Inc | Barclays Bank | 5.422 | (1.875) | Helios Technologies Inc | Merrill Lynch | 949 |
| (2.127) | HealthEquity Inc | Goldman Sachs | (11.975) | (405) | Helios Technologies Inc | Barclays Bank | (21.753) |
| 11.881 | HealthEquity Inc | Goldman Sachs | 66.890 | (4.396) | Helios Technologies Inc | Goldman Sachs | 113 |
| (656) | HealthEquity Inc | HSBC | (2.407) | 12.585 | Helix Energy Solutions Group Inc | HSBC | 109 |
| 4.264 | HealthEquity Inc | HSBC | 29.215 | 14.470 | Helix Energy Solutions Group Inc | Morgan Stanley | (7.385) |
| (7.042) | HealthEquity Inc | Morgan Stanley | (19.999) | 55.472 | Helix Energy Solutions Group Inc | Bank of America | |
| 2.216 | HealthEquity Inc | Morgan Stanley | 6.293 | 15.300 | Helix Energy Solutions Group Inc | Merrill Lynch | 5.184 |
| 35.913 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | Bank of America | | 26.679 | Helix Energy Solutions Group Inc | Barclays Bank | 3.762 |
| | | Merrill Lynch | (15.890) | (2.319) | Helmerich & Payne Inc | Goldman Sachs | 28.625 |
| 34.402 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | 5.611 | (28.967) | Helmerich & Payne Inc | HSBC | 9.842 |
| (16.260) | Healthpeak Properties Inc (REIT) | | | (27.097) | Helmerich & Payne Inc | Morgan Stanley | 6.937 |
| 24.440 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 5.352 | (19.173) | Helmerich & Payne Inc | Bank of America | |
| (32.422) | Healthpeak Properties Inc (REIT) | | | (6.494) | Helmerich & Payne Inc | Merrill Lynch | (10.018) |
| 20.439 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | HSBC | (2.969) | 12.435 | Hennessy Advisors Inc | Barclays Bank | (107.757) |
| 35.368 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | | | 32 | Hennessy Advisors Inc [†] | Goldman Sachs | (117.059) |
| 2.779 | HealthStream Inc | Morgan Stanley | 7.427 | 4.707 | Henry Schein Inc | HSBC | (133.605) |
| | | Bank of America | | | | Morgan Stanley | (24.158) |
| | | Merrill Lynch | 3.390 | | | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 684 |
| | | | | | | | — |
| | | | | | | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 4.568 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------|-----------------|---|---|----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 12.238 | Henry Schein Inc | Barclays Bank | 2.203 | 9.122 | Hess Corp | Barclays Bank | 94.504 |
| 5.345 | Henry Schein Inc | Goldman Sachs | 7.335 | 337 | Hess Corp | Goldman Sachs | 3.491 |
| 5.900 | Henry Schein Inc | HSBC | (707) | 8.678 | Hess Corp | HSBC | 160.265 |
| 4.310 | Henry Schein Inc | Morgan Stanley | 775 | 4.365 | Hess Corp | Morgan Stanley | 45.221 |
| 2.932 | Herbalife Nutrition Ltd | Bank of America | | 10.599 | Hewlett Packard | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 792 | | Enterprise Co | Merrill Lynch | (3.922) |
| 34.696 | Herbalife Nutrition Ltd | Barclays Bank | 29.839 | 353.193 | Hewlett Packard | Barclays Bank | 384.980 |
| 18.154 | Herbalife Nutrition Ltd | Goldman Sachs | 4.901 | | Enterprise Co | Barclays Bank | |
| 5.721 | Herbalife Nutrition Ltd | HSBC | (6.694) | 20.996 | Hewlett Packard | Goldman Sachs | (7.769) |
| 15.857 | Herbalife Nutrition Ltd | Morgan Stanley | 13.637 | 41.072 | Enterprise Co | Goldman Sachs | (7.769) |
| (2.361) | Herc Holdings Inc | Bank of America | | | Hewlett Packard | HSBC | (9.857) |
| | | Merrill Lynch | (25.143) | 1.356 | Enterprise Co | HSBC | (9.857) |
| 582 | Herc Holdings Inc | Bank of America | | | Hexcel Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 5.925 | | Hexcel Corp | Merrill Lynch | 6.509 |
| (2.362) | Herc Holdings Inc | Barclays Bank | (20.809) | 6.010 | Hexcel Corp | Barclays Bank | 23.860 |
| 2.273 | Herc Holdings Inc | Barclays Bank | 20.025 | 7.820 | Hexcel Corp | Goldman Sachs | 37.241 |
| (5.036) | Herc Holdings Inc | Goldman Sachs | (52.348) | 2.100 | Hexcel Corp | HSBC | 10.211 |
| (2.091) | Herc Holdings Inc | HSBC | (7.832) | 705 | Hexcel Corp | Morgan Stanley | 2.799 |
| (582) | Herc Holdings Inc | Morgan Stanley | (5.127) | (38.020) | HF Foods Group Inc | Barclays Bank | (760) |
| 462 | Herc Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.070 | (12.848) | HF Foods Group Inc | Morgan Stanley | (257) |
| (25.791) | Heritage Commerce Corp | Bank of America | | 1.031 | HF Sinclair Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (787) | | HF Sinclair Corp | Merrill Lynch | 3.423 |
| (34.379) | Heritage Commerce Corp | Barclays Bank | (5.501) | 1.699 | HF Sinclair Corp | Barclays Bank | 6.099 |
| (49.157) | Heritage Commerce Corp | Goldman Sachs | (13.567) | 3.347 | HF Sinclair Corp | Goldman Sachs | 11.452 |
| (23.427) | Heritage Commerce Corp | HSBC | (2.559) | (13.455) | HF Sinclair Corp | HSBC | (110.196) |
| (8.588) | Heritage Commerce Corp | Morgan Stanley | (1.374) | 3.823 | HF Sinclair Corp | HSBC | 21.485 |
| (5.428) | Heritage Financial Corp | Bank of America | | (2.048) | HF Sinclair Corp | Morgan Stanley | (7.352) |
| | | Merrill Lynch | (8.956) | 1.352 | HF Sinclair Corp | Morgan Stanley | 4.854 |
| (923) | Heritage Financial Corp | Barclays Bank | (729) | (1.226) | Hibbett Inc | Bank of America | |
| (11.900) | Heritage Financial Corp | Goldman Sachs | (19.635) | | Hibbett Inc | Merrill Lynch | (7.307) |
| (5.218) | Heritage Financial Corp | HSBC | (4.122) | (3.669) | Hibbett Inc | Barclays Bank | (26.013) |
| (881) | Heritage Financial Corp | Morgan Stanley | (764) | (6.669) | Hibbett Inc | HSBC | (62.755) |
| 49.617 | Heritage Insurance | | | (1.083) | Hibbett Inc | Morgan Stanley | (7.678) |
| | Holdings Inc | Barclays Bank | 13.397 | 4.295 | Highwoods Properties Inc | Bank of America | |
| 58.438 | Heritage Insurance | | | | (REIT) | Merrill Lynch | 1.417 |
| | Holdings Inc | Goldman Sachs | 19.285 | 90.639 | Highwoods Properties Inc | Barclays Bank | 40.699 |
| 11.000 | Heritage Insurance | | | | (REIT) | Barclays Bank | |
| | Holdings Inc | HSBC | 2.200 | 32.840 | Highwoods Properties Inc | Goldman Sachs | 10.801 |
| 7.386 | Heritage Insurance | | | | (REIT) | Goldman Sachs | |
| | Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.994 | 34.432 | Highwoods Properties Inc | HSBC | 27.201 |
| (487) | Heritage-Crystal Clean Inc | Bank of America | | | (REIT) | HSBC | |
| | | Merrill Lynch | (399) | 8.653 | Highwoods Properties Inc | Morgan Stanley | 3.894 |
| (12.634) | Heritage-Crystal Clean Inc | Barclays Bank | (12.887) | | (REIT) | Morgan Stanley | |
| (28.076) | Heritage-Crystal Clean Inc | Goldman Sachs | (23.022) | (145.151) | Hill International Inc | Bank of America | |
| (5.462) | Heritage-Crystal Clean Inc | HSBC | (9.122) | | Hill International Inc | Merrill Lynch | (44.997) |
| (12.661) | Heritage-Crystal Clean Inc | Morgan Stanley | (12.914) | (41.500) | Hill International Inc | Morgan Stanley | (8.715) |
| 8.814 | Heron Therapeutics Inc | Bank of America | | (13.103) | Hillenbrand Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.587) | | Hillenbrand Inc | Merrill Lynch | 1.179 |
| 49.097 | Heron Therapeutics Inc | Barclays Bank | (5.892) | (18.018) | Hillenbrand Inc | Barclays Bank | (10.090) |
| 36.772 | Heron Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (6.619) | (17.092) | Hillenbrand Inc | Goldman Sachs | 1.538 |
| 28.453 | Heron Therapeutics Inc | HSBC | (5.600) | (8.745) | Hillenbrand Inc | HSBC | 12.680 |
| 13.551 | Heron Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.005 | (1.459) | Hillenbrand Inc | Morgan Stanley | (449) |
| 51.732 | Hersha Hospitality | | | (2.696) | Hilltop Holdings Inc | Bank of America | |
| | Trust (REIT) | Goldman Sachs | 31.039 | | Hilltop Holdings Inc | Merrill Lynch | (458) |
| 25.593 | Hersha Hospitality | | | (28.852) | Hilltop Holdings Inc | Barclays Bank | 1.443 |
| | Trust (REIT) | HSBC | 31.223 | (14.794) | Hilltop Holdings Inc | HSBC | (354) |
| 7.391 | Hershey Co | Barclays Bank | 5.100 | (5.544) | Hilton Grand Vacations Inc | Bank of America | |
| 20.481 | Hershey Co | Goldman Sachs | (396.922) | | Hilton Grand Vacations Inc | Merrill Lynch | (13.694) |
| 4.575 | Hershey Co | HSBC | (60.665) | (16.316) | Hilton Grand Vacations Inc | Barclays Bank | (67.916) |
| (29.008) | Hertz Global Holdings Inc | Goldman Sachs | (20.886) | 12.811 | Hilton Grand Vacations Inc | Barclays Bank | 53.076 |
| (16.270) | Hertz Global Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.115 | (15.251) | Hilton Grand Vacations Inc | Goldman Sachs | (39.881) |
| 525 | Heska Corp | Bank of America | | 32.043 | Hilton Grand Vacations Inc | Goldman Sachs | 79.146 |
| | | Merrill Lynch | 3.161 | (19.065) | Hilton Grand Vacations Inc | HSBC | (54.437) |
| 1.515 | Heska Corp | Barclays Bank | 1.485 | (7.261) | Hilton Grand Vacations Inc | Morgan Stanley | (27.354) |
| 1.425 | Heska Corp | Goldman Sachs | 8.579 | 2.568 | Hilton Worldwide | Bank of America | |
| 1.770 | Heska Corp | HSBC | 16.620 | | Holdings Inc | Merrill Lynch | 20.866 |
| 3.160 | Heska Corp | Morgan Stanley | 3.097 | (11.141) | Hilton Worldwide | Barclays Bank | (90.354) |
| 10.366 | Hess Corp | Bank of America | | | Holdings Inc | Barclays Bank | |
| | | Merrill Lynch | 111.600 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|-------------------------------|---|---|-------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 8.176 | Hilton Worldwide Holdings Inc | Barclays Bank | 66.307 | 14.761 | Honest Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.919 |
| (20.651) | Hilton Worldwide Holdings Inc | Goldman Sachs | (157.154) | 39.571 | Honest Co Inc | Barclays Bank | 16.224 |
| 1.324 | Hilton Worldwide Holdings Inc | Goldman Sachs | 11.164 | 16.186 | Honest Co Inc | Goldman Sachs | 5.708 |
| 905 | Hilton Worldwide Holdings Inc | HSBC | 6.471 | 28.311 | Honest Co Inc | HSBC | 3.062 |
| 5.080 | Hilton Worldwide Holdings Inc | Morgan Stanley | 42.448 | 6.927 | Honest Co Inc | Morgan Stanley | 3.845 |
| (200) | Hingham Institution For Savings The | Barclays Bank | (4.446) | 1.141 | Honeywell International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 37 |
| (369) | Hingham Institution For Savings The | Goldman Sachs | (8.348) | (4.826) | Honeywell International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 18.288 |
| (558) | Hingham Institution For Savings The | HSBC | (13.602) | 16.223 | Honeywell International Inc | Barclays Bank | 49.642 |
| (1.798) | HireQuest Inc | Bank of America Merrill Lynch | (755) | (5.377) | Honeywell International Inc | Barclays Bank | (16.454) |
| (2.556) | HireQuest Inc | Barclays Bank | (843) | 2.629 | Honeywell International Inc | Goldman Sachs | (3.288) |
| (2.432) | HireQuest Inc | HSBC | (657) | (3.158) | Honeywell International Inc | Goldman Sachs | 18 |
| (1.523) | HireQuest Inc | Morgan Stanley | (503) | 1.339 | Honeywell International Inc | HSBC | (2.443) |
| (1.926) | HireRight Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (867) | (2.336) | Honeywell International Inc | HSBC | (1.722) |
| (19.630) | HireRight Holdings Corp | Barclays Bank | (25.715) | 1.965 | Honeywell International Inc | Morgan Stanley | 6.013 |
| 3 | Histogen Inc [†] | Bank of America Merrill Lynch | — | (1.171) | Honeywell International Inc | Morgan Stanley | (3.583) |
| 3.366 | HNI Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4.027 | (2.891) | Hooker Furnishings Corp | Barclays Bank | (4.886) |
| 7.689 | HNI Corp | Barclays Bank | 11.226 | (1.989) | Hooker Furnishings Corp | Goldman Sachs | (438) |
| 7.432 | HNI Corp | Goldman Sachs | 6.683 | (992) | Hooker Furnishings Corp | Morgan Stanley | (1.676) |
| 2.819 | HNI Corp | HSBC | 6.086 | 8.524 | Hookipa Pharma Inc | Barclays Bank | 1.279 |
| 4.857 | HNI Corp | Morgan Stanley | 5.431 | 18.651 | Hookipa Pharma Inc | Goldman Sachs | 5.968 |
| 19.163 | Holley Inc | Barclays Bank | 10.156 | 4.119 | Hookipa Pharma Inc | HSBC | 1.606 |
| 10.334 | Holley Inc | Goldman Sachs | 1.860 | (88.611) | Hope Bancorp Inc | Barclays Bank | (26.583) |
| 7.724 | Holley Inc | HSBC | 10.104 | (126.036) | Hope Bancorp Inc | Goldman Sachs | (32.769) |
| 2.971 | Holley Inc | Morgan Stanley | 1.575 | (74.502) | Hope Bancorp Inc | HSBC | (2.235) |
| 496 | Hologic Inc | Bank of America Merrill Lynch | (852) | (698) | Horace Mann Educators Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.968) |
| 2.729 | Hologic Inc | Goldman Sachs | (4.667) | (17.122) | Horace Mann Educators Corp | Barclays Bank | (24.559) |
| 16.591 | Hologic Inc | Morgan Stanley | (54.750) | (10.596) | Horace Mann Educators Corp | Goldman Sachs | (16.041) |
| (5.306) | Home Bancorp Inc | Goldman Sachs | (1.804) | (11.208) | Horace Mann Educators Corp | HSBC | (35.053) |
| (3.588) | Home Bancorp Inc | HSBC | 2.799 | (2.085) | Horizon Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (750) |
| (1.235) | Home Bancorp Inc | Morgan Stanley | (976) | (1.542) | Horizon Bancorp Inc | Goldman Sachs | (175) |
| (3.704) | Home BancShares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.704) | (25.468) | Horizon Bancorp Inc | Morgan Stanley | (12.225) |
| (30.392) | Home BancShares Inc | Barclays Bank | (20.667) | (22.537) | Horizon Global Corp | Bank of America Merrill Lynch | (5.860) |
| (94.257) | Home BancShares Inc | Goldman Sachs | (196.055) | (2.948) | Horizon Therapeutics Plc | Barclays Bank | (14.652) |
| (11.336) | Home BancShares Inc | Morgan Stanley | (7.708) | 2.807 | Horizon Therapeutics Plc | Barclays Bank | 13.951 |
| 1.116 | Home Depot Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.187 | (5.470) | Horizon Therapeutics Plc | Goldman Sachs | (8.369) |
| 1.202 | Home Depot Inc | Barclays Bank | 19.713 | 3.370 | Horizon Therapeutics Plc | Goldman Sachs | 5.156 |
| 6.716 | Home Depot Inc | Goldman Sachs | 43.251 | 2.356 | Horizon Therapeutics Plc | HSBC | 21.416 |
| (3.078) | Home Depot Inc | Goldman Sachs | (8.107) | (1.582) | Hormel Foods Corp | Bank of America Merrill Lynch | 8.321 |
| 133 | Home Depot Inc | HSBC | 718 | 16.295 | Hormel Foods Corp | Bank of America Merrill Lynch | (64.516) |
| (4.923) | Home Depot Inc | HSBC | (65.146) | (24.371) | Hormel Foods Corp | Barclays Bank | 8.774 |
| (1.683) | Home Depot Inc | Morgan Stanley | (27.601) | 26.383 | Hormel Foods Corp | Barclays Bank | (9.498) |
| (617) | HomeStreet Inc | Bank of America Merrill Lynch | (252) | (26.201) | Hormel Foods Corp | Goldman Sachs | 137.817 |
| (6.266) | HomeStreet Inc | Barclays Bank | (3.572) | 5.515 | Hormel Foods Corp | Goldman Sachs | (7.756) |
| (4.112) | HomeStreet Inc | HSBC | (2.101) | 11.682 | Hormel Foods Corp | HSBC | (42.769) |
| 35.785 | HomeTrust Bancshares Inc | Barclays Bank | 6.441 | 31.159 | Hormel Foods Corp | Morgan Stanley | (13.506) |
| 17.032 | HomeTrust Bancshares Inc | Goldman Sachs | 4.939 | (2.729) | Hospitality Properties Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 437 |
| 11.291 | HomeTrust Bancshares Inc | HSBC | (2.145) | (98.542) | Hospitality Properties Trust (REIT) | Barclays Bank | (29.563) |
| 2.340 | HomeTrust Bancshares Inc | Morgan Stanley | 421 | (75.890) | Hospitality Properties Trust (REIT) | Goldman Sachs | 12.142 |
| 45.161 | Homology Medicines Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.903 | (16.210) | Hospitality Properties Trust (REIT) | HSBC | (3.133) |
| 53.700 | Homology Medicines Inc | Barclays Bank | 7.250 | (10.344) | Hospitality Properties Trust (REIT) | Morgan Stanley | (3.103) |
| 24.900 | Homology Medicines Inc | Goldman Sachs | 4.358 | (23.462) | Host Hotels & Resorts Inc (REIT) | Barclays Bank | (31.674) |
| 17.238 | Homology Medicines Inc | HSBC | (948) | (30.679) | Host Hotels & Resorts Inc (REIT) | Goldman Sachs | 3.068 |
| 6.215 | Homology Medicines Inc | Morgan Stanley | 839 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (20.981) | Host Hotels & Resorts Inc (REIT) | HSBC | (20.352) | 1.406 | Humana Inc | Morgan Stanley | 22.763 |
| (19.199) | Host Hotels & Resorts Inc (REIT) | Morgan Stanley | (25.918) | (11.612) | Humanigen Inc | Bank of America | (6.561) |
| 36.345 | Hostess Brands Inc | Barclays Bank | 2.726 | (12.267) | Humanigen Inc | Barclays Bank | (2.515) |
| 75.224 | Hostess Brands Inc | HSBC | (55.687) | (3.714) | Humanigen Inc | Goldman Sachs | (2.098) |
| 1.804 | Houlihan Lokey Inc | Bank of America | | (6) | Humanigen Inc | HSBC | (3) |
| | | Merrill Lynch | (758) | 201.726 | Huntington Bancshares Inc | Barclays Bank | 56.483 |
| 7.247 | Houlihan Lokey Inc | Barclays Bank | 3.986 | 75.115 | Huntington Bancshares Inc | Goldman Sachs | 66.102 |
| (3.968) | Houlihan Lokey Inc | Goldman Sachs | 1.667 | 101.895 | Huntington Bancshares Inc | HSBC | 59.704 |
| 10.616 | Houlihan Lokey Inc | Goldman Sachs | (4.458) | 72.530 | Huntington Bancshares Inc | Morgan Stanley | 20.308 |
| (2.376) | Houlihan Lokey Inc | HSBC | 380 | 15.089 | Huntington Ingalls Industries Inc | Barclays Bank | 148.511 |
| 5.443 | Houlihan Lokey Inc | HSBC | 395 | 6.858 | Huntington Ingalls Industries Inc | Goldman Sachs | 40.853 |
| 2.503 | Houlihan Lokey Inc | Morgan Stanley | 1.377 | 14.911 | Huntsman Corp | Bank of America | |
| (1.259) | Hovnanian Enterprises Inc 'A' | Bank of America | | | Huntsman Corp | Merrill Lynch | 9.990 |
| | | Merrill Lynch | (6.748) | 25.528 | Huntsman Corp | Barclays Bank | 19.401 |
| (3.273) | Hovnanian Enterprises Inc 'A' | Barclays Bank | (19.147) | 32.289 | Huntsman Corp | Goldman Sachs | 21.634 |
| (909) | Hovnanian Enterprises Inc 'A' | Goldman Sachs | (4.872) | 4.821 | Huntsman Corp | HSBC | 12.824 |
| (1.707) | Hovnanian Enterprises Inc 'A' | HSBC | (7.221) | 17.083 | Huntsman Corp | Morgan Stanley | 12.983 |
| (32.865) | Howard Hughes Corp | Barclays Bank | 43.053 | 5.498 | Hurco Cos Inc | Bank of America | |
| (3.206) | Howard Hughes Corp | Goldman Sachs | 6.476 | 5.777 | Hurco Cos Inc | Merrill Lynch | (7.202) |
| (21.037) | Howard Hughes Corp | HSBC | 42.284 | 6.095 | Hurco Cos Inc | Barclays Bank | (3.904) |
| (4.502) | Howard Hughes Corp | Morgan Stanley | 5.898 | 4.059 | Hurco Cos Inc | Goldman Sachs | (7.984) |
| (79.960) | Howmet Aerospace Inc | Barclays Bank | (95.152) | 8.633 | Hurco Cos Inc | HSBC | (6.535) |
| (89.610) | Howmet Aerospace Inc | Goldman Sachs | (128.142) | 8.633 | Hurco Cos Inc | Morgan Stanley | (6.043) |
| (26.149) | Howmet Aerospace Inc | HSBC | (58.051) | (7.168) | Huron Consulting Group Inc | Barclays Bank | (18.995) |
| 19.913 | HP Inc | Barclays Bank | 70.691 | (1.855) | Huron Consulting Group Inc | Goldman Sachs | (3.896) |
| (4.688) | HP Inc | Barclays Bank | (16.642) | (11.162) | Huron Consulting Group Inc | HSBC | (62.061) |
| 22.813 | HP Inc | Goldman Sachs | 25.094 | 1.422 | Hyatt Hotels Corp 'A' | Bank of America | |
| (7.837) | HP Inc | Goldman Sachs | (12.031) | 15.654 | Hyatt Hotels Corp 'A' | Merrill Lynch | 9.143 |
| 22.610 | HP Inc | HSBC | 36.176 | 11.526 | Hyatt Hotels Corp 'A' | Barclays Bank | 78.583 |
| 10.840 | Hub Group Inc 'A' | Barclays Bank | 16.585 | 20.429 | Hyatt Hotels Corp 'A' | Goldman Sachs | 74.112 |
| 16.235 | Hub Group Inc 'A' | HSBC | (37.990) | (14.949) | Hydrofarm Holdings Group Inc | HSBC | 157.304 |
| 10.225 | Hub Group Inc 'A' | Morgan Stanley | 15.644 | (6.061) | Hydrofarm Holdings Group Inc | Bank of America | 683 |
| 1.199 | Hubbell Inc | Bank of America | | (9.327) | Hydrofarm Holdings Group Inc | Merrill Lynch | |
| | | Merrill Lynch | (5.682) | 8.266 | Hyllion Holdings Corp | Barclays Bank | (3.091) |
| (2.284) | Hubbell Inc | Bank of America | | 22.912 | Hyllion Holdings Corp | Goldman Sachs | 3.917 |
| 1.950 | Hubbell Inc | Merrill Lynch | 10.135 | 26.041 | Hyllion Holdings Corp | Bank of America | |
| (1.955) | Hubbell Inc | Barclays Bank | 1.360 | 35.257 | Hyllion Holdings Corp | Merrill Lynch | 2.381 |
| 1.457 | Hubbell Inc | Barclays Bank | (1.426) | (23.510) | HyreCar Inc | Barclays Bank | 9.688 |
| (5.229) | Hubbell Inc | Goldman Sachs | (6.574) | (13.291) | HyreCar Inc | Goldman Sachs | 12.038 |
| (1.012) | Hubbell Inc | Goldman Sachs | 32.492 | 2.984 | Hyster-Yale Materials Handling Inc | HSBC | 19.118 |
| 1.279 | Hubbell Inc | HSBC | 8.242 | 3.433 | Hyster-Yale Materials Handling Inc | Bank of America | |
| 2.099 | HubSpot Inc | Morgan Stanley | (294) | 15.786 | Hyster-Yale Materials Handling Inc | Merrill Lynch | (1.176) |
| 392 | HubSpot Inc | Barclays Bank | 6.150 | 3.337 | Hyster-Yale Materials Handling Inc | Barclays Bank | 133 |
| 499 | HubSpot Inc | Goldman Sachs | 1.611 | 1.204 | Hyster-Yale Materials Handling Inc | Bank of America | |
| (6.244) | Hudson Pacific Properties Inc (REIT) | HSBC | 3.932 | (1.070) | I3 Verticals Inc 'A' | Merrill Lynch | 11.250 |
| (50.826) | Hudson Pacific Properties Inc (REIT) | Bank of America | | (15.426) | I3 Verticals Inc 'A' | Bank of America | |
| (78.940) | Hudson Pacific Properties Inc (REIT) | Merrill Lynch | 3.247 | (7.744) | I3 Verticals Inc 'A' | Merrill Lynch | 192 |
| (12.553) | Hudson Pacific Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | 15.756 | (4.000) | I3 Verticals Inc 'A' | Barclays Bank | 159 |
| (48.600) | Hudson Pacific Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 41.049 | (1.808) | I3 Verticals Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.781) |
| (8.199) | Hudson Technologies Inc | HSBC | 16.570 | (4.578) | IAA Inc | HSBC | 5.600 |
| (3.642) | Hudson Technologies Inc | Morgan Stanley | 15.066 | (2.060) | IAA Inc | Morgan Stanley | 127 |
| (3.757) | Hudson Technologies Inc | Bank of America | | (28.762) | IAA Inc | Bank of America | |
| 14.323 | Humacyte Inc | Merrill Lynch | (5.493) | (14.095) | IAA Inc | Merrill Lynch | (7.233) |
| 2.396 | Humacyte Inc | Barclays Bank | 255 | (37.056) | IAA Inc | Barclays Bank | (1.051) |
| 5.717 | Humacyte Inc | Goldman Sachs | (2.517) | | | Goldman Sachs | (39.666) |
| 2.440 | Humana Inc | Barclays Bank | 11.244 | | | HSBC | (69.649) |
| 2.030 | Humana Inc | Goldman Sachs | 42.437 | | | Morgan Stanley | (18.899) |
| 1.077 | Humana Inc | HSBC | 31.558 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------|-----------------|---|---|---------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (881) | IAC Holdings Inc | Bank of America | | (2.288) | IGM Biosciences Inc | Barclays Bank | 4.759 |
| | | Merrill Lynch | (4.105) | (3.161) | IGM Biosciences Inc | Goldman Sachs | (4.931) |
| (19.598) | IAC Holdings Inc | Barclays Bank | (38.412) | (1.340) | IGM Biosciences Inc | HSBC | (1.755) |
| (8.165) | IAC Holdings Inc | HSBC | (98.470) | (870) | IGM Biosciences Inc | Morgan Stanley | 1.810 |
| 1.280 | IBEX Holdings Ltd | Bank of America | | (2.875) | iHeartMedia Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 3.238 | | | Merrill Lynch | 2.640 |
| 3.706 | IBEX Holdings Ltd | Barclays Bank | 6.189 | (11.248) | iHeartMedia Inc 'A' | Barclays Bank | 3.037 |
| 6.222 | IBEX Holdings Ltd | Goldman Sachs | 15.742 | (1.307) | II-VI Inc | Bank of America | |
| 488 | IBEX Holdings Ltd | Morgan Stanley | 815 | | | Merrill Lynch | 78 |
| (82.022) | iBio Inc | Barclays Bank | 1.394 | (20.056) | II-VI Inc | Barclays Bank | (7.220) |
| (14.103) | iBio Inc | Goldman Sachs | (75) | 2.711 | II-VI Inc | Barclays Bank | 976 |
| (6.042) | iCAD Inc | Goldman Sachs | (2.236) | (7.718) | II-VI Inc | Goldman Sachs | 463 |
| (9.977) | iCAD Inc | HSBC | (3.991) | 221 | II-VI Inc | Goldman Sachs | (13) |
| (1.315) | iCAD Inc | Morgan Stanley | (513) | (13.173) | II-VI Inc | HSBC | (25.819) |
| (2.255) | ICF International Inc | Bank of America | | 1.612 | Ikena Oncology Inc | Barclays Bank | (500) |
| | | Merrill Lynch | (11.501) | 2.368 | Ikena Oncology Inc | Morgan Stanley | (734) |
| (9.406) | ICF International Inc | Barclays Bank | (61.891) | 4.742 | Illinois Tool Works Inc | Bank of America | |
| (4.460) | ICF International Inc | Goldman Sachs | (22.746) | | | Merrill Lynch | (14.953) |
| (10.304) | ICF International Inc | HSBC | (28.645) | 3.184 | Illinois Tool Works Inc | Barclays Bank | 4.426 |
| (780) | ICF International Inc | Morgan Stanley | (5.132) | 21.519 | Illinois Tool Works Inc | Goldman Sachs | (64.153) |
| 2.312 | Ichor Holdings Ltd | Barclays Bank | 4.601 | 26.663 | Illinois Tool Works Inc | HSBC | (141.945) |
| 10.537 | Ichor Holdings Ltd | Goldman Sachs | 20.020 | (644) | Illumina Inc | Bank of America | |
| 1.785 | Ichor Holdings Ltd | Morgan Stanley | 3.552 | | | Merrill Lynch | (6.240) |
| (5.946) | ICON Plc | Barclays Bank | (41.622) | 583 | Illumina Inc | Bank of America | |
| (1.761) | ICON Plc | Goldman Sachs | (24.760) | | | Merrill Lynch | 5.649 |
| (653) | ICON Plc | HSBC | (11.095) | (1.569) | Illumina Inc | Barclays Bank | 2.573 |
| (4.464) | Icosavax Inc | Barclays Bank | (4.152) | 766 | Illumina Inc | Barclays Bank | (1.256) |
| (1.265) | Icosavax Inc | HSBC | (2.138) | (550) | Illumina Inc | Goldman Sachs | (5.330) |
| (2.382) | Icosavax Inc | Morgan Stanley | (2.215) | 193 | Illumina Inc | Goldman Sachs | 1.870 |
| (166) | ICU Medical Inc | Bank of America | | (922) | Illumina Inc | Morgan Stanley | 1.512 |
| | | Merrill Lynch | 450 | (6.251) | Imago Biosciences Inc | Bank of America | |
| (1.971) | ICU Medical Inc | Barclays Bank | 5.184 | | | Merrill Lynch | (6.001) |
| (2.363) | ICU Medical Inc | HSBC | 54.656 | (1.246) | Imago Biosciences Inc | Barclays Bank | (1.296) |
| (2.855) | ICU Medical Inc | Morgan Stanley | 7.508 | (4.936) | Imago Biosciences Inc | Goldman Sachs | (4.739) |
| 5.350 | IDACORP Inc | Bank of America | | (1.031) | Imago Biosciences Inc | HSBC | (1.722) |
| | | Merrill Lynch | 3.210 | (17.303) | IMAX Corp | Barclays Bank | (25.435) |
| 39.357 | IDACORP Inc | Barclays Bank | 71.630 | (6.439) | IMAX Corp | Goldman Sachs | (9.594) |
| 13.358 | IDACORP Inc | Goldman Sachs | 8.015 | (58.638) | Immersion Corp | Bank of America | |
| 5.272 | IDACORP Inc | HSBC | 3.374 | | | Merrill Lynch | (6.450) |
| 12.526 | IDACORP Inc | Morgan Stanley | 22.797 | (79.749) | Immersion Corp | Barclays Bank | (12.760) |
| (3.077) | Ideaya Biosciences Inc | Barclays Bank | (62) | (33.485) | Immersion Corp | Goldman Sachs | (3.683) |
| (9.407) | Ideaya Biosciences Inc | Goldman Sachs | (3.104) | 4.143 | Immuneering Corp 'A' | Barclays Bank | 911 |
| (1.952) | Ideaya Biosciences Inc | HSBC | (4.841) | 2.351 | Immuneering Corp 'A' | Goldman Sachs | (165) |
| (12.958) | Identiv Inc | Bank of America | | 628 | Immuneering Corp 'A' | HSBC | 207 |
| | | Merrill Lynch | (17.105) | 2.449 | Immuneering Corp 'A' | Morgan Stanley | 539 |
| (20.311) | Identiv Inc | Barclays Bank | (21.530) | (16.839) | Immunic Inc | Bank of America | |
| (16.843) | Identiv Inc | Goldman Sachs | (22.233) | | | Merrill Lynch | (4.063) |
| (20.786) | Idera Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | (1.232) | Immunic Inc | Barclays Bank | (99) |
| | | Merrill Lynch | (6.970) | (4.227) | Immunic Inc | Goldman Sachs | (211) |
| (35.875) | Idera Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (5.561) | (6.037) | ImmunityBio Inc | Goldman Sachs | 362 |
| (3.115) | IDEX Corp | Bank of America | | (23.479) | ImmunityBio Inc | Morgan Stanley | (470) |
| | | Merrill Lynch | (9.688) | (12.366) | ImmunoGen Inc | Bank of America | |
| (10.762) | IDEX Corp | Barclays Bank | (33.147) | | | Merrill Lynch | 495 |
| (9.616) | IDEX Corp | Goldman Sachs | (28.231) | (13.663) | ImmunoGen Inc | HSBC | 2.869 |
| (4.221) | IDEX Corp | HSBC | (13.838) | (10.891) | Immunovant Inc | Bank of America | |
| (5.111) | IDEX Corp | Morgan Stanley | (15.742) | | | Merrill Lynch | (1.960) |
| 5.020 | IDEXX Laboratories Inc | Barclays Bank | 124.797 | (21.061) | Immunovant Inc | Barclays Bank | (7.161) |
| 478 | IDEXX Laboratories Inc | Goldman Sachs | 15.769 | (7.070) | Immunovant Inc | Goldman Sachs | (1.273) |
| 872 | IDEXX Laboratories Inc | HSBC | 42.004 | (2.123) | Immunovant Inc | Morgan Stanley | (722) |
| 493 | IDT Corp 'B' | Bank of America | | 2.727 | Impel Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 382 |
| | | Merrill Lynch | 626 | 4.812 | Impel Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 2.598 |
| 1.240 | IDT Corp 'B' | HSBC | 1.290 | (4.010) | Impinj Inc | Barclays Bank | (8.822) |
| 5.848 | IDT Corp 'B' | Morgan Stanley | 5.205 | (2.269) | Impinj Inc | Goldman Sachs | (1.997) |
| (4.316) | IES Holdings Inc | Bank of America | | (4.785) | Impinj Inc | HSBC | (17.752) |
| | | Merrill Lynch | (5.827) | (1.024) | Impinj Inc | Morgan Stanley | (2.253) |
| (3.049) | IES Holdings Inc | Barclays Bank | (4.452) | (2.104) | Inari Medical Inc | Bank of America | |
| (2.091) | IES Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.823) | | | Merrill Lynch | (12.666) |
| (1.732) | IES Holdings Inc | HSBC | (7.049) | (12.137) | Inari Medical Inc | Barclays Bank | (42.965) |
| (5.974) | IES Holdings Inc | Morgan Stanley | (8.722) | (17.415) | Inari Medical Inc | Goldman Sachs | (102.450) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (6.081) | Inari Medical Inc | HSBC | (68.225) | 9.816 | Information Services Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.386 |
| 8.131 | Incyte Corp | Bank of America Merrill Lynch | 9.979 | 23.730 | Information Services Group Inc | Barclays Bank | 5.114 |
| 13.578 | Incyte Corp | Barclays Bank | (17.371) | 8.974 | Information Services Group Inc | Goldman Sachs | (91) |
| 3.503 | Incyte Corp | Goldman Sachs | 3.678 | 13.452 | Information Services Group Inc | Morgan Stanley | 3.632 |
| 7.833 | Incyte Corp | HSBC | (2.217) | (10.306) | Infrastructure and Energy Alternatives Inc | Goldman Sachs | (16.696) |
| 893 | Incyte Corp | Morgan Stanley | (1.233) | (8.616) | InfuSystem Holdings Inc | Barclays Bank | (6.376) |
| (2.723) | Independence Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (3.159) | (22.828) | InfuSystem Holdings Inc | Goldman Sachs | (34.470) |
| 3.290 | Independence Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 2.936 | (4.079) | InfuSystem Holdings Inc | HSBC | (5.343) |
| (48.508) | Independence Realty Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | (36.866) | (13.718) | Ingersoll Rand Inc | Bank of America Merrill Lynch | (52.403) |
| (25.025) | Independence Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (29.089) | 5.295 | Ingersoll Rand Inc | Bank of America Merrill Lynch | 20.227 |
| 22.425 | Independence Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 26.013 | (35.761) | Ingersoll Rand Inc | Barclays Bank | (68.304) |
| (36.852) | Independence Realty Trust Inc (REIT) | HSBC | (52.691) | 6.983 | Ingersoll Rand Inc | Barclays Bank | 13.338 |
| 29.646 | Independence Realty Trust Inc (REIT) | HSBC | 37.631 | (58.385) | Ingersoll Rand Inc | Goldman Sachs | (223.031) |
| (26.616) | Independence Realty Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (20.229) | 7.846 | Ingersoll Rand Inc | Goldman Sachs | 29.972 |
| (3.445) | Independent Bank Corp | Bank of America Merrill Lynch | (20.308) | (10.123) | Ingersoll Rand Inc | HSBC | (40.788) |
| 82.437 | Independent Bank Corp | Bank of America Merrill Lynch | 40.394 | (11.195) | Ingersoll Rand Inc | Morgan Stanley | (21.382) |
| (11.556) | Independent Bank Corp | Barclays Bank | (13.346) | (324) | Ingevity Corp | Bank of America Merrill Lynch | (447) |
| 79.539 | Independent Bank Corp | Barclays Bank | 46.928 | (4.374) | Ingevity Corp | Barclays Bank | (6.780) |
| 45.227 | Independent Bank Corp | Goldman Sachs | 22.161 | (11.120) | Ingevity Corp | Goldman Sachs | (46.249) |
| (1.485) | Independent Bank Corp | Goldman Sachs | (7.840) | (352) | Ingevity Corp | HSBC | (1.396) |
| (11.216) | Independent Bank Corp | HSBC | (60.686) | (1.216) | Ingevity Corp | Morgan Stanley | (1.885) |
| 44.960 | Independent Bank Corp | Morgan Stanley | 26.526 | (971) | Ingles Markets Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 4.467 |
| (2.125) | Independent Bank Corp | Morgan Stanley | (2.656) | (10.701) | Ingles Markets Inc 'A' | Barclays Bank | (23.270) |
| (3.953) | Independent Bank Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (12.860) | (3.331) | Ingles Markets Inc 'A' | Goldman Sachs | 9.725 |
| (7.095) | Independent Bank Group Inc | Barclays Bank | (10.926) | (632) | Ingles Markets Inc 'A' | HSBC | 3.568 |
| (11.696) | Independent Bank Group Inc | Goldman Sachs | (49.942) | (1.797) | Ingredion Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.822) |
| (6.309) | Independent Bank Group Inc | HSBC | (19.563) | (1.125) | Ingredion Inc | Barclays Bank | (1.575) |
| (3.908) | Independent Bank Group Inc | Morgan Stanley | (7.849) | 12.941 | Ingredion Inc | Goldman Sachs | 33.000 |
| (6.527) | Indus Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 25.444 | (2.857) | Ingredion Inc | HSBC | (3.236) |
| (2.053) | Indus Realty Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 2.710 | (1.777) | Ingredion Inc | Morgan Stanley | (2.189) |
| (12.378) | Indus Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 52.872 | (1.002) | Inhibrx Inc | Bank of America Merrill Lynch | 421 |
| (2.349) | Indus Realty Trust Inc (REIT) | HSBC | 10.622 | (2.019) | Inhibrx Inc | Goldman Sachs | 848 |
| (4.282) | Indus Realty Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 5.439 | (1.604) | Inhibrx Inc | HSBC | 2.053 |
| (7.072) | Industrial Logistics Properties Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (530) | (10.580) | Innodata Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9.310 |
| (26.582) | Industrial Logistics Properties Trust (REIT) | Barclays Bank | (28.177) | (13.471) | Innodata Inc | Barclays Bank | (2.290) |
| (41.386) | Industrial Logistics Properties Trust (REIT) | Goldman Sachs | (7.036) | (3.851) | Innodata Inc | Goldman Sachs | 3.389 |
| 7.837 | Infinera Corp | Barclays Bank | 1.254 | 4.102 | Innospec Inc | Barclays Bank | 7.753 |
| 22.906 | Infinera Corp | Goldman Sachs | 229 | 14.687 | Innospec Inc | Goldman Sachs | 1.469 |
| 29.042 | Infinera Corp | HSBC | 2.384 | 3.108 | Innospec Inc | HSBC | 7.708 |
| 4.251 | Infinity Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 729 | (2.140) | Innovage Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | (535) |
| 14.720 | Infinity Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 1.622 | (2.836) | Innovage Holding Corp | Barclays Bank | 142 |
| 11.972 | Infinity Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 2.053 | (15.897) | Innovage Holding Corp | Goldman Sachs | (3.974) |
| 26.123 | Infinity Pharmaceuticals Inc | HSBC | 525 | (9.044) | Innovage Holding Corp | HSBC | 2.080 |
| (6.437) | Informatica Inc 'A' | Barclays Bank | (7.531) | (16.514) | INNOVATE Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.486) |
| (4.441) | Informatica Inc 'A' | HSBC | (12.346) | (48.441) | INNOVATE Corp | Barclays Bank | (6.782) |
| (12.755) | Informatica Inc 'A' | Morgan Stanley | (14.923) | (10.836) | INNOVATE Corp | Goldman Sachs | (975) |
| | | | | (1.266) | Innoviva Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.139 |
| | | | | (29.166) | Innoviva Inc | Barclays Bank | 33.833 |
| | | | | (6.628) | Innoviva Inc | Goldman Sachs | 5.965 |
| | | | | (3.083) | Innoviva Inc | HSBC | 1.363 |
| | | | | (3.039) | Innoviva Inc | Morgan Stanley | 3.525 |
| | | | | (3.628) | Inogen Inc | Barclays Bank | 1.995 |
| | | | | (3.704) | Inogen Inc | Goldman Sachs | 259 |
| | | | | (4.157) | Inogen Inc | HSBC | (7.275) |
| | | | | (2.702) | Inogen Inc | Morgan Stanley | 1.486 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|-----------------|---|---|---------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (1.758) | Inotiv Inc | Bank of America | | 6.721 | Integra LifeSciences | | |
| | | Merrill Lynch | 3.757 | | Holdings Corp | Goldman Sachs | 7.110 |
| (5.562) | Inotiv Inc | Barclays Bank | (17.131) | 5.855 | Integra LifeSciences | | |
| (1.660) | Inotiv Inc | Goldman Sachs | (4.447) | | Holdings Corp | HSBC | 30.621 |
| (26.917) | Inovio Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (808) | 26.400 | Integra LifeSciences | | |
| (10.634) | Inovio Pharmaceuticals Inc | HSBC | 4.466 | | Holdings Corp | Morgan Stanley | 27.192 |
| 6.403 | Inozyme Pharma Inc | Barclays Bank | (1.601) | 1.953 | Integral Ad Science | Bank of America | |
| 5.796 | Inozyme Pharma Inc | Goldman Sachs | 58 | | Holding LLC | Merrill Lynch | 2.832 |
| 13.311 | Inozyme Pharma Inc | Morgan Stanley | (3.328) | 11.571 | Integral Ad Science | | |
| 6.907 | Inseego Corp | Bank of America | | | Holding LLC | Barclays Bank | 2.430 |
| | | Merrill Lynch | (1.105) | 19.817 | Integral Ad Science | | |
| 23.656 | Inseego Corp | Barclays Bank | (373) | | Holding LLC | Goldman Sachs | 21.443 |
| 9.601 | Inseego Corp | Goldman Sachs | (1.536) | 7.227 | Integral Ad Science | | |
| 5.733 | Inseego Corp | HSBC | (631) | | Holding LLC | HSBC | 7.720 |
| 3.774 | Inseego Corp | Morgan Stanley | (113) | 9.510 | Integral Ad Science | | |
| 1.365 | Insight Enterprises Inc | Bank of America | | | Holding LLC | Morgan Stanley | 1.997 |
| | | Merrill Lynch | (1.611) | 3.684 | Intel Corp | Bank of America | |
| 19.396 | Insight Enterprises Inc | Barclays Bank | 24.439 | | Merrill Lynch | | 5.812 |
| 5.363 | Insight Enterprises Inc | Goldman Sachs | (6.328) | 27.937 | Intel Corp | Barclays Bank | 52.941 |
| 9.178 | Insight Enterprises Inc | HSBC | (9.453) | 70.738 | Intel Corp | Goldman Sachs | 110.852 |
| 606 | Insight Enterprises Inc | Morgan Stanley | 764 | 21.546 | Intel Corp | HSBC | (345) |
| (11.899) | Insmed Inc | Barclays Bank | 6.068 | (1.719) | Intellia Therapeutics Inc | Bank of America | |
| (6.492) | Insmed Inc | Goldman Sachs | 958 | | Merrill Lynch | | (3.455) |
| (12.569) | Insmed Inc | HSBC | (23.001) | (6.254) | Intellia Therapeutics Inc | Barclays Bank | (4.065) |
| (2.812) | Insmed Inc | Morgan Stanley | (677) | (10.047) | Intellia Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (16.850) |
| 13.376 | Insperty Inc | Barclays Bank | 82.262 | (1.949) | Intellia Therapeutics Inc | HSBC | (10.903) |
| 2.443 | Insperty Inc | HSBC | 31 | (2.301) | Intellia Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.496) |
| 1.962 | Insperty Inc | Morgan Stanley | 12.066 | (8.246) | Intellicheck Inc | Bank of America | |
| 14.769 | Inspirato Inc | Barclays Bank | 12.406 | | Merrill Lynch | | 990 |
| 40.228 | Inspirato Inc | HSBC | 38.217 | (56.390) | Intellicheck Inc | Barclays Bank | (4.511) |
| 18.286 | Inspirato Inc | Morgan Stanley | 15.360 | (6.085) | Inter Parfums Inc | Barclays Bank | (9.736) |
| (2.428) | Inspire Medical Systems Inc | Bank of America | | (6.472) | Inter Parfums Inc | Goldman Sachs | (8.155) |
| | | Merrill Lynch | (45.840) | (5.182) | Inter Parfums Inc | HSBC | 31.507 |
| (2.952) | Inspire Medical Systems Inc | Barclays Bank | (15.941) | 3.356 | Interactive Brokers | Bank of America | |
| (1.887) | Inspire Medical Systems Inc | Goldman Sachs | (35.627) | | Group Inc 'A' | Merrill Lynch | 20.754 |
| (1.867) | Inspire Medical Systems Inc | HSBC | (63.900) | 11.837 | Interactive Brokers | | |
| (1.189) | Inspire Medical Systems Inc | Morgan Stanley | (6.421) | | Group Inc 'A' | Barclays Bank | 37.161 |
| (6.787) | Inspired Entertainment Inc | Bank of America | | 5.155 | Interactive Brokers | | |
| | | Merrill Lynch | (4.344) | | Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 32.820 |
| (10.298) | Inspired Entertainment Inc | Barclays Bank | (9.371) | 475 | Interactive Brokers | | |
| (5.753) | Inspired Entertainment Inc | Morgan Stanley | (5.235) | | Group Inc 'A' | HSBC | 3.276 |
| (13.373) | Installed Building | | | 3.500 | Interactive Brokers | | |
| | Products Inc | Barclays Bank | (71.679) | | Group Inc 'A' | Morgan Stanley | 11.900 |
| (12.221) | Insteel Industries Inc | Goldman Sachs | 4.522 | 11.854 | Intercept | | |
| (12.082) | Insteel Industries Inc | HSBC | 23.077 | | Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 7.824 |
| (2.519) | Insteel Industries Inc | Morgan Stanley | (1.360) | 6.678 | Intercept | | |
| (14.517) | Instil Bio Inc | Barclays Bank | 22.211 | | Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 3.272 |
| (2.304) | Instil Bio Inc | HSBC | (599) | 3.647 | Intercept | | |
| 2.419 | Instructure Holdings Inc | Bank of America | | | Pharmaceuticals Inc | HSBC | 2.298 |
| | | Merrill Lynch | 3.798 | 10.082 | Intercontinental | | |
| 11.316 | Instructure Holdings Inc | Barclays Bank | 13.466 | | Exchange Inc | Barclays Bank | 40.429 |
| 7.546 | Instructure Holdings Inc | Goldman Sachs | 11.847 | 7.663 | Intercontinental | | |
| 7.125 | Instructure Holdings Inc | HSBC | 6.199 | | Exchange Inc | Goldman Sachs | 36.859 |
| 5.161 | Instructure Holdings Inc | Morgan Stanley | 6.142 | 6.190 | Intercontinental | | |
| (879) | Insulet Corp | Bank of America | | | Exchange Inc | HSBC | 31.755 |
| | | Merrill Lynch | (6.751) | 4.932 | Intercontinental | | |
| (2.508) | Insulet Corp | Barclays Bank | (4.364) | | Exchange Inc | Morgan Stanley | 19.777 |
| (1.587) | Insulet Corp | Goldman Sachs | (12.188) | (774) | InterDigital Inc | Bank of America | |
| (980) | Insulet Corp | HSBC | (12.867) | | | Merrill Lynch | (2.763) |
| (550) | Insulet Corp | Morgan Stanley | (957) | (9.315) | InterDigital Inc | Barclays Bank | (30.553) |
| 1.699 | Intapp Inc | Barclays Bank | (1.512) | (14.891) | InterDigital Inc | HSBC | (68.201) |
| 2.897 | Intapp Inc | Goldman Sachs | 1.159 | (2.302) | Interface Inc | Bank of America | |
| 1.816 | Intapp Inc | HSBC | (7.518) | | | Merrill Lynch | (2.302) |
| 9.186 | Integer Holdings Corp | Barclays Bank | 27.466 | (77.946) | Interface Inc | Barclays Bank | (49.106) |
| 14.899 | Integer Holdings Corp | Goldman Sachs | 110.700 | (18.191) | Interface Inc | Goldman Sachs | (18.191) |
| 19.536 | Integra LifeSciences | Bank of America | | (11.360) | Interface Inc | HSBC | (17.835) |
| | Holdings Corp | Merrill Lynch | 39.267 | (6.725) | Interface Inc | Morgan Stanley | (4.237) |
| 21.354 | Integra LifeSciences | | | (1.491) | International Bancshares | Bank of America | |
| | Holdings Corp | Barclays Bank | 21.995 | | Corp | Merrill Lynch | (1.581) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|-------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (5.688) | International Bancshares Corp | Barclays Bank | (4.607) | 608 | Intuit Inc | Morgan Stanley | 30.175 |
| (4.550) | International Bancshares Corp | Goldman Sachs | (7.144) | (1.301) | Intuitive Surgical Inc | Bank of America | (12.260) |
| (11.278) | International Bancshares Corp | HSBC | (5.419) | (3.135) | Intuitive Surgical Inc | Barclays Bank | (17.085) |
| (23.282) | International Bancshares Corp | Morgan Stanley | (18.858) | (8.068) | Intuitive Surgical Inc | Goldman Sachs | (62.642) |
| (1.674) | International Business Machines Corp | Barclays Bank | (11.517) | (12.474) | Intuitive Surgical Inc | HSBC | (216.501) |
| (26.115) | International Business Machines Corp | Goldman Sachs | (78.868) | (3.970) | Intuitive Surgical Inc | Morgan Stanley | (21.637) |
| (1.744) | International Flavors & Fragrances Inc | Bank of America | (4.656) | 5.918 | Invacare Corp | Bank of America | |
| (3.047) | International Flavors & Fragrances Inc | Merrill Lynch | (2.646) | 9.737 | Invacare Corp | Merrill Lynch | (473) |
| (12.236) | International Flavors & Fragrances Inc | Barclays Bank | (28.619) | 16.923 | Invacare Corp | Barclays Bank | 611 |
| (17.953) | International Flavors & Fragrances Inc | Goldman Sachs | (140.629) | 37.821 | Invacare Corp | Goldman Sachs | (1.354) |
| 10.707 | International Game Technology Plc | HSBC | 19.096 | (52.635) | Invacare Corp | HSBC | (16.641) |
| 26.443 | International Game Technology Plc | Bank of America | 21.947 | (46.459) | Invesco Ltd | Barclays Bank | (30.002) |
| 37.047 | International Game Technology Plc | Merrill Lynch | 40.011 | (64.416) | Invesco Ltd | Goldman Sachs | (73.405) |
| 17.701 | International Game Technology Plc | HSBC | 57.174 | (26.339) | Invesco Ltd | HSBC | (100.488) |
| 8.300 | International Game Technology Plc | Morgan Stanley | 5.332 | (228.184) | Invesco Mortgage Capital Inc (REIT) | Bank of America | |
| 14.640 | International Money Express Inc | Barclays Bank | 3.928 | (133.797) | Invesco Mortgage Capital Inc (REIT) | Merrill Lynch | 132 |
| 27.726 | International Money Express Inc | Goldman Sachs | 23.013 | (58.591) | Invesco Mortgage Capital Inc (REIT) | Barclays Bank | (10.268) |
| 1.897 | International Money Express Inc | HSBC | 57 | 10.705 | Investar Holding Corp | Goldman Sachs | 669 |
| (19.344) | International Paper Co | Bank of America | (18.051) | 10.254 | Investar Holding Corp | HSBC | (4.980) |
| (25.748) | International Paper Co | Merrill Lynch | (15.843) | 29.512 | Investar Holding Corp | Barclays Bank | 16.593 |
| (8.407) | International Paper Co | Barclays Bank | (7.767) | 5.910 | Investar Holding Corp | Goldman Sachs | 18.560 |
| (13.853) | International Paper Co | Goldman Sachs | (11.913) | 670 | Investors Title Co | HSBC | 56.663 |
| (39.595) | International Paper Co | HSBC | (20.985) | 1.037 | Investors Title Co | Morgan Stanley | 9.161 |
| (9.084) | International Paper Co | Morgan Stanley | (1.998) | 5.531 | Investors Title Co | Bank of America | |
| (31.527) | International Paper Co | Barclays Bank | (34.364) | 1.658 | Investors Title Co | Merrill Lynch | 446 |
| (13.122) | International Paper Co | Goldman Sachs | (58.130) | 1.069 | Invitae Corp | Barclays Bank | 6.072 |
| (5.956) | International Paper Co | HSBC | (4.646) | 14.973 | Invitae Corp | Goldman Sachs | 3.678 |
| 53.446 | Interpublic Group of Cos Inc | Barclays Bank | 5.345 | 46.392 | Invitae Corp | HSBC | (12.103) |
| (14.426) | Interpublic Group of Cos Inc | Goldman Sachs | 4.959 | 46.069 | Invitae Corp | Morgan Stanley | 6.259 |
| 3.687 | Interpublic Group of Cos Inc | HSBC | (1.770) | 54.319 | Invitae Corp | Bank of America | |
| (903) | Interpublic Group of Cos Inc | Morgan Stanley | 433 | 11.971 | Invitae Corp | Merrill Lynch | 1.422 |
| (7.959) | Interpublic Group of Cos Inc | Bank of America | (6.208) | 2.070 | Invitation Homes Inc (REIT) | Barclays Bank | 6.263 |
| (11.764) | Intevac Inc | Merrill Lynch | 235 | (26.608) | Invitation Homes Inc (REIT) | Goldman Sachs | 4.377 |
| (782) | Intevac Inc | Barclays Bank | (8) | 8.254 | Invitation Homes Inc (REIT) | HSBC | (20.913) |
| (30.794) | Intevac Inc | Goldman Sachs | 616 | (15.763) | Invitation Homes Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.616 |
| (900) | Intevac Inc | HSBC | (99) | 13.219 | Invitation Homes Inc (REIT) | Barclays Bank | 2.939 |
| (4.245) | Intra-Cellular Therapies Inc | Bank of America | | (9.967) | Invitation Homes Inc (REIT) | Goldman Sachs | (37.783) |
| (3.848) | Intra-Cellular Therapies Inc | Merrill Lynch | 5.417 | 48.322 | Invitation Homes Inc (REIT) | Goldman Sachs | 13.867 |
| (13.139) | Intra-Cellular Therapies Inc | Barclays Bank | 3.040 | (1.152) | Invitation Homes Inc (REIT) | HSBC | (23.087) |
| (3.743) | Intra-Cellular Therapies Inc | Goldman Sachs | 17.537 | (1.621) | Ionis Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (23.087) |
| (2.645) | Intrepid Potash Inc | HSBC | (45.270) | (3.917) | Ionis Pharmaceuticals Inc | HSBC | 30.668 |
| (407) | Intrepid Potash Inc | Barclays Bank | (10.644) | (10.791) | Ionis Pharmaceuticals Inc | HSBC | (23.123) |
| (807) | Intrepid Potash Inc | Goldman Sachs | (1.476) | (12.915) | Ionis Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 60.207 |
| 888 | Intuit Inc | HSBC | (5.483) | (6.269) | Ionis Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (1.636) |
| 2.634 | Intuit Inc | Bank of America | | (12.025) | Ionis Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| 619 | Intuit Inc | Merrill Lynch | 54.532 | 511 | IPG Photonics Corp | Merrill Lynch | 3.266 |
| 557 | Intuit Inc | Barclays Bank | 130.725 | 522 | IPG Photonics Corp | Barclays Bank | 2.098 |
| | | Goldman Sachs | 41.483 | 7.202 | IPG Photonics Corp | Goldman Sachs | 46.021 |
| | | HSBC | 32.892 | 4.594 | IPG Photonics Corp | HSBC | 10.704 |
| | | | | 3.175 | IPG Photonics Corp | Morgan Stanley | 12.763 |
| | | | | (14.255) | IPsidy Inc | Barclays Bank | 143 |
| | | | | (1.920) | IQVIA Holdings Inc | Bank of America | |
| | | | | (5.332) | IQVIA Holdings Inc | Merrill Lynch | (17.261) |
| | | | | (2.196) | IQVIA Holdings Inc | Barclays Bank | (64.251) |
| | | | | (3.828) | IQVIA Holdings Inc | Goldman Sachs | (19.742) |
| | | | | (649) | IQVIA Holdings Inc | HSBC | (43.881) |
| | | | | 4.757 | iRadimed Corp | Morgan Stanley | (7.820) |
| | | | | | | Barclays Bank | 3.663 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------|----------------------------------|---|---|-----------------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.073 | iRadimed Corp | Goldman Sachs | (1.191) | (9.778) | J M Smucker Co | Goldman Sachs | 194.680 |
| (1.517) | iRhythm Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (13.486) | 1.209 | J M Smucker Co | Goldman Sachs | (980) |
| (2.193) | iRhythm Technologies Inc | Barclays Bank | (6.667) | 10.491 | J M Smucker Co | HSBC | 7.853 |
| (5.549) | iRhythm Technologies Inc | Goldman Sachs | (49.330) | (2.372) | J M Smucker Co | Morgan Stanley | (3.914) |
| (310) | iRhythm Technologies Inc | HSBC | (6.680) | 3.172 | J M Smucker Co | Morgan Stanley | (8.550) |
| (1.017) | iRhythm Technologies Inc | Morgan Stanley | (3.092) | 4.525 | Jabil Inc | Bank of America Merrill Lynch | 17.930 |
| 5.759 | Iridium Communications Inc | Bank of America Merrill Lynch | 20.675 | 26.672 | Jabil Inc | Barclays Bank | 90.418 |
| 28.267 | Iridium Communications Inc | Barclays Bank | 26.006 | 4.709 | Jabil Inc | Goldman Sachs | 16.953 |
| 30.305 | Iridium Communications Inc | Goldman Sachs | 108.795 | 15.258 | Jabil Inc | HSBC | 73.541 |
| 67.575 | Iridium Communications Inc | HSBC | 289.613 | 14.499 | Jabil Inc | Morgan Stanley | 49.151 |
| 11.770 | Iridium Communications Inc | Morgan Stanley | 10.828 | (5.995) | Jack Henry & Associates Inc | Barclays Bank | (24.220) |
| 1.323 | iRobot Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.535 | (3.939) | Jack Henry & Associates Inc | Goldman Sachs | (36.712) |
| 4.891 | iRobot Corp | Barclays Bank | 6.358 | (14.805) | Jack Henry & Associates Inc | HSBC | (132.329) |
| 2.649 | iRobot Corp | HSBC | 7.715 | 1.071 | Jack in the Box Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.276) |
| 2.790 | iRobot Corp | Morgan Stanley | 3.627 | 2.011 | Jack in the Box Inc | Barclays Bank | (9.050) |
| (13.385) | Iron Mountain Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (15.794) | 4.973 | Jack in the Box Inc | Goldman Sachs | (49.835) |
| 1.492 | Iron Mountain Inc (REIT) | Barclays Bank | 4.819 | 2.803 | Jack in the Box Inc | HSBC | (41.176) |
| (7.406) | Iron Mountain Inc (REIT) | Goldman Sachs | (8.739) | 3.059 | Jack in the Box Inc | Morgan Stanley | (13.294) |
| (556) | Iron Mountain Inc (REIT) | HSBC | (667) | 4.086 | Jacobs Engineering Group Inc | Barclays Bank | 7.273 |
| 4.522 | Iron Mountain Inc (REIT) | HSBC | 12.971 | 2.962 | Jacobs Engineering Group Inc | Goldman Sachs | 15.343 |
| (10.257) | Iron Mountain Inc (REIT) | Morgan Stanley | (33.130) | (6.827) | Jacobs Engineering Group Inc | Goldman Sachs | (25.760) |
| 4.037 | Iron Mountain Inc (REIT) | Morgan Stanley | 10.188 | 10.373 | Jacobs Engineering Group Inc | HSBC | 89.934 |
| 30.449 | Ironwood Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (5.785) | (1.608) | Jacobs Engineering Group Inc | HSBC | (14.227) |
| 40.905 | Ironwood Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (13.908) | (21.517) | James River Group Holdings Ltd | Barclays Bank | (4.949) |
| 41.085 | Ironwood Pharmaceuticals Inc | HSBC | (28.760) | (120) | Jamf Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | (414) |
| 15.436 | Ironwood Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (2.933) | (21.423) | Jamf Holding Corp | Barclays Bank | 7.712 |
| 5.355 | IsoPlexis Corp | Barclays Bank | 428 | (10.786) | Jamf Holding Corp | Goldman Sachs | (37.212) |
| 1.334 | IsoPlexis Corp | Goldman Sachs | 280 | (2.491) | Jamf Holding Corp | HSBC | (4.583) |
| 8.602 | IsoPlexis Corp | HSBC | (1.548) | (15.971) | Janus Henderson Group Plc | Barclays Bank | (11.180) |
| 1.260 | IsoPlexis Corp | Morgan Stanley | 101 | 10.668 | Janus Henderson Group Plc | Barclays Bank | 7.468 |
| (6.012) | iStar Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (3.398) | (5.576) | Janus Henderson Group Plc | Goldman Sachs | (2.469) |
| (6.923) | iStar Inc (REIT) | Barclays Bank | (138) | (8.684) | Janus Henderson Group Plc | HSBC | (13.834) |
| (5.747) | iStar Inc (REIT) | Goldman Sachs | (4.425) | 8.880 | Janus Henderson Group Plc | HSBC | 10.440 |
| (33.590) | iStar Inc (REIT) | HSBC | (21.912) | (4.898) | Janus Henderson Group Plc | Morgan Stanley | (5.781) |
| (18.792) | iStar Inc (REIT) | Morgan Stanley | (376) | 10.269 | Jasper Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.232 |
| (471) | iTeos Therapeutics Inc | Barclays Bank | 146 | 2.496 | Jasper Therapeutics Inc | HSBC | (25) |
| (5.853) | iTeos Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 4.911 | (6.906) | Jazz Pharmaceuticals Plc | Barclays Bank | (18.646) |
| (6.731) | iTeos Therapeutics Inc | HSBC | 44.533 | (1.375) | Jazz Pharmaceuticals Plc | Goldman Sachs | (1.444) |
| (44.244) | Iteris Inc | Bank of America Merrill Lynch | (11.061) | (3.009) | Jazz Pharmaceuticals Plc | HSBC | (19.047) |
| (9.336) | Iteris Inc | Goldman Sachs | (2.334) | 1.200 | JB Hunt Transport Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.076) |
| (17.355) | Iteris Inc | Morgan Stanley | (3.297) | 9.665 | JB Hunt Transport Services Inc | Barclays Bank | 56.347 |
| 2.279 | Itron Inc | Bank of America Merrill Lynch | 8.159 | (2.139) | JB Hunt Transport Services Inc | Barclays Bank | (12.470) |
| 9.755 | Itron Inc | Barclays Bank | 12.194 | 2.528 | JB Hunt Transport Services Inc | Goldman Sachs | (1.364) |
| 3.693 | Itron Inc | Goldman Sachs | 13.221 | (3.437) | JB Hunt Transport Services Inc | Goldman Sachs | 5.946 |
| 18.739 | Itron Inc | HSBC | 55.655 | 757 | JB Hunt Transport Services Inc | HSBC | (4.254) |
| 1.918 | Itron Inc | Morgan Stanley | 2.398 | (1.195) | JB Hunt Transport Services Inc | Morgan Stanley | (5.787) |
| (21.489) | ITT Inc | Bank of America Merrill Lynch | (41.875) | (16.414) | JBG SMITH Properties (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (11.490) |
| (6.440) | ITT Inc | Barclays Bank | (22.357) | (39.369) | JBG SMITH Properties (REIT) | Barclays Bank | (35.038) |
| (7.643) | ITT Inc | Goldman Sachs | (19.687) | | | | |
| (21.570) | ITT Inc | HSBC | (44.086) | | | | |
| (3.544) | ITT Inc | Morgan Stanley | (13.239) | | | | |
| (8.218) | IVERIC bio Inc | Barclays Bank | 2.301 | | | | |
| (31.740) | IVERIC bio Inc | Goldman Sachs | 2.539 | | | | |
| (3.029) | IVERIC bio Inc | HSBC | (1.878) | | | | |
| 7.986 | J & J Snack Foods Corp | Barclays Bank | 15.732 | | | | |
| 6.103 | J & J Snack Foods Corp | Goldman Sachs | 4.577 | | | | |
| (3.164) | J M Smucker Co | Barclays Bank | (5.221) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-------------------------------|---|---|------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 13.416 | JBG SMITH Properties (REIT) | Barclays Bank | 11.940 | 2.853 | Johnson Outdoors Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.427) |
| (17.231) | JBG SMITH Properties (REIT) | Goldman Sachs | (12.062) | 3.787 | Johnson Outdoors Inc 'A' | Barclays Bank | 13.292 |
| 1.121 | JBG SMITH Properties (REIT) | Goldman Sachs | 785 | 5.251 | Johnson Outdoors Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.626) |
| (32.442) | JBG SMITH Properties (REIT) | HSBC | (48.339) | 11.740 | Johnson Outdoors Inc 'A' | HSBC | (470) |
| 3.068 | JBG SMITH Properties (REIT) | HSBC | 3.015 | 1.338 | Johnson Outdoors Inc 'A' | Morgan Stanley | 4.696 |
| (9.118) | JBG SMITH Properties (REIT) | Morgan Stanley | (8.115) | (3.903) | Joint Corp | Barclays Bank | (4.098) |
| 1.417 | JBG SMITH Properties (REIT) | Morgan Stanley | 1.146 | (3.408) | Joint Corp | Goldman Sachs | 2.406 |
| 23.046 | Jefferies Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 49.779 | (1.957) | Joint Corp | HSBC | (783) |
| (3.786) | Jefferies Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.662) | (1.831) | Joint Corp | Morgan Stanley | (1.923) |
| 42.416 | Jefferies Financial Group Inc | Barclays Bank | 64.896 | 325 | Jones Lang LaSalle Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.777 |
| 14.623 | Jefferies Financial Group Inc | Goldman Sachs | 31.586 | (151) | Jones Lang LaSalle Inc | Barclays Bank | (1.333) |
| (5.974) | Jefferies Financial Group Inc | Goldman Sachs | (12.904) | 1.401 | Jones Lang LaSalle Inc | Barclays Bank | 12.371 |
| 7.301 | Jefferies Financial Group Inc | HSBC | 5.330 | (3.233) | Jones Lang LaSalle Inc | Goldman Sachs | (20.239) |
| 5.773 | Jefferies Financial Group Inc | Morgan Stanley | 8.833 | 813 | Jones Lang LaSalle Inc | Goldman Sachs | 6.105 |
| 30.940 | JELD-WEN Holding Inc | Barclays Bank | 21.039 | (1.814) | Jones Lang LaSalle Inc | HSBC | (5.351) |
| 25.190 | JELD-WEN Holding Inc | Goldman Sachs | 38.289 | 828 | Jones Lang LaSalle Inc | HSBC | 10.061 |
| 5.713 | JELD-WEN Holding Inc | HSBC | 4.399 | (2.513) | Jones Lang LaSalle Inc | Morgan Stanley | (22.190) |
| 79.669 | JetBlue Airways Corp | Barclays Bank | 31.868 | 2.184 | Jounce Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.201) |
| 174.309 | JetBlue Airways Corp | Goldman Sachs | 205.685 | 26.666 | Jounce Therapeutics Inc | Barclays Bank | (16.266) |
| 94.779 | JetBlue Airways Corp | HSBC | 71.084 | 9.633 | Jounce Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (5.298) |
| 1.523 | JFrog Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.843 | 2.805 | Jounce Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.711) |
| 17.625 | JFrog Ltd | Barclays Bank | (529) | 2.143 | JPMorgan Chase & Co | Bank of America Merrill Lynch | 28.266 |
| 9.698 | JFrog Ltd | Goldman Sachs | 7.851 | 23.387 | JPMorgan Chase & Co | Barclays Bank | 160.201 |
| 6.886 | JFrog Ltd | HSBC | 3.512 | 20.816 | JPMorgan Chase & Co | Goldman Sachs | 274.563 |
| 1.313 | JFrog Ltd | Morgan Stanley | (39) | 7.360 | JPMorgan Chase & Co | HSBC | 73.060 |
| (11.668) | Joby Aviation Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.484) | 15.020 | JPMorgan Chase & Co | Morgan Stanley | 102.887 |
| 12.792 | Joby Aviation Inc | Barclays Bank | 8.187 | (14.311) | Juniper Networks Inc | Barclays Bank | (14.740) |
| 15.200 | Joby Aviation Inc | Goldman Sachs | 7.144 | 177.788 | Juniper Networks Inc | Goldman Sachs | 65.782 |
| 3.659 | Joby Aviation Inc | Morgan Stanley | 2.342 | (23.423) | Juniper Networks Inc | Goldman Sachs | (8.667) |
| 591 | John B Sanfilippo & Son Inc | Bank of America Merrill Lynch | 361 | 16.132 | Juniper Networks Inc | HSBC | 3.737 |
| 3.592 | John B Sanfilippo & Son Inc | Barclays Bank | 7.040 | (9.185) | Juniper Networks Inc | HSBC | 551 |
| 9.188 | John B Sanfilippo & Son Inc | Goldman Sachs | 5.605 | (6.384) | Juniper Networks Inc | Morgan Stanley | (6.576) |
| 2.492 | John B Sanfilippo & Son Inc | HSBC | 4.311 | (384) | Kadant Inc | Bank of America Merrill Lynch | (729) |
| 5.083 | John B Sanfilippo & Son Inc | Morgan Stanley | 9.963 | (635) | Kadant Inc | Barclays Bank | (804) |
| (1.831) | John Bean Technologies Corp | Barclays Bank | (15.545) | (1.283) | Kadant Inc | Goldman Sachs | 1.003 |
| (4.080) | John Bean Technologies Corp | Goldman Sachs | (19.951) | (426) | Kadant Inc | HSBC | 275 |
| (9.222) | John Bean Technologies Corp | HSBC | (45.747) | (6.439) | Kadant Inc | Morgan Stanley | (8.371) |
| (12.054) | John Wiley & Sons Inc 'A' | Barclays Bank | (20.371) | 1.420 | Kaiser Aluminum Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4.473 |
| (10.505) | John Wiley & Sons Inc 'A' | HSBC | (29.637) | 771 | Kaiser Aluminum Corp | Barclays Bank | 1.627 |
| (16.363) | Johnson & Johnson | Barclays Bank | 55.470 | 340 | Kaiser Aluminum Corp | Goldman Sachs | 1.071 |
| (5.187) | Johnson & Johnson | Goldman Sachs | 18.647 | 4.318 | Kaiser Aluminum Corp | HSBC | 33.983 |
| (5.104) | Johnson & Johnson | HSBC | 6.357 | (1.775) | KalVista Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 266 |
| (771) | Johnson & Johnson | Morgan Stanley | 2.614 | (8.963) | KalVista Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 538 |
| 10.733 | Johnson Controls International Plc | Barclays Bank | 26.403 | (10.225) | Kaman Corp | Barclays Bank | (4.090) |
| (21.401) | Johnson Controls International Plc | Barclays Bank | (52.646) | (14.364) | Kaman Corp | Goldman Sachs | (25.281) |
| 187 | Johnson Controls International Plc | Goldman Sachs | 445 | (8.285) | Kaman Corp | HSBC | (6.628) |
| (10.658) | Johnson Controls International Plc | Goldman Sachs | (26.923) | (6.205) | KAR Auction Services Inc | Barclays Bank | (6.143) |
| | | | | (17.514) | KAR Auction Services Inc | Goldman Sachs | (23.469) |
| | | | | (28.683) | KAR Auction Services Inc | HSBC | (82.033) |
| | | | | 35.938 | Karat Packaging Inc | Barclays Bank | 13.656 |
| | | | | 5.240 | Karat Packaging Inc | Goldman Sachs | 1.991 |
| | | | | 12.435 | Karat Packaging Inc | Morgan Stanley | 4.725 |
| | | | | (3.559) | Karuna Therapeutics Inc | Barclays Bank | 12.078 |
| | | | | (3.680) | Karuna Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (55) |
| | | | | 6.924 | Karyopharm Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.816 |
| | | | | 19.324 | Karyopharm Therapeutics Inc | Barclays Bank | 9.082 |
| | | | | 9.168 | Karyopharm Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 7.701 |
| | | | | (16.027) | KB Home | Bank of America Merrill Lynch | (20.835) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (38.400) | KB Home | Barclays Bank | (74.496) | 37.597 | KeyCorp | HSBC | 33.686 |
| (10.141) | KB Home | Goldman Sachs | (13.184) | 79.701 | KeyCorp | Morgan Stanley | 59.775 |
| (26.759) | KB Home | HSBC | (36.050) | 4.695 | Keysight Technologies Inc | Bank of America | |
| (18.207) | KB Home | Morgan Stanley | (35.322) | | | Merrill Lynch | 46.879 |
| 18.598 | KBR Inc | Bank of America | | 6.352 | Keysight Technologies Inc | Barclays Bank | 31.951 |
| | | Merrill Lynch | 76.624 | 20.056 | Keysight Technologies Inc | Goldman Sachs | 200.022 |
| 15.980 | KBR Inc | Barclays Bank | 40.109 | 9.063 | Keysight Technologies Inc | HSBC | 100.342 |
| 16.707 | KBR Inc | Goldman Sachs | 68.832 | 2.638 | Keysight Technologies Inc | Morgan Stanley | 13.269 |
| 59.553 | KBR Inc | HSBC | 292.640 | (1.606) | Kezar Life Sciences Inc | Bank of America | |
| 4.129 | KBR Inc | Morgan Stanley | 10.363 | | | Merrill Lynch | 1.478 |
| (14.195) | Kearny Financial Corp | Bank of America | | (5.235) | Kezar Life Sciences Inc | Barclays Bank | 2.146 |
| | | Merrill Lynch | (7.381) | (12.478) | Kezar Life Sciences Inc | Goldman Sachs | 10.169 |
| (205.665) | Kearny Financial Corp | Barclays Bank | (41.133) | (6.590) | Kezar Life Sciences Inc | HSBC | 4.020 |
| (184.527) | Kearny Financial Corp | Goldman Sachs | (95.954) | (10.330) | Kezar Life Sciences Inc | Morgan Stanley | 4.235 |
| (53.360) | Kearny Financial Corp | HSBC | (16.008) | 5.719 | Kforce Inc | Barclays Bank | (16.070) |
| (25.168) | Kearny Financial Corp | Morgan Stanley | (5.034) | 20.671 | Kforce Inc | Goldman Sachs | (159.373) |
| 23.588 | Kellogg Co | Bank of America | | 452 | Kforce Inc | HSBC | (4.231) |
| | | Merrill Lynch | (111.807) | (19.975) | Kilroy Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | (14.182) |
| (9.893) | Kellogg Co | Bank of America | | (17.208) | Kilroy Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | (12.218) |
| | | Merrill Lynch | 36.799 | (2.165) | Kimball Electronics Inc | Bank of America | |
| 12.430 | Kellogg Co | Barclays Bank | (622) | | | Merrill Lynch | (2.825) |
| (5.583) | Kellogg Co | Barclays Bank | 279 | (8.246) | Kimball Electronics Inc | Barclays Bank | (4.247) |
| 27.542 | Kellogg Co | Goldman Sachs | (130.549) | (29.665) | Kimball Electronics Inc | Goldman Sachs | (38.713) |
| (13.897) | Kellogg Co | Goldman Sachs | 29.850 | (9.706) | Kimball Electronics Inc | HSBC | (8.590) |
| 9.792 | Kellogg Co | HSBC | (59.829) | (6.722) | Kimball Electronics Inc | Morgan Stanley | (3.462) |
| (2.735) | Kellogg Co | HSBC | 446 | 1.540 | Kimball International Inc 'B' | Bank of America | |
| (7.557) | Kellogg Co | Morgan Stanley | 378 | | | Merrill Lynch | 62 |
| 2.598 | Kelly Services Inc 'A' | Bank of America | | 31.085 | Kimball International Inc 'B' | Barclays Bank | 3.730 |
| | | Merrill Lynch | 3.429 | 81.333 | Kimball International Inc 'B' | Goldman Sachs | 3.253 |
| 5.906 | Kelly Services Inc 'A' | Barclays Bank | 2.599 | 8.092 | Kimberly-Clark Corp | Bank of America | |
| 21.643 | Kelly Services Inc 'A' | HSBC | 8.874 | | | Merrill Lynch | 16.487 |
| 5.576 | Kemper Corp | Bank of America | | (28.338) | Kimberly-Clark Corp | Barclays Bank | (53.559) |
| | | Merrill Lynch | 27.359 | 3.643 | Kimberly-Clark Corp | Barclays Bank | (1.377) |
| (7.836) | Kemper Corp | Goldman Sachs | (41.452) | (16.446) | Kimberly-Clark Corp | Goldman Sachs | 125.483 |
| (6.063) | Kemper Corp | HSBC | (26.253) | 4.602 | Kimberly-Clark Corp | HSBC | 243 |
| 829 | Kemper Corp | HSBC | 3.590 | (6.216) | Kimberly-Clark Corp | Morgan Stanley | (11.748) |
| 1.574 | Kemper Corp | Morgan Stanley | 5.635 | 2.637 | Kimberly-Clark Corp | Morgan Stanley | 4.984 |
| (10.099) | KemPharm Inc | Goldman Sachs | (3.939) | (34.648) | Kimco Realty Corp (REIT) | Bank of America | |
| (6.894) | KemPharm Inc | HSBC | (4.412) | | | Merrill Lynch | (10.048) |
| (6.445) | KemPharm Inc | Morgan Stanley | (580) | (24.403) | Kimco Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | (33.483) |
| 18.458 | Kennametal Inc | Bank of America | | (41.443) | Kimco Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | (16.843) |
| | | Merrill Lynch | 32.117 | (25.863) | Kimco Realty Corp (REIT) | HSBC | (7.297) |
| 27.596 | Kennametal Inc | Barclays Bank | 28.424 | (4.361) | Kimco Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | (4.874) |
| 32.923 | Kennametal Inc | Goldman Sachs | 57.286 | 28.147 | Kinder Morgan Inc | Barclays Bank | 22.279 |
| 27.598 | Kennametal Inc | HSBC | 27.003 | 36.973 | Kinder Morgan Inc | Goldman Sachs | 21.444 |
| 11.081 | Kennametal Inc | Morgan Stanley | 11.333 | 43.555 | Kinder Morgan Inc | HSBC | 35.843 |
| 1.099 | Kennedy-Wilson Holdings Inc | Bank of America | | 8.131 | Kinder Morgan Inc | Morgan Stanley | 6.586 |
| | | Merrill Lynch | 385 | 5.280 | King Pubco Inc | Barclays Bank | (422) |
| 23.693 | Kennedy-Wilson Holdings Inc | Barclays Bank | 12.320 | 14.530 | King Pubco Inc | Goldman Sachs | 6.248 |
| 94.016 | Kennedy-Wilson Holdings Inc | Goldman Sachs | 32.906 | 15.656 | King Pubco Inc | HSBC | 5.166 |
| (782) | Keros Therapeutics Inc | Bank of America | | 4.626 | King Pubco Inc | Morgan Stanley | (370) |
| | | Merrill Lynch | 7.765 | 14.808 | Kiniksa Pharmaceuticals Ltd 'A' | Barclays Bank | (9.033) |
| (2.120) | Keros Therapeutics Inc | Barclays Bank | 4.728 | 38.733 | Kiniksa Pharmaceuticals Ltd 'A' | Goldman Sachs | (19.367) |
| (5.862) | Keros Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 58.210 | 14.185 | Kinnate Biopharma Inc | Barclays Bank | (40.995) |
| (435) | Keros Therapeutics Inc | HSBC | 4.080 | 6.656 | Kinnate Biopharma Inc | Goldman Sachs | (12.913) |
| (6.269) | Keurig Dr Pepper Inc | Bank of America | | 6.902 | Kinnate Biopharma Inc | HSBC | 2.968 |
| | | Merrill Lynch | 3.131 | 14.367 | Kinnate Biopharma Inc | Morgan Stanley | (41.521) |
| 101.198 | Keurig Dr Pepper Inc | Barclays Bank | (35.419) | (4.528) | Kinsale Capital Group Inc | Bank of America | |
| (36.660) | Keurig Dr Pepper Inc | Goldman Sachs | 72.185 | | | Merrill Lynch | (50.669) |
| (19.812) | Keurig Dr Pepper Inc | HSBC | 50.124 | (5.602) | Kinsale Capital Group Inc | Barclays Bank | (43.864) |
| 66.360 | Keurig Dr Pepper Inc | Morgan Stanley | (23.226) | (3.162) | Kinsale Capital Group Inc | Goldman Sachs | (34.404) |
| (3.393) | Keurig Dr Pepper Inc | Morgan Stanley | 1.188 | (2.272) | Kinsale Capital Group Inc | HSBC | (21.098) |
| 8.608 | Key Tronic Corp | Bank of America | | (1.991) | Kinsale Capital Group Inc | Morgan Stanley | (15.589) |
| | | Merrill Lynch | 904 | 9.845 | Kirby Corp | Bank of America | |
| 63.469 | KeyCorp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 35.048 |
| | | Merrill Lynch | 74.259 | 5.889 | Kirby Corp | Barclays Bank | 21.730 |
| 146.566 | KeyCorp | Barclays Bank | 109.924 | 1.107 | Kirby Corp | Goldman Sachs | 3.941 |
| 64.363 | KeyCorp | Goldman Sachs | 74.059 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|----------------------------------|---|---|---|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3.694) | Kirby Corp | HSBC | (20.243) | (11.129) | Korn Ferry | Barclays Bank | (25.465) |
| 10.057 | Kirby Corp | HSBC | 55.112 | (6.071) | Korn Ferry | Goldman Sachs | (10.783) |
| 1.118 | Kirby Corp | Morgan Stanley | 4.125 | (2.316) | Korn Ferry | HSBC | (2.039) |
| (19.199) | Kirkland's Inc | Barclays Bank | 7.680 | (1.246) | Korn Ferry | Morgan Stanley | (2.941) |
| (7.332) | Kirkland's Inc | HSBC | 9.605 | 10.086 | Kosmos Energy Ltd | HSBC | 16.702 |
| (7.997) | Kite Realty Group Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.769 | (12.719) | Kraft Heinz Co | Goldman Sachs | 85.980 |
| (66.812) | Kite Realty Group Trust (REIT) | Barclays Bank | (78.838) | (61.236) | Kraft Heinz Co | HSBC | 420.691 |
| (77.806) | Kite Realty Group Trust (REIT) | Goldman Sachs | 35.982 | (28.781) | Kraft Heinz Co | Morgan Stanley | 48.064 |
| (1.945) | Kite Realty Group Trust (REIT) | HSBC | 1.273 | (17.091) | Kratos Defense & Security Solutions Inc | Barclays Bank | (17.775) |
| 4.958 | KKR & Co Inc | Goldman Sachs | 18.493 | (5.298) | Kratos Defense & Security Solutions Inc | HSBC | (8.742) |
| 9.305 | KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 5.979 | (37.643) | Krispy Kreme Inc | HSBC | (75.286) |
| 12.433 | KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 7.211 | (4.931) | Krispy Kreme Inc | Morgan Stanley | (1.183) |
| 8.788 | KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 5.572 | 18.512 | Kroger Co | Bank of America Merrill Lynch | (4.582) |
| 7.290 | KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT) | HSBC | 10.517 | (13.277) | Kroger Co | Barclays Bank | (31.201) |
| 6.994 | KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 3.350 | 7.115 | Kroger Co | Goldman Sachs | (4.482) |
| 492 | KLA Corp | Bank of America Merrill Lynch | 14.917 | (2.996) | Kroger Co | Goldman Sachs | (8.770) |
| 1.478 | KLA Corp | Barclays Bank | 29.087 | (1.644) | Kroger Co | Morgan Stanley | (1.854) |
| 4.210 | KLA Corp | Goldman Sachs | 127.647 | 2.872 | Kronos Bio Inc | Bank of America Merrill Lynch | 144 |
| (3.014) | KLA Corp | Goldman Sachs | (93.653) | 16.128 | Kronos Bio Inc | Barclays Bank | (2.419) |
| 1.585 | KLA Corp | HSBC | 66.554 | 14.669 | Kronos Bio Inc | Goldman Sachs | 733 |
| (1.223) | KLA Corp | HSBC | (28.357) | 13.420 | Kronos Bio Inc | HSBC | (8.320) |
| 543 | KLA Corp | Morgan Stanley | 10.686 | 37.219 | Kronos Bio Inc | Morgan Stanley | 1.247 |
| (9.098) | KLX Energy Services Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (9.553) | (26.578) | Kronos Worldwide Inc | Barclays Bank | (23.389) |
| (3.093) | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.093) | (20.844) | Kronos Worldwide Inc | Goldman Sachs | (58.989) |
| (1.135) | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Barclays Bank | (533) | (53.544) | Kronos Worldwide Inc | HSBC | (174.018) |
| (11.901) | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Goldman Sachs | (11.901) | (1.665) | Krystral Biotech Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.690) |
| (4.888) | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | HSBC | 11.291 | (394) | Krystal Biotech Inc | Barclays Bank | (185) |
| (12.866) | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Morgan Stanley | (6.047) | (596) | Krystal Biotech Inc | Goldman Sachs | (882) |
| 7.149 | Knowles Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.302 | (7.184) | Krystal Biotech Inc | HSBC | (64.225) |
| 84.772 | Knowles Corp | Barclays Bank | 22.888 | (3.068) | Kulicke & Soffa Industries Inc | Barclays Bank | (9.081) |
| 57.369 | Knowles Corp | Goldman Sachs | 18.433 | (6.010) | Kulicke & Soffa Industries Inc | Goldman Sachs | (14.184) |
| 7.030 | Knowles Corp | Morgan Stanley | 1.898 | (3.814) | Kulicke & Soffa Industries Inc | HSBC | (11.289) |
| 10.553 | Kodiak Sciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | 14.035 | (1.952) | Kulicke & Soffa Industries Inc | Morgan Stanley | (5.778) |
| 22.195 | Kodiak Sciences Inc | Barclays Bank | 3.995 | 2.314 | Kura Oncology Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.957 |
| 4.139 | Kodiak Sciences Inc | Goldman Sachs | 5.505 | 5.588 | Kura Oncology Inc | Barclays Bank | 3.073 |
| 26.521 | Kodiak Sciences Inc | HSBC | 45.881 | 2.491 | Kura Oncology Inc | Goldman Sachs | 4.260 |
| 5.056 | Kontoor Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | (16.483) | (728) | Kura Sushi USA Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (3.519) |
| 4.929 | Kontoor Brands Inc | Barclays Bank | 6.112 | (3.020) | Kura Sushi USA Inc 'A' | Barclays Bank | (11.144) |
| 5.392 | Kontoor Brands Inc | Goldman Sachs | (17.578) | (2.010) | Kura Sushi USA Inc 'A' | Goldman Sachs | (7.357) |
| 11.166 | Kontoor Brands Inc | HSBC | (33.721) | (3.000) | Kura Sushi USA Inc 'A' | HSBC | (2.205) |
| 6.858 | Kontoor Brands Inc | Morgan Stanley | 8.504 | 3.795 | KVH Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 721 |
| (12.969) | Kopin Corp | Bank of America Merrill Lynch | 908 | 30.118 | KVH Industries Inc | Barclays Bank | 14.457 |
| (2.768) | Kopin Corp | Goldman Sachs | 194 | 13.245 | KVH Industries Inc | Morgan Stanley | 6.358 |
| (10.052) | Kopin Corp | HSBC | 1.307 | (1.864) | Kymera Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.542 |
| (10.073) | Koppers Holdings Inc | Barclays Bank | (18.232) | (5.474) | Kymera Therapeutics Inc | Barclays Bank | 1.040 |
| (18.378) | Koppers Holdings Inc | Goldman Sachs | (38.594) | (1.518) | Kymera Therapeutics Inc | HSBC | 5.404 |
| (12.708) | Koppers Holdings Inc | Morgan Stanley | (23.001) | (4.170) | Kyndryl Holdings Inc | Goldman Sachs | (959) |
| (5.287) | Korn Ferry | Bank of America Merrill Lynch | (8.757) | (4.166) | Kyndryl Holdings Inc | HSBC | 1.500 |
| | | | | 10.797 | Kyndryl Holdings Inc | Morgan Stanley | (5.217) |
| | | | | 23.258 | L B Foster Co 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 14.536 |
| | | | | 8.413 | L B Foster Co 'A' | Barclays Bank | 3.323 |
| | | | | 14.739 | L B Foster Co 'A' | Goldman Sachs | 9.212 |
| | | | | 1.159 | L B Foster Co 'A' | HSBC | 122 |
| | | | | 11.886 | L B Foster Co 'A' | Morgan Stanley | 4.695 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (16.325) | L Brands Inc | Bank of America | | 3.311 | Lancaster Colony Corp | HSBC | (50.711) |
| | | Merrill Lynch | 118.682 | 545 | Lancaster Colony Corp | Morgan Stanley | (1.428) |
| (29.081) | L Brands Inc | Goldman Sachs | 211.419 | 47.985 | Landec Corp | Goldman Sachs | 35.509 |
| (7.147) | L Brands Inc | HSBC | 65.752 | 12.845 | Landec Corp | HSBC | 11.560 |
| 2.736 | La Jolla Pharmaceutical Co | Bank of America | | (7.590) | Landmark Bancorp Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (930) | | | Merrill Lynch | (4.934) |
| 5.352 | La Jolla Pharmaceutical Co | Barclays Bank | — | (12.676) | Landmark Bancorp Inc | Goldman Sachs | (8.239) |
| 2.664 | La Jolla Pharmaceutical Co | HSBC | 80 | 3.897 | Landos Biopharma Inc | Goldman Sachs | 175 |
| 8.968 | La Jolla Pharmaceutical Co | Morgan Stanley | — | 2.976 | Lands' End Inc | Barclays Bank | 1.786 |
| (2.450) | Laboratory Corp of America Holdings | Bank of America | | 1.236 | Lands' End Inc | HSBC | (1.644) |
| | | Merrill Lynch | (17.444) | 2.650 | Lands' End Inc | Morgan Stanley | 1.590 |
| 872 | Laboratory Corp of America Holdings | Barclays Bank | — | 16.919 | Landsea Homes Corp | Barclays Bank | 1.861 |
| (3.898) | Laboratory Corp of America Holdings | Goldman Sachs | (27.754) | 7.388 | Landsea Homes Corp | HSBC | (6.575) |
| 379 | Laboratory Corp of America Holdings | Goldman Sachs | 931 | 5.387 | Landstar System Inc | Bank of America | |
| (1.674) | Laboratory Corp of America Holdings | HSBC | (14.874) | 6.564 | Landstar System Inc | Barclays Bank | (15.191) |
| (689) | Laboratory Corp of America Holdings | Morgan Stanley | — | (2.608) | Landstar System Inc | Barclays Bank | 10.174 |
| 1.288 | Laboratory Corp of America Holdings | Morgan Stanley | — | 8.664 | Landstar System Inc | Goldman Sachs | (4.042) |
| (9.421) | Ladder Capital Corp (REIT) | Bank of America | | (1.838) | Landstar System Inc | Goldman Sachs | (24.432) |
| | | Merrill Lynch | (1.131) | (837) | Landstar System Inc | HSBC | 5.183 |
| (34.643) | Ladder Capital Corp (REIT) | Barclays Bank | (12.471) | 3.463 | Lannett Co Inc | Bank of America | 6.077 |
| (94.341) | Ladder Capital Corp (REIT) | Goldman Sachs | (12.202) | 1.056 | Lannett Co Inc | Merrill Lynch | (131) |
| (63.409) | Ladder Capital Corp (REIT) | HSBC | (27.266) | 3.386 | Lannett Co Inc | Barclays Bank | (7) |
| (12.907) | Ladder Capital Corp (REIT) | Morgan Stanley | (4.647) | (3.106) | Lantheus Holdings Inc | Morgan Stanley | (24) |
| (927) | Laird Superfood Inc | Barclays Bank | 83 | (1.435) | Lantheus Holdings Inc | Bank of America | |
| 1.600 | Lakeland Bancorp Inc | Bank of America | | (873) | Lantheus Holdings Inc | Merrill Lynch | (9.536) |
| | | Merrill Lynch | 784 | (13.099) | Lantheus Holdings Inc | Barclays Bank | (4.807) |
| 66.080 | Lakeland Bancorp Inc | Barclays Bank | 25.110 | 6.571 | Lantronix Inc | Goldman Sachs | (3.416) |
| 27.430 | Lakeland Bancorp Inc | Goldman Sachs | 13.441 | 2.334 | Lantronix Inc | Morgan Stanley | (43.881) |
| 31.515 | Lakeland Bancorp Inc | HSBC | 10.725 | 6.402 | Lantronix Inc | Barclays Bank | (723) |
| 130.499 | Lakeland Bancorp Inc | Morgan Stanley | 49.590 | 298 | Laredo Petroleum Inc | HSBC | (210) |
| (377) | Lakeland Financial Corp | Bank of America | | 6.402 | Laredo Petroleum Inc | Morgan Stanley | (704) |
| | | Merrill Lynch | 54 | 1.741 | Laredo Petroleum Inc | Bank of America | |
| (14.083) | Lakeland Financial Corp | Barclays Bank | (10.562) | 360 | Laredo Petroleum Inc | Merrill Lynch | 7.864 |
| (6.223) | Lakeland Financial Corp | Goldman Sachs | (11.886) | 1.320 | Laredo Petroleum Inc | Barclays Bank | 31.756 |
| (1.741) | Lakeland Financial Corp | HSBC | 825 | (41.207) | Las Vegas Sands Corp | Goldman Sachs | 6.200 |
| (29.422) | Lakeland Industries Inc | Barclays Bank | (31.776) | (1.677) | Las Vegas Sands Corp | HSBC | 35.555 |
| (363) | Lam Research Corp | Bank of America | | (31.572) | Latch Inc | Barclays Bank | (113.319) |
| | | Merrill Lynch | (11.798) | (7.070) | Latch Inc | HSBC | (8.889) |
| (5.573) | Lam Research Corp | Barclays Bank | (176.497) | (8.106) | Latch Inc | Barclays Bank | 4.578 |
| 682 | Lam Research Corp | Goldman Sachs | 13.852 | (2.181) | Latham Group Inc | HSBC | 3.641 |
| 598 | Lam Research Corp | HSBC | 21.331 | (9.345) | Latham Group Inc | Morgan Stanley | 1.175 |
| 1.576 | Lam Research Corp | Morgan Stanley | 50.113 | (19.121) | Latham Group Inc | Bank of America | |
| 1.324 | Lamar Advertising Co 'A' (REIT) | Bank of America | | (1.466) | Latham Group Inc | Merrill Lynch | 2.203 |
| | | Merrill Lynch | 4.008 | 1.561 | Lattice Semiconductor Corp | Barclays Bank | 2.056 |
| 2.688 | Lamar Advertising Co 'A' (REIT) | Barclays Bank | 2.876 | 15.749 | Lattice Semiconductor Corp | Barclays Bank | 44.412 |
| (3.878) | Lamar Advertising Co 'A' (REIT) | Barclays Bank | 2.876 | 39.791 | Lattice Semiconductor Corp | Goldman Sachs | 154.390 |
| 4.185 | Lamar Advertising Co 'A' (REIT) | Goldman Sachs | 3.723 | 20.674 | Lattice Semiconductor Corp | HSBC | 144.925 |
| (3.010) | Lamar Advertising Co 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (2.483) | 7.914 | Lattice Semiconductor Corp | Morgan Stanley | 22.317 |
| 1.260 | Lamar Advertising Co 'A' (REIT) | HSBC | 181 | 6.244 | Laureate Education Inc | Bank of America | |
| 2.688 | Lamar Advertising Co 'A' (REIT) | HSBC | (978) | 7.126 | Laureate Education Inc | Merrill Lynch | 7.586 |
| | | Morgan Stanley | 2.876 | 59.243 | Laureate Education Inc | Barclays Bank | 2.387 |
| (10.850) | Lamb Weston Holdings Inc | Bank of America | | 34.073 | Laureate Education Inc | Goldman Sachs | 70.260 |
| | | Merrill Lynch | (50.312) | (10.779) | Lazard Ltd 'A' | HSBC | 48.554 |
| (7.137) | Lamb Weston Holdings Inc | Goldman Sachs | (30.434) | (38.179) | Lazard Ltd 'A' | Bank of America | |
| (5.071) | Lamb Weston Holdings Inc | HSBC | (22.924) | (17.264) | Lazard Ltd 'A' | Merrill Lynch | (30.073) |
| (5.970) | Lamb Weston Holdings Inc | Morgan Stanley | (21.552) | (4.400) | Lazard Ltd 'A' | Barclays Bank | (53.832) |
| 5.250 | Lancaster Colony Corp | Barclays Bank | (13.755) | 5.627 | La-Z-Boy Inc | Goldman Sachs | (48.167) |
| 8.344 | Lancaster Colony Corp | Goldman Sachs | (109.640) | 16.850 | La-Z-Boy Inc | Morgan Stanley | (6.204) |
| | | | | 11.893 | La-Z-Boy Inc | Bank of America | |
| | | | | 18.097 | La-Z-Boy Inc | Merrill Lynch | (4.558) |
| | | | | | | Barclays Bank | 23.590 |
| | | | | | | Goldman Sachs | (11.275) |
| | | | | | | HSBC | (29.591) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------|-----------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 5.633 | La-Z-Boy Inc | Morgan Stanley | 7.886 | 14.323 | Lennox International Inc | Barclays Bank | 10.599 |
| (3.036) | Lazydays Holdings Inc | Bank of America | | 5.688 | Lennox International Inc | Goldman Sachs | (51.362) |
| | | Merrill Lynch | 3.267 | 1.732 | Lennox International Inc | HSBC | (17.528) |
| (6.617) | Lazydays Holdings Inc | Barclays Bank | (2.316) | 1.258 | Lennox International Inc | Morgan Stanley | 931 |
| (17.191) | Lazydays Holdings Inc | Goldman Sachs | 44.525 | (22.250) | LENSAR Inc | Bank of America | |
| (4.229) | Lazydays Holdings Inc | HSBC | 14.421 | | | Merrill Lynch | 14.240 |
| 240 | LCI Industries | Bank of America | | (586) | LENSAR Inc | Barclays Bank | 328 |
| | | Merrill Lynch | 1.914 | (1.462) | LENSAR Inc | Goldman Sachs | 936 |
| 7.367 | LCI Industries | Barclays Bank | 52.969 | (7.457) | LENSAR Inc | HSBC | 3.952 |
| 2.319 | LCI Industries | HSBC | 17.903 | (10.755) | LENSAR Inc | Morgan Stanley | 6.023 |
| 11.046 | LCNB Corp | Barclays Bank | 4.860 | (5.605) | Leslie's Inc | Bank of America | |
| 3.206 | LCNB Corp | Goldman Sachs | 737 | | | Merrill Lynch | (4.599) |
| 4.094 | LCNB Corp | HSBC | (205) | (4.716) | Leslie's Inc | Barclays Bank | (2.594) |
| 7.441 | LCNB Corp | Morgan Stanley | 3.274 | (14.280) | Leslie's Inc | Goldman Sachs | (10.382) |
| 3.573 | Lear Corp | Bank of America | | (7.605) | Leslie's Inc | HSBC | (2.844) |
| | | Merrill Lynch | 38.482 | (5.427) | Leslie's Inc | Morgan Stanley | (3.806) |
| 5.726 | Lear Corp | Barclays Bank | 36.201 | 26.463 | Levi Strauss & Co 'A' | Barclays Bank | 40.224 |
| 5.221 | Lear Corp | Goldman Sachs | 56.230 | 42.172 | Levi Strauss & Co 'A' | Goldman Sachs | 28.665 |
| 6.441 | Lear Corp | HSBC | 69.692 | 26.579 | Levi Strauss & Co 'A' | HSBC | 26.640 |
| 4.753 | Lear Corp | Morgan Stanley | 36.180 | 2.939 | Levi Strauss & Co 'A' | Morgan Stanley | 4.951 |
| 567 | Lee Enterprises Inc | Goldman Sachs | 454 | (3.374) | Lexicon | Bank of America | |
| 1.660 | Lee Enterprises Inc | HSBC | 4.465 | | Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | (101) |
| 592 | Lee Enterprises Inc | Morgan Stanley | 408 | (2.606) | Lexicon | | |
| (5.079) | Legacy Housing Corp | Barclays Bank | 7.060 | | Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (104) |
| (4.267) | Legacy Housing Corp | Goldman Sachs | 7.254 | (22.877) | Lexicon | | |
| (4.074) | Legacy Housing Corp | HSBC | 8.311 | | Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (686) |
| (32.833) | Legalzoom.com Inc | Barclays Bank | (64.024) | (16.282) | Lexicon | | |
| (7.312) | Legalzoom.com Inc | Goldman Sachs | (13.381) | | Pharmaceuticals Inc | HSBC | (651) |
| (1.599) | Leggett & Platt Inc | Bank of America | | (6.000) | Lexicon | | |
| | | Merrill Lynch | (2.670) | | Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (240) |
| 1.278 | Leggett & Platt Inc | Bank of America | | (1.780) | LGI Homes Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.192) | | | Merrill Lynch | 3.880 |
| (20.396) | Leggett & Platt Inc | Barclays Bank | (35.489) | (6.265) | LGI Homes Inc | Barclays Bank | (23.618) |
| (14.519) | Leggett & Platt Inc | Goldman Sachs | (24.247) | (6.478) | LGI Homes Inc | Goldman Sachs | 14.122 |
| 12.517 | Leggett & Platt Inc | Goldman Sachs | 20.903 | (21.456) | LGI Homes Inc | HSBC | 25.962 |
| (23.803) | Leggett & Platt Inc | HSBC | (43.321) | (4.162) | LGI Homes Inc | Morgan Stanley | (15.691) |
| 10.212 | Leggett & Platt Inc | HSBC | 12.246 | (2.647) | Liberty Broadband Corp 'A' | Bank of America | |
| (2.731) | Leggett & Platt Inc | Morgan Stanley | (4.752) | | | Merrill Lynch | (26.417) |
| 1.414 | Leggett & Platt Inc | Morgan Stanley | 2.460 | (7.545) | Liberty Broadband Corp 'A' | Barclays Bank | (55.154) |
| (245) | Leidos Holdings Inc | Bank of America | | (7.207) | Liberty Broadband Corp 'A' | Goldman Sachs | (69.986) |
| | | Merrill Lynch | (449) | (12.430) | Liberty Broadband Corp 'A' | HSBC | (132.422) |
| (936) | Leidos Holdings Inc | Barclays Bank | (2.050) | (1.844) | Liberty Broadband Corp 'A' | Morgan Stanley | (13.480) |
| 5.418 | Leidos Holdings Inc | Barclays Bank | 11.865 | (436) | Liberty Broadband Corp 'C' | Bank of America | |
| 5.024 | Leidos Holdings Inc | Goldman Sachs | 14.919 | | | Merrill Lynch | (3.793) |
| (4.240) | Leidos Holdings Inc | Morgan Stanley | (9.286) | (7.941) | Liberty Broadband Corp 'C' | Barclays Bank | (49.472) |
| (10.480) | LeMaitre Vascular Inc | Barclays Bank | (5.659) | (2.920) | Liberty Broadband Corp 'C' | Goldman Sachs | (25.404) |
| (11.258) | LeMaitre Vascular Inc | Goldman Sachs | (14.298) | (1.688) | Liberty Broadband Corp 'C' | HSBC | (16.998) |
| (4.676) | LeMaitre Vascular Inc | HSBC | (27.214) | (13.401) | Liberty Broadband Corp 'C' | Morgan Stanley | (83.488) |
| 7.480 | Lemonade Inc | Bank of America | | 26.447 | Liberty Global Plc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 21.242 | | | Merrill Lynch | 48.398 |
| 5.212 | Lemonade Inc | Barclays Bank | 8.652 | 59.849 | Liberty Global Plc 'A' | Barclays Bank | 101.743 |
| 2.169 | Lemonade Inc | Goldman Sachs | 6.615 | 29.031 | Liberty Global Plc 'A' | Goldman Sachs | 53.127 |
| 2.960 | Lemonade Inc | HSBC | 11.514 | 29.016 | Liberty Global Plc 'A' | HSBC | 89.184 |
| 1.273 | Lemonade Inc | Morgan Stanley | 2.113 | 42.141 | Liberty Global Plc 'A' | Morgan Stanley | 71.640 |
| 2.018 | LendingClub Corp | Bank of America | | 18.664 | Liberty Latin America Ltd 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 4.392 | | | Merrill Lynch | 14.371 |
| 9.333 | LendingClub Corp | Goldman Sachs | 18.293 | 5.113 | Liberty Latin America Ltd 'A' | Barclays Bank | 2.505 |
| 2.829 | LendingClub Corp | HSBC | 6.970 | 48.876 | Liberty Latin America Ltd 'A' | Goldman Sachs | 37.635 |
| 4.086 | LendingClub Corp | Morgan Stanley | 8.540 | 10.095 | Liberty Latin America Ltd 'A' | HSBC | 18.474 |
| 1.076 | LendingTree Inc | Bank of America | | 14.180 | Liberty Latin America Ltd 'A' | Morgan Stanley | 6.948 |
| | | Merrill Lynch | 611 | (35.591) | Liberty Latin America Ltd 'C' | Barclays Bank | (20.999) |
| 3.945 | LendingTree Inc | Barclays Bank | 7.417 | (14.525) | Liberty Latin America Ltd 'C' | HSBC | (26.833) |
| 5.962 | LendingTree Inc | Goldman Sachs | (3.473) | (1.690) | Liberty Media Corp-Liberty | | |
| 1.825 | LendingTree Inc | HSBC | (6.466) | | Braves 'A' | Barclays Bank | (62) |
| 27.842 | Lennar Corp 'A' | Barclays Bank | 163.155 | (9.229) | Liberty Media Corp-Liberty | | |
| 30.557 | Lennar Corp 'A' | Goldman Sachs | 142.652 | | Braves 'A' | Goldman Sachs | 1.903 |
| 29.012 | Lennar Corp 'A' | HSBC | 82.990 | (8.944) | Liberty Media Corp-Liberty | | |
| 20.123 | Lennar Corp 'A' | Morgan Stanley | 117.921 | | Braves 'C' | Barclays Bank | 1.789 |
| 1.466 | Lennox International Inc | Bank of America | | (28.669) | Liberty Media Corp-Liberty | | |
| | | Merrill Lynch | (13.942) | | Braves 'C' | Goldman Sachs | — |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|-----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (27.952) | Liberty Media Corp-Liberty Braves 'C' | Morgan Stanley | 5.590 | (19.090) | Limoneira Co | Bank of America | (12.027) |
| (3.001) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A' | Bank of America | (5.612) | (22.503) | Limoneira Co | Merrill Lynch | (7.876) |
| (4.029) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A' | Merrill Lynch | (6.164) | (32.348) | Limoneira Co | Barclays Bank | (20.379) |
| 461 | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A' | Barclays Bank | 705 | (10.711) | Limoneira Co | Goldman Sachs | (8.033) |
| (11.211) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A' | Barclays Bank | (20.965) | (16.433) | Limoneira Co | HSBC | (5.752) |
| (6.076) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A' | Barclays Bank | (36.517) | 17.702 | Lincoln Educational Services Corp | Morgan Stanley | (5.752) |
| (15.169) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Barclays Bank | (17.540) | 10.070 | Lincoln Educational Services Corp | Bank of America | 14.339 |
| (26.525) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Barclays Bank | (59.732) | 31.287 | Lincoln Educational Services Corp | Merrill Lynch | 8.157 |
| (27.382) | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | Goldman Sachs | (23.822) | 13.660 | Lincoln Educational Services Corp | Goldman Sachs | (5.945) |
| 2.473 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | HSBC | 2.152 | (4.193) | Lincoln Electric Holdings Inc | HSBC | 12.977 |
| (44.048) | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | Barclays Bank | (118.930) | (6.233) | Lincoln Electric Holdings Inc | Morgan Stanley | (3.941) |
| 3.075 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | Barclays Bank | 6.605 | (1.629) | Lincoln Electric Holdings Inc | Bank of America | (5.859) |
| (7.323) | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | HSBC | (6.371) | 11.078 | Lincoln Electric Holdings Inc | Merrill Lynch | 3.111 |
| (5.285) | Liberty Oilfield Services Inc 'A' | Barclays Bank | (4.651) | (1.114) | Lincoln Electric Holdings Inc | HSBC | (21.159) |
| (11.905) | Liberty Oilfield Services Inc 'A' | Barclays Bank | (21.072) | 2.397 | Lincoln National Corp | Morgan Stanley | (4.590) |
| (2.008) | Liberty Oilfield Services Inc 'A' | Goldman Sachs | (4.923) | 21.791 | Lincoln National Corp | Bank of America | 10.841 |
| (7.409) | Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A' | HSBC | 704 | 32.303 | Lincoln National Corp | Merrill Lynch | 82.370 |
| (16.329) | Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A' | HSBC | 2.694 | 21.526 | Lincoln National Corp | Barclays Bank | 129.265 |
| (25.874) | Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.717 | 6.917 | Lincoln National Corp | Goldman Sachs | 53.155 |
| 4.034 | Life Storage Inc (REIT) | Barclays Bank | 97.171 | (29.246) | Lindblad Expeditions Holdings Inc | HSBC | 26.146 |
| 19.994 | Life Storage Inc (REIT) | Barclays Bank | 23.787 | (3.783) | Lindblad Expeditions Holdings Inc | Barclays Bank | (51.765) |
| 12.998 | Life Storage Inc (REIT) | Goldman Sachs | 16.952 | 4.716 | Linde Plc | Goldman Sachs | (7.679) |
| 2.938 | Life Storage Inc (REIT) | HSBC | 7.381 | 8.787 | Linde Plc | Barclays Bank | 17.308 |
| 9.586 | Life Time Group Holdings Inc | Barclays Bank | (1.305) | 9.518 | Linde Plc | Goldman Sachs | 87.480 |
| (6.212) | LifeMD Inc | Bank of America | (271) | 1.874 | Lindsay Corp | HSBC | 226.718 |
| (13.528) | LifeMD Inc | Merrill Lynch | 129 | 2.049 | Lindsay Corp | Morgan Stanley | 6.878 |
| 12.856 | LifeStance Health Group Inc | Barclays Bank | 4.906 | 4.864 | Lindsay Corp | Bank of America | 2.084 |
| 4.420 | LifeStance Health Group Inc | Barclays Bank | (10) | 2.668 | Lindsay Corp | Merrill Lynch | 1.751 |
| 504 | Lifetime Brands Inc | Goldman Sachs | 4.730 | 854 | Lindsay Corp | Barclays Bank | 1.751 |
| 8.600 | Lifetime Brands Inc | Bank of America | 9.383 | 1.426 | Lindsay Corp | Goldman Sachs | (943) |
| 17.060 | Lifetime Brands Inc | Merrill Lynch | 170 | (63.597) | Lineage Cell Therapeutics Inc | HSBC | 1.068 |
| 1.541 | Lifevantage Corp | Barclays Bank | 5.442 | (35.893) | Lineage Cell Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 213 |
| 32.012 | Lifevantage Corp | Barclays Bank | 2.698 | 4.137 | Lions Gate Entertainment Corp 'A' | Bank of America | (2.513) |
| (2.322) | Ligand Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | (4.992) | 25.606 | Lions Gate Entertainment Corp 'A' | Bank of America | (6.702) |
| (2.534) | Ligand Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (13.608) | 11.486 | Lions Gate Entertainment Corp 'A' | Merrill Lynch | (55.309) |
| (505) | Ligand Pharmaceuticals Inc | HSBC | (3.858) | 4.101 | Lions Gate Entertainment Corp 'A' | Barclays Bank | (55.309) |
| (1.212) | Ligand Pharmaceuticals Inc | HSBC | (6.508) | (2.445) | Lions Gate Entertainment Corp 'B' | Goldman Sachs | (18.607) |
| 11.278 | Lightning eMotors Inc | Morgan Stanley | 1.353 | (1.190) | Lions Gate Entertainment Corp 'B' | Goldman Sachs | (18.607) |
| 5.755 | Lightning eMotors Inc | Barclays Bank | 691 | (7.565) | Lions Gate Entertainment Corp 'B' | HSBC | (8.858) |
| (4.001) | Lightwave Logic Inc | Barclays Bank | (840) | (12.478) | Lions Gate Entertainment Corp 'B' | Bank of America | (8.858) |
| (4.736) | Limelight Networks Inc | Barclays Bank | (521) | (11.499) | Liquidia Corp | Bank of America | 3.594 |
| (6.813) | Limelight Networks Inc | Barclays Bank | (2.385) | (30.118) | Liquidia Corp | Merrill Lynch | 2.356 |
| (23.382) | Limelight Networks Inc | Goldman Sachs | (8.184) | (3.848) | Liquidia Corp | Barclays Bank | 11.121 |
| (366) | Limestone Bancorp Inc | HSBC | (399) | 1.791 | Liquidity Services Inc | Goldman Sachs | 37.684 |
| (7.224) | Limestone Bancorp Inc | Barclays Bank | (433) | 957 | Liquidity Services Inc | Barclays Bank | 7.129 |
| | | Goldman Sachs | | 3.968 | Liquidity Services Inc | Goldman Sachs | 47.888 |
| | | | | 386 | Lithia Motors Inc | Morgan Stanley | 2.386 |
| | | | | 1.884 | Lithia Motors Inc | Barclays Bank | (197) |
| | | | | 1.964 | Lithia Motors Inc | Goldman Sachs | 57 |
| | | | | | Lithia Motors Inc | Morgan Stanley | (436) |
| | | | | | Lithia Motors Inc | Bank of America | (1.576) |
| | | | | | Lithia Motors Inc | Merrill Lynch | 28.917 |
| | | | | | Lithia Motors Inc | Barclays Bank | 6.422 |
| | | | | | Lithia Motors Inc | Goldman Sachs | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 235 | Lithia Motors Inc | HSBC | 3.466 | (24.441) | Loews Corp | HSBC | (57.192) |
| 1.417 | Lithia Motors Inc | Morgan Stanley | 26.994 | (3.536) | Loews Corp | Morgan Stanley | (4.435) |
| (704) | Littelfuse Inc | Bank of America | | 3.018 | LogicBio Therapeutics Inc | Barclays Bank | 59 |
| | | Merrill Lynch | (3.133) | 4.588 | LogicBio Therapeutics Inc | HSBC | (859) |
| 867 | Littelfuse Inc | Barclays Bank | 1.734 | 1.235 | LogicBio Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 24 |
| (587) | Littelfuse Inc | Barclays Bank | (1.174) | (24.338) | Lordstown Motors Corp 'A' | Bank of America | |
| 4.860 | Littelfuse Inc | Goldman Sachs | 21.627 | | Merrill Lynch | | 7.788 |
| (442) | Littelfuse Inc | Goldman Sachs | (1.967) | (26.875) | Lordstown Motors Corp 'A' | Barclays Bank | 3.494 |
| 97 | Littelfuse Inc | HSBC | (352) | (4.925) | Lordstown Motors Corp 'A' | Goldman Sachs | 1.576 |
| (155) | Littelfuse Inc | HSBC | (2.007) | (3.156) | Lordstown Motors Corp 'A' | Morgan Stanley | 410 |
| (810) | Littelfuse Inc | Morgan Stanley | (1.620) | 2.429 | Louisiana-Pacific Corp | Bank of America | |
| 4.814 | LivaNova Plc | Bank of America | | | Merrill Lynch | | 2.891 |
| | | Merrill Lynch | 2.239 | (4.109) | Louisiana-Pacific Corp | Barclays Bank | (17.751) |
| 3.683 | LivaNova Plc | Barclays Bank | 3.223 | (4.075) | Louisiana-Pacific Corp | Goldman Sachs | (7.430) |
| 2.137 | LivaNova Plc | Goldman Sachs | 994 | (6.314) | Louisiana-Pacific Corp | HSBC | 27.327 |
| 7.108 | LivaNova Plc | HSBC | 50.502 | (10.476) | Louisiana-Pacific Corp | Morgan Stanley | (45.256) |
| 4.683 | Live Nation Entertainment Inc | Bank of America | | (1.934) | Lovesac Co | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 38.278 | | Merrill Lynch | | 3.945 |
| 314 | Live Nation Entertainment Inc | Barclays Bank | 1.573 | (1.304) | Lovesac Co | Barclays Bank | (4.955) |
| | | | | (840) | Lovesac Co | Goldman Sachs | 1.714 |
| 4.649 | Live Nation Entertainment Inc | Goldman Sachs | 33.798 | (4.466) | Lovesac Co | HSBC | 26.284 |
| 11.265 | Live Nation Entertainment Inc | HSBC | 94.278 | (390) | Lowe's Cos Inc | Bank of America | |
| | | | | 7.558 | Lowe's Cos Inc | Merrill Lynch | 1.066 |
| 3.608 | Live Nation Entertainment Inc | Morgan Stanley | 18.076 | (1.086) | Lowe's Cos Inc | Barclays Bank | 70.516 |
| | | Bank of America | | 4.102 | Lowe's Cos Inc | Goldman Sachs | (520) |
| (660) | Live Oak Bancshares Inc | Merrill Lynch | (1.214) | (3.618) | Lowe's Cos Inc | Goldman Sachs | 7.312 |
| | | Barclays Bank | (15.221) | (1.565) | Lowe's Cos Inc | HSBC | (39.725) |
| (6.735) | Live Oak Bancshares Inc | Goldman Sachs | (15.211) | 1.152 | Loyalty Ventures Inc | Morgan Stanley | (12.063) |
| (8.267) | Live Oak Bancshares Inc | HSBC | 5.959 | (8.001) | Loyalty Ventures Inc | Barclays Bank | (864) |
| (2.069) | Live Oak Bancshares Inc | Morgan Stanley | (4.699) | 6.597 | Loyalty Ventures Inc | Barclays Bank | 6.001 |
| (2.079) | Live Oak Bancshares Inc | Bank of America | | (8.502) | Loyalty Ventures Inc | Goldman Sachs | (2.771) |
| (326) | Livent Corp | Merrill Lynch | (2.070) | 6.373 | Loyalty Ventures Inc | Goldman Sachs | 3.571 |
| | | Barclays Bank | (51.819) | (3.139) | Loyalty Ventures Inc | HSBC | 2.358 |
| (16.662) | Livent Corp | Goldman Sachs | (47.441) | (2.601) | Loyalty Ventures Inc | HSBC | (1.161) |
| (7.471) | Livent Corp | HSBC | (130.003) | (580) | LPL Financial Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.951 |
| (26.464) | Livent Corp | | | | Merrill Lynch | Bank of America | |
| 22.828 | LiveOne Inc | Goldman Sachs | 3.196 | 439 | LPL Financial Holdings Inc | Merrill Lynch | (3.109) |
| 8.890 | LiveOne Inc | Morgan Stanley | 685 | | Merrill Lynch | Bank of America | |
| 1.349 | LivePerson Inc | Bank of America | | 795 | LPL Financial Holdings Inc | Barclays Bank | 10.098 |
| | | Merrill Lynch | 189 | (6.658) | LPL Financial Holdings Inc | Barclays Bank | 12.903 |
| 25.902 | LivePerson Inc | Barclays Bank | 20.204 | 1.219 | LPL Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | (195.013) |
| 8.526 | LivePerson Inc | Goldman Sachs | 1.194 | 16.001 | LSI Industries Inc | Morgan Stanley | 19.784 |
| 7.050 | LivePerson Inc | HSBC | (3.274) | 5.432 | LSI Industries Inc | Barclays Bank | 1.600 |
| 2.608 | LivePerson Inc | Morgan Stanley | 2.034 | 6.085 | LSI Industries Inc | Goldman Sachs | (760) |
| 2.468 | LiveRamp Holdings Inc | Bank of America | | 9.367 | LSI Industries Inc | HSBC | (2.251) |
| | | Merrill Lynch | 1.678 | (79.594) | LTC Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 937 |
| 15.355 | LiveRamp Holdings Inc | Barclays Bank | 15.048 | (10.129) | LTC Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (101.880) |
| 18.804 | LiveRamp Holdings Inc | Goldman Sachs | 11.096 | 4.016 | Lucira Health Inc | Morgan Stanley | (12.965) |
| 4.253 | LiveRamp Holdings Inc | HSBC | 3.514 | 4.133 | Lucira Health Inc | Barclays Bank | (161) |
| 2.692 | LiveRamp Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.638 | (1.110) | Lululemon Athletica Inc | HSBC | (2.025) |
| (21.190) | LKQ Corp | Barclays Bank | (46.618) | (585) | Lululemon Athletica Inc | Barclays Bank | (23.165) |
| (23.004) | LKQ Corp | Goldman Sachs | (12.883) | (2.235) | Lululemon Athletica Inc | HSBC | (327) |
| (2.135) | LKQ Corp | HSBC | 1.885 | (7.465) | Lulu's Fashion Lounge Holdings Inc | Morgan Stanley | (46.644) |
| (1.821) | LL Flooring Holdings Inc | Bank of America | | | Holdings Inc | Goldman Sachs | (71.888) |
| | | Merrill Lynch | (23) | 1.025 | Lumen Technologies Inc | Bank of America | |
| (7.781) | LL Flooring Holdings Inc | Barclays Bank | (9.726) | (13.077) | Lumen Technologies Inc | Merrill Lynch | 738 |
| (29.582) | LL Flooring Holdings Inc | Goldman Sachs | (32.887) | | Merrill Lynch | Bank of America | |
| (2.652) | LL Flooring Holdings Inc | HSBC | 318 | 22.734 | Lumen Technologies Inc | Merrill Lynch | (6.516) |
| 17.169 | loanDepot Inc 'A' | Barclays Bank | 172 | (15.366) | Lumen Technologies Inc | Barclays Bank | 21.370 |
| 6.664 | loanDepot Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.599 | (15.745) | Lumen Technologies Inc | Barclays Bank | (14.444) |
| 8.148 | loanDepot Inc 'A' | HSBC | 489 | 61.878 | Lumen Technologies Inc | Goldman Sachs | (11.336) |
| 535 | loanDepot Inc 'A' | Morgan Stanley | 5 | 14.670 | Lumen Technologies Inc | HSBC | 76.729 |
| 7.482 | Local Bounti Corp | Barclays Bank | 1.571 | (7.865) | Lumen Technologies Inc | Morgan Stanley | 13.790 |
| 23.856 | Local Bounti Corp | Goldman Sachs | (7.634) | (1.537) | Lumentum Holdings Inc | Morgan Stanley | (7.393) |
| 31.756 | Local Bounti Corp | HSBC | 6.986 | (11.447) | Lumentum Holdings Inc | Barclays Bank | 1.691 |
| (1.823) | Loews Corp | Bank of America | | 1.601 | Lumentum Holdings Inc | Goldman Sachs | 13.736 |
| | | Merrill Lynch | (4.229) | (3.149) | Lumentum Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.921) |
| (58.329) | Loews Corp | Barclays Bank | (76.220) | | Lumentum Holdings Inc | HSBC | 3.275 |
| (78.607) | Loews Corp | Goldman Sachs | (182.368) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.731 | Lumentum Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.904) | 3.497 | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | HSBC | 14.722 |
| (109.616) | Luminar Technologies Inc | Barclays Bank | (41.654) | (2.091) | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | HSBC | (11.175) |
| (1.800) | Lumos Pharma Inc | Bank of America | | (20.749) | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Morgan Stanley | (48.553) |
| (9.318) | Lumos Pharma Inc | Merrill Lynch | (288) | (20.174) | Macquarie Infrastructure Holdings LLC | Barclays Bank | — |
| (10) | Lumos Pharma Inc | Barclays Bank | 3.261 | 10.698 | MacroGenics Inc | Bank of America | |
| (23.874) | Luna Innovations Inc | Goldman Sachs | (2) | 31.177 | MacroGenics Inc | Merrill Lynch | (7.629) |
| (45.087) | Luna Innovations Inc | Bank of America | (10.505) | 15.168 | MacroGenics Inc | Barclays Bank | (11.867) |
| (52.708) | Luna Innovations Inc | Merrill Lynch | (18.937) | 15.985 | MacroGenics Inc | Goldman Sachs | (9.708) |
| (47.066) | Luna Innovations Inc | Barclays Bank | (23.192) | 6.903 | MacroGenics Inc | HSBC | (12.308) |
| (12.954) | Luna Innovations Inc | HSBC | (48.007) | (18.305) | Macy's Inc | Morgan Stanley | (3.244) |
| 48.599 | Luther Burbank Corp | Morgan Stanley | (5.441) | 5.447 | Macy's Inc | Bank of America | |
| 10.292 | Luther Burbank Corp | Bank of America | | (9.830) | Macy's Inc | Merrill Lynch | 11.983 |
| 21.960 | Luther Burbank Corp | Merrill Lynch | 21.870 | (29.960) | Macy's Inc | Barclays Bank | (46.693) |
| 7.686 | Luther Burbank Corp | Barclays Bank | 2.985 | 10.104 | Macy's Inc | Goldman Sachs | 22.229 |
| 20.468 | Luther Burbank Corp | Goldman Sachs | 9.882 | (7.758) | Macy's Inc | HSBC | (5.741) |
| (5.073) | Luxfer Holdings Plc | HSBC | 461 | 11.032 | Macy's Inc | HSBC | 9.975 |
| (6.387) | Luxfer Holdings Plc | Morgan Stanley | (6.392) | (3.488) | Macy's Inc | Morgan Stanley | (16.568) |
| (1.187) | Luxfer Holdings Plc | Bank of America | | 1.797 | Macy's Inc | Morgan Stanley | 8.536 |
| (10.310) | Luxfer Holdings Plc | Merrill Lynch | (61) | (7.867) | Madison Square Garden Sports Corp | Barclays Bank | 14.082 |
| 3.064 | LXP Industrial Trust (REIT) | Barclays Bank | (6.599) | (3.473) | Madison Square Garden Sports Corp | Goldman Sachs | (35.031) |
| (24.442) | LXP Industrial Trust (REIT) | Goldman Sachs | 607 | (833) | Madison Square Garden Sports Corp | Morgan Stanley | 1.491 |
| (30.341) | LXP Industrial Trust (REIT) | Goldman Sachs | 2.740 | (309) | Madrigal Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (74) |
| 8.644 | LXP Industrial Trust (REIT) | HSBC | (3.598) | (1.125) | Madrigal Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 23 |
| (13.327) | LXP Industrial Trust (REIT) | HSBC | 9.024 | (1.672) | Madrigal Pharmaceuticals Inc | HSBC | (10.993) |
| 31.906 | LXP Industrial Trust (REIT) | Morgan Stanley | (8.601) | 8.377 | Magenta Therapeutics Inc | Barclays Bank | (377) |
| (31.854) | LXP Industrial Trust (REIT) | Morgan Stanley | 3.325 | 11.635 | Magenta Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 582 |
| 12.314 | LXP Industrial Trust (REIT) | HSBC | 4.789 | 2.673 | Magenta Therapeutics Inc | HSBC | 53 |
| (5.263) | Lyell Immunopharma Inc | Bank of America | | (9.033) | Magnite Inc | Bank of America | |
| (769) | Lyft Inc 'A' | Merrill Lynch | 1.192 | (26.850) | Magnite Inc | Merrill Lynch | (9.485) |
| (6.300) | Lyft Inc 'A' | HSBC | 6.426 | (5.173) | Magnite Inc | HSBC | (50.745) |
| 15.082 | Lyft Inc 'A' | HSBC | (15.384) | (61.468) | Magnolia Oil & Gas Corp 'A' | Morgan Stanley | (1.914) |
| (6.087) | Lyft Inc 'A' | Morgan Stanley | 15.948 | (64.676) | Magnolia Oil & Gas Corp 'A' | Barclays Bank | (183.174) |
| (7.037) | LyondellBasell Industries NV 'A' | Barclays Bank | (66.922) | (36.409) | Magnolia Oil & Gas Corp 'A' | Goldman Sachs | (304.624) |
| (8.514) | LyondellBasell Industries NV 'A' | Morgan Stanley | (80.968) | (24.711) | Magnolia Oil & Gas Corp 'A' | HSBC | (204.619) |
| (5.016) | M&T Bank Corp | Barclays Bank | (47.050) | (23.477) | Magnolia Oil & Gas Corp 'A' | Morgan Stanley | (73.639) |
| (4.334) | M&T Bank Corp | Goldman Sachs | (56.785) | (11.151) | Maiden Holdings Ltd | Barclays Bank | (7.043) |
| (10.169) | M&T Bank Corp | HSBC | (100.493) | (27.121) | Maiden Holdings Ltd | Goldman Sachs | (1.450) |
| (4.660) | M/I Homes Inc | Bank of America | | (2.659) | Maiden Holdings Ltd | HSBC | (3.797) |
| (7.434) | M/I Homes Inc | Merrill Lynch | (12.037) | (1.239) | MainStreet Bancshares Inc | Barclays Bank | 1.742 |
| (1.854) | M/I Homes Inc | Barclays Bank | (19.031) | (25.082) | MainStreet Bancshares Inc | Goldman Sachs | (19) |
| (13.489) | M/I Homes Inc | Goldman Sachs | (3.302) | 5.822 | Malibu Boats Inc 'A' | Morgan Stanley | 16.429 |
| (4.115) | M/I Homes Inc | HSBC | (10.456) | 4.474 | Malibu Boats Inc 'A' | Barclays Bank | 19.154 |
| 47.518 | Macatawa Bank Corp | Morgan Stanley | (8.000) | 6.207 | Malibu Boats Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.534) |
| 82.386 | Macatawa Bank Corp | Barclays Bank | 15.919 | (2.387) | Malvern Bancorp Inc | HSBC | 36.621 |
| 62.288 | Macatawa Bank Corp | Goldman Sachs | 17.713 | (1.994) | Malvern Bancorp Inc | Barclays Bank | (561) |
| 57.601 | Macatawa Bank Corp | HSBC | 12.146 | (10.216) | Malvern Bancorp Inc | Goldman Sachs | (688) |
| (4.276) | Macerich Co (REIT) | Morgan Stanley | 19.296 | 2.584 | Mammoth Energy Services Inc | HSBC | 868 |
| (8.769) | Macerich Co (REIT) | Barclays Bank | (812) | 13.963 | Mammoth Energy Services Inc | Barclays Bank | 439 |
| (27.874) | Macerich Co (REIT) | Goldman Sachs | 9.646 | 4.181 | Mammoth Energy Services Inc | HSBC | 3.630 |
| 4.179 | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | HSBC | 36.248 | (36.042) | Manhattan Associates Inc | Morgan Stanley | 711 |
| (451) | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Bank of America | | 8.578 | Manhattan Associates Inc | Goldman Sachs | (5.046) |
| 2.195 | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Merrill Lynch | (1.380) | 3.999 | Manhattan Associates Inc | Barclays Bank | 21.874 |
| (14.851) | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Barclays Bank | (34.751) | | | Goldman Sachs | 10.638 |
| (6.693) | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Goldman Sachs | (21.097) | | | | |
| 1.294 | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.960 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------|---|-----------------|---|----------|---|-----------------|---|
| | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | |
| 5.911 | Manhattan Associates Inc | HSBC | 15.250 | 1.621 | MarketAxess Holdings Inc | Bank of America | |
| 6.092 | Manhattan Associates Inc | Morgan Stanley | 15.535 | | | Merrill Lynch | 29.956 |
| 16.568 | Manitowoc Co Inc | Bank of America | | 746 | MarketAxess Holdings Inc | Barclays Bank | (4.827) |
| | | Merrill Lynch | 21.373 | 633 | MarketAxess Holdings Inc | Goldman Sachs | 11.698 |
| 19.840 | Manitowoc Co Inc | Barclays Bank | 19.642 | 669 | MarketAxess Holdings Inc | HSBC | 12.959 |
| 12.034 | Manitowoc Co Inc | Goldman Sachs | 15.524 | 1.450 | MarketAxess Holdings Inc | Morgan Stanley | (9.382) |
| 32.148 | Manitowoc Co Inc | HSBC | 45.107 | (43.078) | Markforged Holding Corp | Barclays Bank | 5.169 |
| 6.868 | Manitowoc Co Inc | Morgan Stanley | 6.799 | (42.200) | Markforged Holding Corp | HSBC | 16.458 |
| (7.631) | Manning & Napier Inc | Bank of America | | 25.557 | Marqeta Inc 'A' | Barclays Bank | 26.579 |
| | | Merrill Lynch | (3.587) | (3.465) | Marqeta Inc 'A' | Barclays Bank | (3.604) |
| (5.533) | Manning & Napier Inc | Barclays Bank | (2.877) | 3.376 | Marqeta Inc 'A' | Goldman Sachs | 6.955 |
| (20.125) | Manning & Napier Inc | HSBC | (1.651) | (14.322) | Marqeta Inc 'A' | Goldman Sachs | (29.503) |
| (9.480) | Manning & Napier Inc | Morgan Stanley | (4.930) | (3.354) | Marqeta Inc 'A' | HSBC | (11.940) |
| (13.941) | MannKind Corp | Barclays Bank | (3.346) | (5.166) | Marqeta Inc 'A' | Morgan Stanley | (5.373) |
| (68.127) | MannKind Corp | Goldman Sachs | (91.971) | 2.090 | Marriott International Inc 'A' | Barclays Bank | 25.749 |
| (9.681) | MannKind Corp | HSBC | (15.877) | 1.843 | Marriott International Inc 'A' | Goldman Sachs | 12.418 |
| 6.744 | ManpowerGroup Inc | Bank of America | | 3.993 | Marriott International Inc 'A' | HSBC | 25.675 |
| | | Merrill Lynch | (20.974) | 2.722 | Marriott International Inc 'A' | Morgan Stanley | 33.535 |
| 5.821 | ManpowerGroup Inc | Barclays Bank | (20.898) | 1.372 | Marriott Vacations Worldwide Corp | Barclays Bank | 9.522 |
| 4.852 | ManpowerGroup Inc | Goldman Sachs | (15.090) | 9.201 | Marriott Vacations Worldwide Corp | Goldman Sachs | 54.562 |
| 11.120 | ManpowerGroup Inc | HSBC | (79.952) | 4.661 | Marriott Vacations Worldwide Corp | HSBC | 60.686 |
| 5.290 | ManpowerGroup Inc | Morgan Stanley | (18.991) | 6.091 | Marriott Vacations Worldwide Corp | Morgan Stanley | 42.272 |
| (9.056) | Marathon Digital Holdings Inc | Bank of America | | 22.230 | Marsh & McLennan Cos Inc | Barclays Bank | 147.607 |
| (27.012) | Marathon Digital Holdings Inc | Merrill Lynch | (1.268) | 15.631 | Marsh & McLennan Cos Inc | Goldman Sachs | 8.157 |
| (12.535) | Marathon Digital Holdings Inc | Barclays Bank | (14.317) | 6.184 | Marsh & McLennan Cos Inc | HSBC | 43.936 |
| 5.438 | Marathon Oil Corp | Goldman Sachs | (1.755) | 490 | Marsh & McLennan Cos Inc | Morgan Stanley | 3.254 |
| | | Merrill Lynch | 24.362 | 67.098 | Marten Transport Ltd | Barclays Bank | (4.697) |
| 24.852 | Marathon Oil Corp | Barclays Bank | 107.609 | 54.642 | Marten Transport Ltd | Goldman Sachs | (13.661) |
| 139.794 | Marathon Oil Corp | Goldman Sachs | 626.277 | 2.916 | Martin Marietta Materials Inc | Bank of America | |
| 6.752 | Marathon Oil Corp | HSBC | 55.772 | 6.727 | Martin Marietta Materials Inc | Merrill Lynch | 33.389 |
| 11.566 | Marathon Oil Corp | Morgan Stanley | 50.081 | | | Barclays Bank | 31.482 |
| (37.980) | Marathon Petroleum Corp | Barclays Bank | (282.951) | 3.019 | Martin Marietta Materials Inc | Goldman Sachs | 36.512 |
| (41.427) | Marathon Petroleum Corp | Goldman Sachs | (326.859) | 5.373 | Martin Marietta Materials Inc | HSBC | 41.604 |
| (2.376) | Marathon Petroleum Corp | HSBC | (26.356) | 2.713 | Martin Marietta Materials Inc | Morgan Stanley | 12.697 |
| (4.464) | Marathon Petroleum Corp | Morgan Stanley | (30.814) | 858 | Marvell Technology Inc | Bank of America | |
| (4.029) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 3.303 |
| (8.596) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | Merrill Lynch | 242 | 4.452 | Marvell Technology Inc | Barclays Bank | 18.788 |
| (893) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | 29.742 | 3.325 | Marvell Technology Inc | Goldman Sachs | 7.422 |
| (3.044) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.806 | 19.970 | Marvell Technology Inc | HSBC | 109.711 |
| (2.715) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | HSBC | (6.652) | 6.090 | Marvell Technology Inc | Morgan Stanley | 25.699 |
| 1.057 | Marchex Inc 'B' | Morgan Stanley | 9.394 | 4.149 | Masco Corp | Bank of America | |
| | | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 6.748 |
| 56.414 | Marchex Inc 'B' | Merrill Lynch | (222) | 43.573 | Masco Corp | Barclays Bank | 71.895 |
| 43.305 | Marchex Inc 'B' | Goldman Sachs | (11.847) | 16.112 | Masco Corp | Goldman Sachs | 18.046 |
| 39.658 | Marcus & Millichap Inc | Morgan Stanley | (8.228) | 33.047 | Masco Corp | HSBC | 87.929 |
| (3.713) | Marcus Corp | Barclays Bank | 2.379 | 25.217 | Masco Corp | Morgan Stanley | 41.608 |
| (17.419) | Marcus Corp | Barclays Bank | (5.607) | 2.151 | Masimo Corp | Barclays Bank | 2.452 |
| (15.891) | Marine Products Corp | HSBC | (21.425) | 4.546 | Masimo Corp | HSBC | 104.285 |
| (4.270) | Marine Products Corp | Barclays Bank | (3.814) | (3.187) | Masonite International Corp | Barclays Bank | (17.879) |
| (4.752) | Marine Products Corp | Goldman Sachs | 2.818 | (10.673) | Masonite International Corp | Goldman Sachs | (78.340) |
| (8.372) | Marine Products Corp | HSBC | 2.091 | 2.607 | MasTec Inc | Bank of America | |
| 9.784 | MarineMax Inc | Morgan Stanley | (2.009) | | | Merrill Lynch | 15.720 |
| 937 | MarineMax Inc | Barclays Bank | 16.633 | 3.694 | MasTec Inc | Goldman Sachs | 22.275 |
| 6.404 | MarineMax Inc | HSBC | (3.476) | 13.413 | MasTec Inc | HSBC | 127.557 |
| (11.351) | Marinus Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 10.887 | 13.169 | MasTec Inc | Morgan Stanley | 60.709 |
| (305) | Markel Corp | Barclays Bank | 4.767 | 4.034 | Mastech Digital Inc | Bank of America | |
| | | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (2.420) |
| | | Merrill Lynch | (15.906) | 3.208 | Mastech Digital Inc | Barclays Bank | (962) |
| (2.242) | Markel Corp | Barclays Bank | (58.113) | 3.555 | Mastech Digital Inc | HSBC | (2.417) |
| (638) | Markel Corp | Goldman Sachs | (33.272) | 2.133 | Mastech Digital Inc | Morgan Stanley | (640) |
| (874) | Markel Corp | HSBC | (78.826) | (2.778) | Mastercard Inc 'A' | Barclays Bank | (24.516) |
| (1.528) | Markel Corp | Morgan Stanley | (39.606) | (4.660) | Mastercard Inc 'A' | Goldman Sachs | (119.125) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------|-----------------|---|---|-------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3.196) | Mastercard Inc 'A' | Morgan Stanley | (25.728) | 5.632 | MaxCyte Inc | Morgan Stanley | 113 |
| (3.787) | MasterCraft Boat Holdings Inc | Barclays Bank | (4.128) | (17.310) | Maximus Inc | Bank of America | (4.500) |
| (13.567) | MasterCraft Boat Holdings Inc | Goldman Sachs | 8.547 | (34.209) | Maximus Inc | Barclays Bank | (10.947) |
| (6.380) | MasterCraft Boat Holdings Inc | HSBC | 6.252 | (28.087) | Maximus Inc | Goldman Sachs | (7.302) |
| (9.542) | Matador Resources Co | Barclays Bank | (107.920) | (28.688) | Maximus Inc | HSBC | 77.744 |
| 19.788 | Matador Resources Co | Barclays Bank | 223.802 | (4.567) | Maximus Inc | Morgan Stanley | (1.461) |
| (7.824) | Matador Resources Co | Goldman Sachs | (112.353) | 6.734 | MaxLinear Inc | Bank of America | |
| 9.785 | Matador Resources Co | Goldman Sachs | 140.513 | 20.287 | MaxLinear Inc | Merrill Lynch | (12.727) |
| (17.591) | Matador Resources Co | HSBC | (298.116) | 16.026 | MaxLinear Inc | Barclays Bank | 25.968 |
| 5.760 | Matador Resources Co | HSBC | 96.678 | 12.354 | MaxLinear Inc | Goldman Sachs | (30.289) |
| (2.792) | Matador Resources Co | Morgan Stanley | (31.578) | 28.523 | MaxLinear Inc | HSBC | (20.672) |
| 1.030 | Match Group Inc | Bank of America | | 9.675 | Mayville Engineering Co Inc | Morgan Stanley | 36.509 |
| | | Merrill Lynch | 3.317 | | | Bank of America | |
| (11.794) | Match Group Inc | Goldman Sachs | (37.977) | 16.071 | Mayville Engineering Co Inc | Merrill Lynch | 7.526 |
| 821 | Match Group Inc | Goldman Sachs | 2.644 | 6.416 | Mayville Engineering Co Inc | Barclays Bank | 8.467 |
| (1.324) | Match Group Inc | HSBC | (10.936) | 10.084 | Mayville Engineering Co Inc | Goldman Sachs | 6.929 |
| 395 | Materion Corp | Bank of America | | 7.066 | Mayville Engineering Co Inc | HSBC | 6.555 |
| | | Merrill Lynch | 1.875 | (28.655) | MBIA Inc | Morgan Stanley | 3.250 |
| 416 | Materion Corp | Barclays Bank | 1.768 | 6.341 | McCormick & Co Inc | Morgan Stanley | (19.772) |
| 2.074 | Materion Corp | Goldman Sachs | 5.309 | | | Bank of America | |
| 553 | Materion Corp | HSBC | 2.032 | 32.493 | McCormick & Co Inc | Merrill Lynch | (15.066) |
| 537 | Materion Corp | Morgan Stanley | 1.795 | 34.718 | McCormick & Co Inc | Barclays Bank | (19.007) |
| 3.475 | Matrix Service Co | Bank of America | | 7.711 | McCormick & Co Inc | Goldman Sachs | (240.889) |
| | | Merrill Lynch | 3.684 | (687) | McDonald's Corp | HSBC | 10.761 |
| 9.654 | Matrix Service Co | Barclays Bank | 6.951 | (2.804) | McDonald's Corp | Bank of America | |
| 58.903 | Matrix Service Co | Goldman Sachs | 62.437 | (21.003) | McDonald's Corp | Merrill Lynch | (4.183) |
| 15.908 | Matrix Service Co | HSBC | (6.681) | (15.933) | McDonald's Corp | Barclays Bank | (34.012) |
| 22.684 | Matrix Service Co | Morgan Stanley | 16.332 | (957) | McDonald's Corp | Goldman Sachs | (127.908) |
| 588 | Matson Inc | Bank of America | | (9.967) | McGrath RentCorp | HSBC | (85.436) |
| | | Merrill Lynch | 3.021 | 1.069 | McKesson Corp | Morgan Stanley | (11.608) |
| (9.018) | Matson Inc | Barclays Bank | (31.834) | | | Barclays Bank | 1.595 |
| 8.302 | Matson Inc | Barclays Bank | 29.306 | 11.853 | McKesson Corp | Bank of America | |
| (4.165) | Matson Inc | Goldman Sachs | (12.079) | 9.012 | McKesson Corp | Merrill Lynch | 8.248 |
| (958) | Matson Inc | HSBC | (3.290) | 599 | McKesson Corp | Barclays Bank | 8.416 |
| (587) | Matson Inc | Morgan Stanley | (2.072) | 58.099 | MDC Holdings Inc | Goldman Sachs | 8.953 |
| 15.029 | Mattel Inc | Bank of America | | 30.190 | MDC Holdings Inc | HSBC | 5.689 |
| | | Merrill Lynch | (16.682) | 14.234 | MDC Holdings Inc | Barclays Bank | 117.941 |
| 6.969 | Mattel Inc | Barclays Bank | 10.663 | 30.190 | MDC Holdings Inc | Goldman Sachs | 27.775 |
| (6.076) | Mattel Inc | Barclays Bank | (9.296) | 14.234 | MDC Holdings Inc | HSBC | (712) |
| 4.390 | Mattel Inc | Goldman Sachs | (412) | 2.764 | MDC Holdings Inc | Morgan Stanley | 5.611 |
| (23.563) | Mattel Inc | Goldman Sachs | 4.861 | (12.667) | MDU Resources Group Inc | Bank of America | |
| (18.160) | Mattel Inc | HSBC | 678 | | | Merrill Lynch | (8.728) |
| 608 | Mattel Inc | Morgan Stanley | 930 | 4.591 | MDU Resources Group Inc | Bank of America | |
| (2.020) | Matthews International Corp 'A' | Bank of America | | (38.339) | MDU Resources Group Inc | Merrill Lynch | 3.030 |
| | | Merrill Lynch | (2.788) | 9.369 | MDU Resources Group Inc | Barclays Bank | (13.035) |
| (9.986) | Matthews International Corp 'A' | Barclays Bank | (10.885) | (4.421) | MDU Resources Group Inc | Goldman Sachs | 3.185 |
| (18.956) | Matthews International Corp 'A' | Goldman Sachs | (26.159) | 4.685 | MDU Resources Group Inc | Goldman Sachs | (984) |
| (21.613) | Matthews International Corp 'A' | HSBC | (36.310) | (37.734) | MDU Resources Group Inc | HSBC | 3.092 |
| (1.088) | Matthews International Corp 'A' | Morgan Stanley | (1.186) | 13.218 | MDU Resources Group Inc | HSBC | (47.126) |
| 15.957 | Maui Land & Pineapple Co Inc | Barclays Bank | (3.511) | (27.319) | MDU Resources Group Inc | Morgan Stanley | 25.956 |
| | | | | (15.260) | Medallion Financial Corp | Barclays Bank | (9.288) |
| 473 | Maui Land & Pineapple Co Inc | Morgan Stanley | (104) | (18.888) | Medallion Financial Corp | Goldman Sachs | (5.799) |
| (14.460) | Maxar Technologies Inc | Barclays Bank | (62.901) | 2.633 | MediaAlpha Inc 'A' | Bank of America | (1.700) |
| (9.127) | Maxar Technologies Inc | Goldman Sachs | (10.679) | 1.897 | MediaAlpha Inc 'A' | Merrill Lynch | 418 |
| (5.300) | Maxar Technologies Inc | HSBC | (7.367) | 2.202 | MediaAlpha Inc 'A' | Barclays Bank | 645 |
| 3.051 | MaxCyte Inc | Bank of America | | 13.775 | MediaAlpha Inc 'A' | Goldman Sachs | 624 |
| | | Merrill Lynch | 549 | 5.343 | MediaAlpha Inc 'A' | HSBC | (13.222) |
| 6.864 | MaxCyte Inc | Barclays Bank | 137 | (1.350) | Medical Properties Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 2.333 |
| 5.148 | MaxCyte Inc | Goldman Sachs | 927 | | | Bank of America | |
| 9.831 | MaxCyte Inc | HSBC | (2.065) | 5.188 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | Merrill Lynch | (515) |
| | | | | (1.416) | Medical Properties Trust Inc (REIT) | Bank of America | 2.335 |
| | | | | (46.670) | Medical Properties Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | (595) |
| | | | | | | Goldman Sachs | (21.261) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|-------------------------------------|-----------------|---|--|----------------------------------|-----------------|---|
| Verenigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Verenigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (18.096) | Medical Properties Trust Inc (REIT) | HSBC | (11.562) | 2.628 | Merit Medical Systems Inc | Morgan Stanley | 2.827 |
| 50.209 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | HSBC | 33.640 | (3.018) | Meritage Homes Corp | Bank of America | (5.857) |
| 976 | MediciNova Inc | HSBC | (59) | 1.883 | Meritage Homes Corp | Bank of America | 6.251 |
| 2.431 | Medifast Inc | Barclays Bank | 8.849 | (25.114) | Meritage Homes Corp | Barclays Bank | (133.286) |
| 3.034 | Medifast Inc | Goldman Sachs | 15.868 | 13.834 | Meritage Homes Corp | Barclays Bank | 73.182 |
| 345 | Medifast Inc | HSBC | (1.154) | (13.421) | Meritage Homes Corp | Goldman Sachs | (32.362) |
| 361 | Medifast Inc | Morgan Stanley | 3.822 | 4.331 | Meritage Homes Corp | Goldman Sachs | 12.260 |
| (19.773) | MEDNAX Inc | Barclays Bank | (17.203) | (20.467) | Meritage Homes Corp | HSBC | (50.756) |
| (7.220) | MEDNAX Inc | Goldman Sachs | (7.148) | 6.315 | Meritage Homes Corp | HSBC | 9.995 |
| 231 | Medpace Holdings Inc | Bank of America | | (7.063) | Meritage Homes Corp | Morgan Stanley | (37.363) |
| | | Merrill Lynch | 1.268 | 29.689 | Mersana Therapeutics Inc | Barclays Bank | (3.563) |
| 3.898 | Medpace Holdings Inc | Barclays Bank | 45.879 | 43.235 | Mersana Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 5.188 |
| 5.060 | Medpace Holdings Inc | Goldman Sachs | 27.780 | 18.737 | Mersana Therapeutics Inc | HSBC | 1.124 |
| (219) | Medpace Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.202) | (10.469) | Mesa Air Group Inc | Barclays Bank | (3.036) |
| 1.608 | Medpace Holdings Inc | HSBC | 23.509 | (9.526) | Mesa Air Group Inc | HSBC | (191) |
| (944) | Medpace Holdings Inc | HSBC | (13.801) | (23.696) | Mesa Air Group Inc | Morgan Stanley | (6.872) |
| 7.394 | Medtronic Plc | Bank of America | | (414) | Mesa Laboratories Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (21.062) | (2.100) | Mesa Laboratories Inc | Merrill Lynch | (2.857) |
| 11.461 | Medtronic Plc | Barclays Bank | (51.868) | (3.674) | Mesa Laboratories Inc | Barclays Bank | (16.716) |
| 13.700 | Medtronic Plc | Goldman Sachs | (54.800) | (1.939) | Mesa Laboratories Inc | Goldman Sachs | (25.351) |
| 14.663 | Medtronic Plc | HSBC | (35.845) | (65) | Mesa Laboratories Inc | HSBC | 5.003 |
| 5.317 | Medtronic Plc | Morgan Stanley | (11.207) | (5.701) | Meta Financial Group Inc | Morgan Stanley | (517) |
| 49.146 | MEI Pharma Inc | Barclays Bank | 722 | (18.503) | Meta Financial Group Inc | Bank of America | |
| 34.195 | MEI Pharma Inc | Goldman Sachs | (434) | (4.203) | Meta Financial Group Inc | Merrill Lynch | (15.393) |
| (17.147) | MeiraGTx Holdings Plc | Barclays Bank | (5.316) | (19.516) | Meta Financial Group Inc | Barclays Bank | (38.486) |
| 48 | MercadoLibre Inc | Bank of America | | (777) | Meta Platforms Inc 'A' | HSBC | (6.809) |
| | | Merrill Lynch | 172 | (3.067) | Meta Platforms Inc 'A' | Morgan Stanley | (40.593) |
| 1.080 | MercadoLibre Inc | Barclays Bank | 3.121 | (4.703) | Meta Platforms Inc 'A' | Bank of America | |
| 404 | MercadoLibre Inc | Goldman Sachs | 1.228 | (99) | Meta Platforms Inc 'A' | Merrill Lynch | 4.841 |
| 221 | MercadoLibre Inc | HSBC | 1.370 | (18.787) | Methode Electronics Inc | Goldman Sachs | 7.788 |
| 314 | MercadoLibre Inc | Morgan Stanley | 908 | (25.759) | Methode Electronics Inc | HSBC | 11.287 |
| 24.414 | Mercantile Bank Corp | Bank of America | | (16.622) | Methode Electronics Inc | Morgan Stanley | (1.003) |
| | | Merrill Lynch | 20.756 | 6.982 | MetLife Inc | Barclays Bank | (33.629) |
| 990 | Mercantile Bank Corp | Barclays Bank | 931 | 136.271 | MetLife Inc | Goldman Sachs | (3.091) |
| 8.602 | Mercantile Bank Corp | Goldman Sachs | 7.459 | 41.300 | MetLife Inc | HSBC | (14.461) |
| 5.450 | Mercantile Bank Corp | HSBC | 4.975 | 15.816 | MetLife Inc | Bank of America | |
| 3.978 | Mercantile Bank Corp | Morgan Stanley | 2.421 | 49.550 | MetLife Inc | Merrill Lynch | 24.856 |
| 31.435 | Merchants Bancorp | HSBC | 66.957 | (25.914) | Metrocity Bankshares Inc | Barclays Bank | 440.155 |
| 39.683 | Merchants Bancorp | Morgan Stanley | 37.699 | (17.328) | Metrocity Bankshares Inc | Goldman Sachs | 149.223 |
| 1.028 | Merck & Co Inc | Bank of America | | (10.748) | MetroMile Inc | HSBC | 37.527 |
| | | Merrill Lynch | (1.800) | (84.216) | MetroMile Inc | Morgan Stanley | 160.047 |
| 13.378 | Merck & Co Inc | Barclays Bank | (37.325) | (2.277) | Metropolitan Bank Holding Corp | Barclays Bank | (2.163) |
| 8.959 | Merck & Co Inc | Goldman Sachs | (11.468) | (14.754) | Metropolitan Bank Holding Corp | Goldman Sachs | 28.180 |
| 17.227 | Merck & Co Inc | HSBC | 37.725 | (10.560) | Metropolitan Bank Holding Corp | HSBC | 124.925 |
| 8.176 | Merck & Co Inc | Morgan Stanley | (22.625) | 588 | Mettler-Toledo International Inc | Barclays Bank | 34.921 |
| (3.975) | Mercury General Corp | Goldman Sachs | (4.373) | 1.030 | Mettler-Toledo International Inc | Goldman Sachs | 75.561 |
| 1.998 | Mercury General Corp | HSBC | 1.339 | 1.636 | Mettler-Toledo International Inc | HSBC | 181.269 |
| (5.220) | Mercury General Corp | Morgan Stanley | (5.116) | 33 | Mettler-Toledo International Inc | Morgan Stanley | 1.960 |
| 5.743 | Mercury Systems Inc | Goldman Sachs | 3.676 | (26.197) | MFA Financial Inc (REIT) | Bank of America | |
| (17.129) | Meridian Bioscience Inc | Barclays Bank | (24.666) | (1.740) | MFA Financial Inc (REIT) | Merrill Lynch | — |
| (11.665) | Meridian Bioscience Inc | Goldman Sachs | (32.545) | (59.144) | MFA Financial Inc (REIT) | Barclays Bank | (400) |
| (3.201) | Meridian Bioscience Inc | HSBC | (11.136) | (12.214) | MFA Financial Inc (REIT) | Goldman Sachs | (1.795) |
| (1.841) | Meridian Bioscience Inc | Morgan Stanley | (2.651) | (9.037) | MGE Energy Inc | HSBC | (2.531) |
| 6.234 | Meridian Corp | Bank of America | | (23.372) | MGE Energy Inc | Barclays Bank | 5.332 |
| | | Merrill Lynch | 4.146 | | | HSBC | 30.617 |
| 18.269 | Meridian Corp | Barclays Bank | 21.466 | | | | |
| 800 | Meridian Corp | Goldman Sachs | 532 | | | | |
| 14.407 | Meridian Corp | HSBC | 9.004 | | | | |
| 8.803 | Meridian Corp | Morgan Stanley | 10.344 | | | | |
| (1.152) | MeridianLink Inc | Barclays Bank | 150 | | | | |
| (9.175) | MeridianLink Inc | Goldman Sachs | (9.769) | | | | |
| (8.106) | MeridianLink Inc | HSBC | (17.590) | | | | |
| 594 | Merit Medical Systems Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 689 | | | | |
| 21.396 | Merit Medical Systems Inc | Barclays Bank | 21.610 | | | | |
| 14.759 | Merit Medical Systems Inc | Goldman Sachs | 18.481 | | | | |
| 3.206 | Merit Medical Systems Inc | HSBC | 15.596 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|----------------------------------|---|---|---|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (30.309) | MGE Energy Inc | Morgan Stanley | 17.882 | 6.851 | Midland States Bancorp Inc | Morgan Stanley | 3.151 |
| 14.105 | MGIC Investment Corp | Bank of America Merrill Lynch | 10.297 | 4.466 | MidWestOne Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6.076 |
| 12.484 | MGIC Investment Corp | Barclays Bank | 5.243 | 32.990 | MidWestOne Financial Group Inc | Barclays Bank | 24.083 |
| 14.289 | MGIC Investment Corp | Goldman Sachs | 10.431 | 25.414 | MidWestOne Financial Group Inc | Goldman Sachs | 40.686 |
| 14.364 | MGIC Investment Corp | Morgan Stanley | 6.033 | 3.350 | MidWestOne Financial Group Inc | HSBC | 1.106 |
| (19.715) | MGM Resorts International | Bank of America Merrill Lynch | (8.851) | 5.841 | MidWestOne Financial Group Inc | Morgan Stanley | 4.264 |
| (18.131) | MGM Resorts International | Barclays Bank | (28.103) | (101.369) | Milestone Scientific Inc | Barclays Bank | (7.714) |
| (52.569) | MGM Resorts International | Goldman Sachs | (4.731) | (20.990) | Milestone Scientific Inc | Goldman Sachs | (2.078) |
| (39.453) | MGM Resorts International | HSBC | 9.368 | 1.148 | Miller Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 930 |
| 579 | MGP Ingredients Inc | Barclays Bank | 2.426 | 13.547 | Miller Industries Inc | Barclays Bank | 12.328 |
| 2.841 | MGP Ingredients Inc | Goldman Sachs | (6.534) | 12.684 | Miller Industries Inc | Goldman Sachs | 10.274 |
| 2.527 | MGP Ingredients Inc | HSBC | 8.693 | 18.869 | Miller Industries Inc | HSBC | (17.328) |
| 1.747 | MGP Ingredients Inc | Morgan Stanley | 7.320 | 10.266 | Miller Industries Inc | Morgan Stanley | 9.342 |
| 2.892 | Microchip Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | 15.935 | (37.450) | MillerKnoll Inc | Barclays Bank | (73.777) |
| (32.849) | Microchip Technology Inc | Barclays Bank | (145.850) | (8.261) | MillerKnoll Inc | Goldman Sachs | (11.896) |
| 1.338 | Microchip Technology Inc | Barclays Bank | 5.941 | (10.806) | MillerKnoll Inc | HSBC | (7.780) |
| 8.496 | Microchip Technology Inc | Goldman Sachs | 37.902 | (40.306) | MiMedx Group Inc | Goldman Sachs | 403 |
| (32.094) | Microchip Technology Inc | Morgan Stanley | (142.497) | (13.618) | Minerals Technologies Inc | Barclays Bank | (26.283) |
| (21.386) | Micron Technology Inc | Goldman Sachs | (45.338) | (11.572) | Minerals Technologies Inc | Goldman Sachs | (16.317) |
| (4.149) | Micron Technology Inc | HSBC | (18.760) | (22.192) | Minerals Technologies Inc | Morgan Stanley | (42.831) |
| (11.808) | Micron Technology Inc | Morgan Stanley | (35.424) | (34.690) | Minerva Neurosciences Inc | HSBC | (715) |
| 5.915 | Microsoft Corp | Barclays Bank | 52.986 | (9.178) | Minerva Neurosciences Inc | Morgan Stanley | (702) |
| 1.993 | Microsoft Corp | Goldman Sachs | 18.635 | 51.209 | Miragen Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (51) |
| 4.041 | Microsoft Corp | HSBC | 24.239 | 1.884 | Miragen Therapeutics Inc ^{1,2} | Morgan Stanley | — |
| 3.988 | Microsoft Corp | Morgan Stanley | 40.678 | 1.009 | Mirati Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (18.152) |
| (2.418) | MicroStrategy Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (88.233) | (5.926) | Mirati Therapeutics Inc | Barclays Bank | 148.742 |
| (7.828) | MicroVision Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.992) | 569 | Mirati Therapeutics Inc | Barclays Bank | (14.282) |
| (3.961) | MicroVision Inc | Goldman Sachs | (2.020) | (1.184) | Mirati Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 21.300 |
| 1.213 | Mid Penn Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.244 | 854 | Mirati Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (15.363) |
| 17.990 | Mid Penn Bancorp Inc | Barclays Bank | 22.128 | 4.286 | Mirati Therapeutics Inc | HSBC | (74.542) |
| 4.464 | Mid Penn Bancorp Inc | Goldman Sachs | 8.258 | (1.942) | Mirati Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 48.744 |
| 11.825 | Mid Penn Bancorp Inc | HSBC | 18.683 | 3.553 | Mirati Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (89.180) |
| 18.957 | Mid Penn Bancorp Inc | Morgan Stanley | 23.317 | 21.928 | Mirum Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (31.357) |
| 10.082 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 48.696 | 2.642 | Mission Produce Inc | Barclays Bank | 1.427 |
| 12.250 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | Barclays Bank | 46.060 | 13.133 | Mission Produce Inc | Goldman Sachs | (2.758) |
| 5.940 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | Goldman Sachs | 28.690 | 2.726 | Mission Produce Inc | HSBC | 2.399 |
| 5.915 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | HSBC | 25.908 | (3.106) | Mister Car Wash Inc | Barclays Bank | (2.081) |
| 8.169 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | Morgan Stanley | 30.716 | (10.543) | Mister Car Wash Inc | Goldman Sachs | (6.642) |
| (1.237) | Middleby Corp | Bank of America Merrill Lynch | (12.209) | (2.198) | Mister Car Wash Inc | HSBC | 249 |
| (14.396) | Middleby Corp | Barclays Bank | (139.642) | (4.357) | Mister Car Wash Inc | Morgan Stanley | (2.919) |
| (3.269) | Middleby Corp | HSBC | 2.909 | 35.814 | Mistras Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 17.191 |
| (4.698) | Middleby Corp | Morgan Stanley | (45.571) | 7.157 | Mistras Group Inc | Barclays Bank | 3.078 |
| 30 | Middlefield Banc Corp | Bank of America Merrill Lynch | (27) | 3.615 | Mistras Group Inc | HSBC | 1.699 |
| 3.052 | Middlefield Banc Corp | Barclays Bank | 305 | 37.123 | Mistras Group Inc | Morgan Stanley | 15.963 |
| 3.202 | Middlefield Banc Corp | Goldman Sachs | (2.882) | (21.333) | Mitek Systems Inc | Barclays Bank | (5.054) |
| 597 | Middlefield Banc Corp | HSBC | (1.003) | (3.285) | Mitek Systems Inc | Goldman Sachs | 99 |
| (1.656) | Middlesex Water Co | Bank of America Merrill Lynch | 7.384 | (34.042) | Mitek Systems Inc | HSBC | 13.186 |
| (628) | Middlesex Water Co | Barclays Bank | 2.688 | 11.948 | MKS Instruments Inc | Barclays Bank | 27.958 |
| (393) | Middlesex Water Co | Goldman Sachs | 1.996 | 8.370 | MKS Instruments Inc | Goldman Sachs | 49.718 |
| (5.710) | Middlesex Water Co | HSBC | 22.212 | 4.574 | MKS Instruments Inc | HSBC | 31.240 |
| (6.887) | Middlesex Water Co | Morgan Stanley | 29.476 | 1.302 | MKS Instruments Inc | Morgan Stanley | 3.047 |
| 26.331 | Midland States Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 22.273 | 5.732 | Model N Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.101 |
| 18.686 | Midland States Bancorp Inc | Barclays Bank | 8.596 | 12.384 | Model N Inc | Barclays Bank | 27.492 |
| 14.910 | Midland States Bancorp Inc | Goldman Sachs | 12.673 | 13.341 | Model N Inc | Goldman Sachs | 11.873 |
| 19.350 | Midland States Bancorp Inc | HSBC | (3.677) | 9.811 | Model N Inc | HSBC | 10.446 |
| | | | | 8.362 | Model N Inc | Morgan Stanley | 18.564 |
| | | | | (4.573) | Moderna Inc | Barclays Bank | (42.255) |
| | | | | (3.933) | Moderna Inc | Goldman Sachs | (41.690) |
| | | | | (40) | Moderna Inc | HSBC | (442) |
| | | | | (1.356) | Moderna Inc | Morgan Stanley | (12.529) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 3.201 | Modine Manufacturing Co | Bank of America | | 13.507 | Moneylion Inc | HSBC | 5.403 |
| | | Merrill Lynch | 9.571 | (606) | MongoDB Inc | Bank of America | |
| 12.829 | Modine Manufacturing Co | Barclays Bank | 33.612 | | | Merrill Lynch | 1.385 |
| 31.023 | Modine Manufacturing Co | Goldman Sachs | 92.759 | (246) | MongoDB Inc | Barclays Bank | (2.440) |
| 12.957 | Modine Manufacturing Co | HSBC | 38.741 | (965) | MongoDB Inc | Goldman Sachs | 2.559 |
| 2.644 | Modine Manufacturing Co | Morgan Stanley | 6.927 | (1.043) | MongoDB Inc | HSBC | (18.746) |
| (2.731) | ModivCare Inc | Barclays Bank | 1.939 | (2.078) | MongoDB Inc | Morgan Stanley | 582 |
| (2.830) | ModivCare Inc | Goldman Sachs | 5.773 | 772 | Monolithic Power Systems Inc | Bank of America | |
| 8.710 | Moelis & Co 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 22.655 |
| | | Merrill Lynch | 33.969 | 1.051 | Monolithic Power Systems Inc | Barclays Bank | 29.207 |
| 31.625 | Moelis & Co 'A' | Barclays Bank | 60.720 | 1.743 | Monolithic Power Systems Inc | | |
| 32.484 | Moelis & Co 'A' | Goldman Sachs | 126.688 | (2.508) | Monro Inc | Goldman Sachs | 47.413 |
| 8.630 | Moelis & Co 'A' | HSBC | 36.419 | | | Merrill Lynch | (1.978) |
| (356) | Mohawk Industries Inc | Bank of America | | (10.231) | Monro Inc | Barclays Bank | (36.832) |
| | | Merrill Lynch | 382 | (3.161) | Monro Inc | Goldman Sachs | (2.181) |
| (26.007) | Mohawk Industries Inc | Barclays Bank | (96.504) | (41.167) | Monster Beverage Corp | Barclays Bank | (55.164) |
| (458) | Mohawk Industries Inc | Goldman Sachs | (17) | (7.231) | Monster Beverage Corp | Goldman Sachs | (9.727) |
| (1.532) | Mohawk Industries Inc | HSBC | 97 | (10.320) | Monster Beverage Corp | HSBC | (43.935) |
| (1.698) | Mohawk Industries Inc | Morgan Stanley | (5.224) | (54.642) | Monster Beverage Corp | Morgan Stanley | (72.877) |
| 6.708 | Molecular Templates Inc | Bank of America | | (46.088) | Montauk Renewables Inc | Barclays Bank | (28.575) |
| | | Merrill Lynch | (1.275) | (1.630) | Montrose Environmental Group Inc | Bank of America | |
| 7.340 | Molecular Templates Inc | Barclays Bank | (514) | (3.690) | Montrose Environmental Group Inc | Merrill Lynch | (2.921) |
| 38.904 | Molecular Templates Inc | Goldman Sachs | (7.392) | (11.717) | Montrose Environmental Group Inc | Barclays Bank | (2.214) |
| 10.169 | Molecular Templates Inc | HSBC | (3.661) | (1.116) | Montrose Environmental Group Inc | Goldman Sachs | (14.609) |
| 15.387 | Molecular Templates Inc | Morgan Stanley | (1.077) | 219 | Moody's Corp | HSBC | 1.489 |
| 4.737 | Molina Healthcare Inc | Barclays Bank | (59.497) | | | Bank of America | |
| 403 | Molina Healthcare Inc | Goldman Sachs | (1.745) | 11.502 | Moody's Corp | Merrill Lynch | 3.105 |
| 7.445 | Molina Healthcare Inc | HSBC | 20.473 | 7.141 | Moody's Corp | Barclays Bank | 78.098 |
| 1.153 | Molina Healthcare Inc | Morgan Stanley | (14.482) | 2.325 | Moody's Corp | Goldman Sachs | 101.260 |
| 1.035 | Molson Coors Beverage Co 'B' | Bank of America | | 2.681 | Moog Inc 'A' | HSBC | 37.921 |
| | | Merrill Lynch | 1.717 | 26.749 | Moog Inc 'A' | Bank of America | |
| 44.980 | Molson Coors Beverage Co 'B' | Barclays Bank | 114.249 | 17.850 | Moog Inc 'A' | Merrill Lynch | 12.654 |
| 14.563 | Molson Coors Beverage Co 'B' | Goldman Sachs | (19.995) | 10.458 | Moog Inc 'A' | Barclays Bank | 113.683 |
| 5.392 | Molson Coors Beverage Co 'B' | HSBC | 2.254 | 966 | Moog Inc 'A' | Goldman Sachs | 84.252 |
| 1.729 | Molson Coors Beverage Co 'B' | Morgan Stanley | 4.392 | (171) | Morgan Group Holding Co | HSBC | 49.780 |
| 4.525 | Momentive Global Inc | Bank of America | | | | Morgan Stanley | 4.106 |
| | | Merrill Lynch | 588 | (47) | Morgan Group Holding Co | Bank of America | |
| 23.822 | Momentive Global Inc | Barclays Bank | 3.097 | (9) | Morgan Group Holding Co | Merrill Lynch | (4) |
| 16.833 | Momentive Global Inc | Goldman Sachs | 2.188 | (69) | Morgan Group Holding Co | Barclays Bank | 11 |
| 2.497 | Momentive Global Inc | HSBC | (13) | (50) | Morgan Group Holding Co | Goldman Sachs | — |
| 4.605 | Momentive Global Inc | Morgan Stanley | 1.965 | (21.382) | Morgan Stanley | HSBC | (35) |
| (8.569) | Monarch Casino & Resort Inc | Barclays Bank | 4.799 | | | Morgan Stanley | 11 |
| (377) | Monarch Casino & Resort Inc | HSBC | 259 | (5.901) | Morgan Stanley | Bank of America | |
| 6.702 | Mondelez International Inc 'A' | Bank of America | | (26.958) | Morgan Stanley | Merrill Lynch | (116.985) |
| | | Merrill Lynch | (15.826) | (17.943) | Morgan Stanley | Barclays Bank | (22.778) |
| (3.547) | Mondelez International Inc 'A' | Bank of America | | 378 | Morningstar Inc | Goldman Sachs | (169.026) |
| | | Merrill Lynch | (6.532) | (405) | Morningstar Inc | HSBC | (90.074) |
| (4.281) | Mondelez International Inc 'A' | Barclays Bank | (3.510) | 1.308 | Morningstar Inc | Barclays Bank | 4.154 |
| 3.704 | Mondelez International Inc 'A' | Goldman Sachs | (12.112) | (1.151) | Morningstar Inc | Barclays Bank | (4.451) |
| (13.495) | Mondelez International Inc 'A' | Goldman Sachs | 39.087 | 1.971 | Morningstar Inc | Goldman Sachs | 26.304 |
| 22.622 | Mondelez International Inc 'A' | HSBC | (807) | (492) | Morningstar Inc | Goldman Sachs | (19.800) |
| (15.812) | Mondelez International Inc 'A' | HSBC | 6.527 | 1.082 | Morningstar Inc | HSBC | 34.142 |
| 13.998 | Mondelez International Inc 'A' | Morgan Stanley | 9.860 | (1.147) | Morningstar Inc | HSBC | (11.719) |
| (9.251) | Mondelez International Inc 'A' | Morgan Stanley | (7.586) | (1.608) | Morphic Holding Inc | Morgan Stanley | 12.015 |
| 11.599 | Moneylion Inc | Barclays Bank | 3.364 | | | Morgan Stanley | (12.606) |
| 26.155 | Moneylion Inc | Goldman Sachs | 10.462 | (4.233) | Morphic Holding Inc | Bank of America | |
| | | | | (7.607) | Morphic Holding Inc | Merrill Lynch | 1.721 |
| | | | | (1.214) | Morphic Holding Inc | Barclays Bank | 2.709 |
| | | | | 1.590 | Mosaic Co | Goldman Sachs | 8.139 |
| | | | | (4.476) | Mosaic Co | HSBC | 4.832 |
| | | | | 14.664 | Mosaic Co | Barclays Bank | 5.917 |
| | | | | | | Barclays Bank | (5.685) |
| | | | | | | Goldman Sachs | (11.878) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|---------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 2.994 | Motorcar Parts of America Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.946 | 3.564 | Mueller Industries Inc | Barclays Bank | (2.103) |
| 3.632 | Motorcar Parts of America Inc | Barclays Bank | 1.271 | 11.261 | Mueller Industries Inc | Goldman Sachs | 15.090 |
| 6.217 | Motorcar Parts of America Inc | Goldman Sachs | 4.053 | 9.227 | Mueller Industries Inc | HSBC | 5.684 |
| 3.091 | Motorcar Parts of America Inc | HSBC | (124) | 13 | Mueller Industries Inc | Morgan Stanley | (8) |
| 1.095 | Motorcar Parts of America Inc | Morgan Stanley | 383 | (7.108) | Mueller Water Products Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.955) |
| (375) | Motorola Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.752) | (31.082) | Mueller Water Products Inc 'A' | Barclays Bank | (4.507) |
| (11.212) | Motorola Solutions Inc | Barclays Bank | (67.577) | (39.967) | Mueller Water Products Inc 'A' | Goldman Sachs | (10.991) |
| 1.672 | Motorola Solutions Inc | Barclays Bank | 10.099 | (52.909) | Mueller Water Products Inc 'A' | HSBC | 3.555 |
| (119) | Motorola Solutions Inc | HSBC | (118) | (12.592) | Mueller Water Products Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.826) |
| (771) | Motorola Solutions Inc | Morgan Stanley | (4.509) | 25.162 | Multiplan Corp | Goldman Sachs | 9.562 |
| (8.962) | Motorsport Games Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 272 | 14.330 | Multiplan Corp | HSBC | 15.190 |
| (19.072) | Motorsport Games Inc 'A' | Goldman Sachs | 580 | 59.255 | Murphy Oil Corp | Barclays Bank | 447.376 |
| (5.581) | Movado Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.107) | 38.425 | Murphy Oil Corp | Goldman Sachs | 358.968 |
| (4.286) | Movado Group Inc | Barclays Bank | (7.790) | 82.249 | Murphy Oil Corp | HSBC | 905.591 |
| (13.121) | Movado Group Inc | HSBC | (1.652) | 187 | Murphy Oil Corp | Morgan Stanley | 1.412 |
| (4.001) | Movado Group Inc | Morgan Stanley | (6.242) | 1.505 | Murphy USA Inc | Bank of America Merrill Lynch | (8.217) |
| 30.131 | MP Materials Corp | Bank of America Merrill Lynch | 58.211 | 1.023 | Murphy USA Inc | Barclays Bank | 12.747 |
| (3.319) | MP Materials Corp | Barclays Bank | (2.191) | (586) | Murphy USA Inc | Goldman Sachs | 3.200 |
| 26.289 | MP Materials Corp | Barclays Bank | 14.105 | 1.741 | Murphy USA Inc | Goldman Sachs | (9.506) |
| 4.609 | MP Materials Corp | Goldman Sachs | (657) | 1.626 | Murphy USA Inc | Morgan Stanley | 20.260 |
| (1.704) | Mr Cooper Group Inc | Barclays Bank | 1.465 | 69.887 | Mustang Bio Inc | Barclays Bank | (1.440) |
| (4.119) | Mr Cooper Group Inc | Goldman Sachs | (3.584) | 69.311 | Mustang Bio Inc | Goldman Sachs | (3.265) |
| (11.083) | Mr Cooper Group Inc | HSBC | (6.249) | 120.531 | Mustang Bio Inc | HSBC | 241 |
| 19.171 | MRC Global Inc | Barclays Bank | 16.487 | 17.135 | Mustang Bio Inc | Morgan Stanley | (353) |
| 21.161 | MRC Global Inc | Goldman Sachs | 27.509 | (3.776) | MVB Financial Corp | Barclays Bank | (227) |
| 33.576 | MRC Global Inc | HSBC | 11.132 | (8.233) | MVB Financial Corp | Goldman Sachs | 329 |
| 1.794 | MSA Safety Inc | Bank of America Merrill Lynch | 13.096 | (4.771) | MVB Financial Corp | HSBC | 8.302 |
| (6.690) | MSA Safety Inc | Barclays Bank | (48.503) | (5.748) | MVB Financial Corp | Morgan Stanley | (345) |
| 1.959 | MSA Safety Inc | Barclays Bank | 14.203 | (51.217) | Myers Industries Inc | Barclays Bank | (18.950) |
| 1.275 | MSA Safety Inc | Goldman Sachs | 9.622 | (27.338) | Myers Industries Inc | Goldman Sachs | 12.302 |
| (1.984) | MSA Safety Inc | HSBC | (11.527) | 6.225 | MyMD Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 2.615 |
| 940 | MSA Safety Inc | HSBC | 5.461 | 3.356 | MyMD Pharmaceuticals Inc | HSBC | — |
| 2.567 | MSA Safety Inc | Morgan Stanley | 18.611 | 2.900 | MyMD Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 1.218 |
| (797) | MSC Industrial Direct Co Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.000) | 7.538 | MYR Group Inc | Barclays Bank | 26.911 |
| (22.674) | MSC Industrial Direct Co Inc 'A' | Barclays Bank | (62.807) | 8.307 | MYR Group Inc | Goldman Sachs | 51.420 |
| (18.184) | MSC Industrial Direct Co Inc 'A' | Goldman Sachs | (45.642) | 963 | MYR Group Inc | HSBC | 8.792 |
| (815) | MSC Industrial Direct Co Inc 'A' | HSBC | (1.697) | 8.975 | Myriad Genetics Inc | Barclays Bank | (808) |
| (283) | MSC Industrial Direct Co Inc 'A' | Morgan Stanley | (784) | 14.139 | Myriad Genetics Inc | Goldman Sachs | (5.656) |
| (883) | MSCI Inc | Bank of America Merrill Lynch | (30.638) | 7.670 | Myriad Genetics Inc | HSBC | 14.803 |
| (2.208) | MSCI Inc | Barclays Bank | (55.818) | 6.674 | Myriad Genetics Inc | Morgan Stanley | (601) |
| (1.456) | MSCI Inc | Goldman Sachs | (59.934) | (19.426) | N-able Inc | HSBC | (15.152) |
| (1.675) | MSCI Inc | HSBC | (53.463) | (10.077) | N-Able Inc | Barclays Bank | (5.442) |
| (2.317) | MSCI Inc | Morgan Stanley | (58.574) | (39.655) | N-Able Inc | Goldman Sachs | (39.655) |
| (330) | MSG Entertainment Spinco Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.739) | (9.380) | N-Able Inc | Morgan Stanley | (5.065) |
| (6.884) | MSG Entertainment Spinco Inc 'A' | Barclays Bank | (17.210) | (1.970) | Nabors Industries Ltd | Barclays Bank | (54.352) |
| (4.870) | MSG Entertainment Spinco Inc 'A' | Goldman Sachs | (25.665) | (2.239) | Nabors Industries Ltd | Barclays Bank | (28.939) |
| (971) | MSG Entertainment Spinco Inc 'A' | HSBC | (6.951) | (1.094) | Nabors Industries Ltd | HSBC | (50.109) |
| 7.631 | Mueller Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.917 | (1.421) | NACCO Industries Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (5.869) |
| | | | | (1.348) | NACCO Industries Inc 'A' | Barclays Bank | (3.882) |
| | | | | 3.193 | NanoString Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.975 |
| | | | | 1.390 | NanoString Technologies Inc | Goldman Sachs | 585 |
| | | | | 5.572 | NanoString Technologies Inc | HSBC | 10.510 |
| | | | | (28.696) | Napco Security Technologies Inc | Barclays Bank | (74.036) |
| | | | | (19.110) | Napco Security Technologies Inc | Goldman Sachs | (45.482) |
| | | | | (9.000) | Napco Security Technologies Inc | HSBC | (26.550) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3.968) | Napco Security Technologies Inc | Morgan Stanley | (10.237) | (2.407) | National Presto Industries Inc | Morgan Stanley | 1.228 |
| (4.047) | Nasdaq Inc | Bank of America | | 1.402 | National Research Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (36.180) | | | Merrill Lynch | 2.411 |
| (6.054) | Nasdaq Inc | Barclays Bank | (44.557) | 6.283 | National Research Corp | Barclays Bank | 13.236 |
| (13.374) | Nasdaq Inc | Goldman Sachs | (114.994) | 2.243 | National Research Corp | Goldman Sachs | 3.858 |
| (5.199) | Nasdaq Inc | HSBC | (46.219) | 1.273 | National Research Corp | HSBC | 2.253 |
| (3.689) | Nasdaq Inc | Morgan Stanley | (27.151) | 8.887 | National Research Corp | Morgan Stanley | 20.085 |
| 4.012 | Natera Inc | Bank of America | | (2.290) | National Retail Properties Inc (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 17.773 | | | Merrill Lynch | 23 |
| 3.048 | Natera Inc | Barclays Bank | (2.134) | (19.076) | National Retail Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (19.648) |
| 4.428 | Natera Inc | Goldman Sachs | 19.616 | | | | |
| 5.693 | Natera Inc | HSBC | 48.732 | (51.308) | National Retail Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 513 |
| (898) | Nathan's Famous Inc | Bank of America | | (89.175) | National Retail Properties Inc (REIT) | HSBC | (124.845) |
| | | Merrill Lynch | (2.398) | | | | |
| (10.359) | Nathan's Famous Inc | Barclays Bank | (41.747) | (46.349) | National Retail Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (47.743) |
| (272) | Nathan's Famous Inc | Goldman Sachs | (726) | | | | |
| (2.537) | Nathan's Famous Inc | Morgan Stanley | (10.224) | 94.312 | National Storage Affiliates Trust (REIT) | Barclays Bank | 300.856 |
| 5.079 | National Bank Holdings Corp 'A' | Goldman Sachs | 12.444 | 16.646 | National Storage Affiliates Trust (REIT) | Goldman Sachs | 31.461 |
| 10.583 | National Bank Holdings Corp 'A' | HSBC | 26.563 | 21.727 | National Storage Affiliates Trust (REIT) | HSBC | 70.395 |
| 12.531 | National Bank Holdings Corp 'A' | Morgan Stanley | 17.669 | 9.098 | National Storage Affiliates Trust (REIT) | Morgan Stanley | 29.023 |
| (8.946) | National Bankshares Inc | Bank of America | | 5.038 | National Vision Holdings Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 9.035 | | | Merrill Lynch | 8.867 |
| (9.187) | National Bankshares Inc | Barclays Bank | 7.166 | 8.308 | National Vision Holdings Inc | Barclays Bank | 3.905 |
| (10.067) | National Bankshares Inc | Morgan Stanley | 7.852 | 16.599 | National Vision Holdings Inc | Goldman Sachs | 29.214 |
| (3.617) | National Beverage Corp | Bank of America | | 2.618 | National Vision Holdings Inc | HSBC | 5.517 |
| | | Merrill Lynch | (7.596) | (572) | National Western Life Group Inc 'A' | Bank of America | |
| (13.698) | National Beverage Corp | Barclays Bank | (55.066) | | | Merrill Lynch | (5.517) |
| (3.476) | National Beverage Corp | HSBC | (15.642) | (3.115) | National Western Life Group Inc 'A' | Barclays Bank | (23.534) |
| (1.523) | National Beverage Corp | Morgan Stanley | (6.122) | (2.628) | National Western Life Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (25.347) |
| 25.849 | National CineMedia Inc | Barclays Bank | 1.422 | (1.590) | National Western Life Group Inc 'A' | Morgan Stanley | (12.012) |
| 18.257 | National CineMedia Inc | Goldman Sachs | (3.195) | 27.916 | Natural Gas Services Group Inc | Morgan Stanley | 29.312 |
| (28.676) | National Energy Services Reunited Corp | Barclays Bank | (30.683) | 11.350 | Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc | Barclays Bank | 11.463 |
| (9.591) | National Energy Services Reunited Corp | Goldman Sachs | (13.236) | 14.415 | Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc | Goldman Sachs | (11.100) |
| (52.000) | National Fuel Gas Co | Barclays Bank | (208.520) | 13.805 | Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc | HSBC | (2.761) |
| (23.457) | National Fuel Gas Co | Goldman Sachs | (158.803) | 19.911 | Nature's Sunshine Products Inc | Bank of America | |
| (23.775) | National Fuel Gas Co | Morgan Stanley | (95.338) | 20.720 | Nature's Sunshine Products Inc | Merrill Lynch | 199 |
| (15.155) | National Health Investors Inc (REIT) | Bank of America | | 11.746 | Nature's Sunshine Products Inc | Barclays Bank | 7.252 |
| | | Merrill Lynch | (46.223) | | | Goldman Sachs | 117 |
| (26.056) | National Health Investors Inc (REIT) | Barclays Bank | (61.753) | 1.012 | Nature's Sunshine Products Inc | HSBC | (324) |
| (10.983) | National Health Investors Inc (REIT) | Goldman Sachs | (33.498) | 19.046 | Nature's Sunshine Products Inc | Morgan Stanley | 6.666 |
| (17.943) | National Health Investors Inc (REIT) | HSBC | (85.588) | 41.516 | Nautilus Biotechnology Inc | Barclays Bank | (13.700) |
| (14.415) | National Health Investors Inc (REIT) | Morgan Stanley | (34.164) | 25.890 | Nautilus Biotechnology Inc | Goldman Sachs | (5.178) |
| (13.959) | National HealthCare Corp | Goldman Sachs | 12.005 | 18.464 | Nautilus Biotechnology Inc | HSBC | 739 |
| (8.072) | National HealthCare Corp | HSBC | 16.225 | 11.654 | Nautilus Biotechnology Inc | Morgan Stanley | (3.846) |
| (4.094) | National HealthCare Corp | Morgan Stanley | (3.726) | (13.015) | Nautilus Inc | Barclays Bank | 5.076 |
| (3.928) | National Instruments Corp | Bank of America | | (9.172) | Nautilus Inc | Goldman Sachs | 3.577 |
| | | Merrill Lynch | (4.124) | (7.590) | Nautilus Inc | HSBC | 5.389 |
| 28.205 | National Instruments Corp | Barclays Bank | (26.231) | (2.081) | Navigent Corp | Bank of America | |
| (11.252) | National Instruments Corp | Goldman Sachs | (12.167) | | | Merrill Lynch | (603) |
| 12.425 | National Instruments Corp | HSBC | 30.317 | (33.897) | Navient Corp | Barclays Bank | (17.864) |
| (7.336) | National Instruments Corp | HSBC | (6.935) | (4.643) | Navient Corp | HSBC | (2.513) |
| 15.709 | National Instruments Corp | Morgan Stanley | (14.609) | (23.163) | Navient Corp | Morgan Stanley | (10.003) |
| (4.401) | National Presto Industries Inc | Bank of America | | 20.508 | Navigator Holdings Ltd | Barclays Bank | (10.049) |
| | | Merrill Lynch | 12.949 | | | | |
| (2.082) | National Presto Industries Inc | Barclays Bank | 1.062 | | | | |
| (5.308) | National Presto Industries Inc | Goldman Sachs | 15.597 | | | | |
| (2.066) | National Presto Industries Inc | HSBC | 9.844 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 7.447 | Navigator Holdings Ltd | Goldman Sachs | 894 | (4.413) | NETSTREIT Corp (REIT) | Morgan Stanley | (1.679) |
| (690) | NBT Bancorp Inc | Goldman Sachs | 197 | (37.849) | NeuBase Therapeutics Inc | Bank of America | |
| (9.528) | nCino Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (2.649) |
| | | Merrill Lynch | (38.874) | (14.766) | NeuBase Therapeutics Inc | Barclays Bank | (295) |
| (8.575) | nCino Inc | Barclays Bank | (13.736) | 1.251 | Neurocrine Biosciences Inc | Bank of America | |
| (17.005) | nCino Inc | Goldman Sachs | (69.381) | | | Merrill Lynch | 9.071 |
| (11.973) | nCino Inc | HSBC | (49.450) | (2.490) | Neurocrine Biosciences Inc | Barclays Bank | (15.040) |
| (4.893) | nCino Inc | Morgan Stanley | (6.409) | (2.266) | Neurocrine Biosciences Inc | Goldman Sachs | (17.335) |
| (2.923) | NCR Corp | Bank of America | | (2.924) | Neurocrine Biosciences Inc | HSBC | (48.948) |
| | | Merrill Lynch | (2.923) | 3.997 | Neurocrine Biosciences Inc | HSBC | 66.910 |
| (15.046) | NCR Corp | Barclays Bank | (20.613) | (3.229) | Neurocrine Biosciences Inc | Morgan Stanley | (19.503) |
| (21.405) | NCR Corp | Goldman Sachs | (21.405) | 338 | Neurocrine Biosciences Inc | Morgan Stanley | 2.042 |
| (23.100) | NCR Corp | HSBC | (31.878) | (7.855) | Neuronetics Inc | Bank of America | |
| 11.947 | Nektar Therapeutics | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (2.278) |
| | | Merrill Lynch | (4.062) | (257) | Neuronetics Inc | Barclays Bank | (87) |
| 30.431 | Nektar Therapeutics | Barclays Bank | (913) | 937 | NeuroPace Inc | Bank of America | |
| 41.396 | Nektar Therapeutics | Goldman Sachs | (10.100) | | | Merrill Lynch | 1.181 |
| 21.895 | Nektar Therapeutics | HSBC | (3.722) | 3.401 | NeuroPace Inc | Barclays Bank | 1.020 |
| 88.351 | Nektar Therapeutics | Morgan Stanley | (2.651) | 2.807 | NeuroPace Inc | Goldman Sachs | 3.537 |
| 1.760 | Nelnet Inc 'A' | Bank of America | | 2.074 | NeuroPace Inc | Morgan Stanley | 622 |
| | | Merrill Lynch | 3.415 | (584) | Nevro Corp | Bank of America | |
| 4.630 | Nelnet Inc 'A' | Barclays Bank | 3.010 | | | Merrill Lynch | 753 |
| 8.118 | Nelnet Inc 'A' | Goldman Sachs | 11.690 | (2.523) | Nevro Corp | Barclays Bank | 6.484 |
| 2.488 | Nelnet Inc 'A' | HSBC | 8.111 | (1.353) | Nevro Corp | HSBC | 677 |
| (557) | NEOGAMES SA | Barclays Bank | (448) | (460) | Nevro Corp | Morgan Stanley | 1.182 |
| (3.968) | NEOGAMES SA | Goldman Sachs | (5.337) | (11.864) | New Fortress Energy Inc | Bank of America | |
| (1.614) | NEOGAMES SA | Morgan Stanley | (1.299) | | | Merrill Lynch | (39.270) |
| (9.528) | Neogen Corp | Barclays Bank | — | (11.818) | New Fortress Energy Inc | Goldman Sachs | (39.117) |
| (19.685) | Neogen Corp | Goldman Sachs | (9.449) | (5.441) | New Fortress Energy Inc | HSBC | (33.551) |
| (1.675) | NeoGenomics Inc | Bank of America | | (2.260) | New Fortress Energy Inc | Morgan Stanley | (7.820) |
| | | Merrill Lynch | 871 | (1.255) | New Jersey Resources Corp | Bank of America | |
| (8.489) | NeoGenomics Inc | Barclays Bank | 2.716 | | | Merrill Lynch | (1.406) |
| (31.689) | NeoGenomics Inc | Goldman Sachs | 16.478 | (33.900) | New Jersey Resources Corp | Barclays Bank | (13.221) |
| (6.620) | NeoGenomics Inc | HSBC | (1.390) | (28.795) | New Jersey Resources Corp | Goldman Sachs | (32.250) |
| (6.324) | Neoleukin Therapeutics Inc | Bank of America | | | | HSBC | (21.848) |
| | | Merrill Lynch | 506 | (13.563) | New Jersey Resources Corp | | |
| (10.951) | Neoleukin Therapeutics Inc | Barclays Bank | 329 | (1.719) | New Jersey Resources Corp | Morgan Stanley | (670) |
| (16.811) | Neoleukin Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.345 | 3.099 | New Relic Inc | Bank of America | |
| (3.007) | Neoleukin Therapeutics Inc | HSBC | 391 | | | Merrill Lynch | 9.435 |
| (2.605) | Neoleukin Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 78 | 1.069 | New Relic Inc | Barclays Bank | (139) |
| 4.222 | NerdWallet Inc 'A' | Goldman Sachs | 7.726 | 5.686 | New Relic Inc | Goldman Sachs | 22.232 |
| 9.442 | NerdWallet Inc 'A' | HSBC | 31.159 | 394 | New Relic Inc | HSBC | (1.300) |
| 7.135 | NerdWallet Inc 'A' | Morgan Stanley | 7.777 | 7.325 | New Relic Inc | Morgan Stanley | (952) |
| 34.286 | Nerdy Inc | Barclays Bank | 22.972 | (13.645) | New Residential Investment Corp (REIT) | Bank of America | |
| 39.761 | Nerdy Inc | Goldman Sachs | 7.952 | | | Merrill Lynch | (3.821) |
| 14.311 | Nerdy Inc | HSBC | 4.690 | (152.932) | New Residential Investment Corp (REIT) | Barclays Bank | (68.820) |
| 16.921 | Nerdy Inc | Morgan Stanley | 11.337 | (277.049) | New Residential Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (77.573) |
| 14.476 | NetApp Inc | Bank of America | | (60.581) | New Residential Investment Corp (REIT) | HSBC | (23.627) |
| | | Merrill Lynch | 6.225 | 63.419 | New York Community Bancorp Inc | Barclays Bank | 23.148 |
| 15.671 | NetApp Inc | Barclays Bank | 53.595 | 235.582 | New York Community Bancorp Inc | Goldman Sachs | 173.153 |
| 26.602 | NetApp Inc | Goldman Sachs | 3.425 | 33.919 | New York Community Bancorp Inc | HSBC | 25.948 |
| 5.965 | NetApp Inc | HSBC | 10.002 | (8.837) | New York Mortgage Trust Inc (REIT) | Bank of America | |
| 16.185 | NetApp Inc | Morgan Stanley | 55.353 | | | Merrill Lynch | (777) |
| (1.430) | Netflix Inc | Barclays Bank | (8.208) | (96.917) | New York Mortgage Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | (8.238) |
| (3.433) | Netflix Inc | Goldman Sachs | (22.898) | (162.977) | New York Mortgage Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (5.704) |
| (3.999) | Netflix Inc | HSBC | (81.134) | (36.719) | New York Mortgage Trust Inc (REIT) | HSBC | (551) |
| 4.158 | Netflix Inc | Morgan Stanley | 23.867 | | | | |
| 14.969 | NETGEAR Inc | Barclays Bank | 3.443 | | | | |
| 26.313 | NETGEAR Inc | Goldman Sachs | (26.050) | | | | |
| 4.543 | NETGEAR Inc | HSBC | (5.315) | | | | |
| (15.798) | NetScout Systems Inc | Barclays Bank | 36.651 | | | | |
| (13.606) | NetScout Systems Inc | Goldman Sachs | 7.483 | | | | |
| (3.406) | NetScout Systems Inc | HSBC | (5.177) | | | | |
| (7.089) | NETSTREIT Corp (REIT) | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (2.669) | | | | |
| (45.260) | NETSTREIT Corp (REIT) | Barclays Bank | (23.083) | | | | |
| (40.058) | NETSTREIT Corp (REIT) | Goldman Sachs | (3.668) | | | | |
| (16.607) | NETSTREIT Corp (REIT) | HSBC | (8.526) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|--------------------------------|------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (125.508) | New York Mortgage Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (10.668) | 67.956 | NextCure Inc | Barclays Bank | 7.475 |
| 5.788 | New York Times Co 'A' | Bank of America | | 10.134 | NextCure Inc | Goldman Sachs | 3.750 |
| | | Merrill Lynch | 4.314 | 18.397 | NextCure Inc | HSBC | 8.095 |
| 3.167 | New York Times Co 'A' | Barclays Bank | (285) | 6.094 | NextCure Inc | Morgan Stanley | 670 |
| 9.083 | New York Times Co 'A' | Goldman Sachs | 8.448 | (21.052) | NextDecade Corp | Barclays Bank | (14.736) |
| 13.614 | New York Times Co 'A' | HSBC | 9.258 | (5.060) | NextDecade Corp | Goldman Sachs | (4.503) |
| 4.725 | New York Times Co 'A' | Morgan Stanley | (425) | (3.352) | NextEra Energy Inc | Barclays Bank | (12.687) |
| (47.560) | NewAge Inc | Bank of America | | 40.678 | NextEra Energy Inc | Goldman Sachs | 252.814 |
| | | Merrill Lynch | 2.202 | (18.040) | NextEra Energy Inc | Goldman Sachs | (107.167) |
| (20.900) | NewAge Inc | Barclays Bank | (508) | (10.891) | NextEra Energy Inc | Morgan Stanley | (40.442) |
| 6.952 | Newegg Commerce Inc | Barclays Bank | 1.182 | (15.354) | NextEra Energy Partners LP | Bank of America | |
| 17.070 | Newegg Commerce Inc | HSBC | 2.579 | | | Merrill Lynch | (123.600) |
| (4.196) | Newell Brands Inc | Bank of America | | (7.489) | NextEra Energy Partners LP | Barclays Bank | (40.740) |
| | | Merrill Lynch | 6.653 | 4.331 | NextEra Energy Partners LP | Barclays Bank | 23.561 |
| (18.715) | Newell Brands Inc | Barclays Bank | (34.436) | (12.043) | NextEra Energy Partners LP | HSBC | (104.014) |
| (55.774) | Newell Brands Inc | Goldman Sachs | 64.698 | 1.506 | NextEra Energy Partners LP | HSBC | 9.937 |
| (8.950) | Newell Brands Inc | HSBC | 25.328 | (2.951) | NextEra Energy Partners LP | Morgan Stanley | (16.053) |
| (3.252) | Newell Brands Inc | Morgan Stanley | (5.984) | 18.219 | NextGen Healthcare Inc | Barclays Bank | 11.842 |
| (38.150) | Newmark Group Inc 'A' | Barclays Bank | (9.919) | 43.830 | NextGen Healthcare Inc | Goldman Sachs | (69.902) |
| (49.515) | Newmark Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 12.379 | 7.511 | NextGen Healthcare Inc | HSBC | (3.973) |
| (56.022) | Newmark Group Inc 'A' | HSBC | 32.724 | 3.725 | NextGen Healthcare Inc | Morgan Stanley | 2.421 |
| (9.009) | Newmark Group Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.342) | (27.391) | NexTier Oilfield Solutions Inc | HSBC | (54.234) |
| 1.990 | NewMarket Corp | Bank of America | | 12.993 | NGM | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.265 | 15.545 | NGM | Merrill Lynch | 6.367 |
| (521) | NewMarket Corp | Bank of America | | | Biopharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (4.197) |
| | | Merrill Lynch | (115) | 12.082 | NGM | Goldman Sachs | 5.920 |
| 389 | NewMarket Corp | Goldman Sachs | 86 | 10.325 | Biopharmaceuticals Inc | HSBC | 29.013 |
| 1.591 | NewMarket Corp | HSBC | (2.683) | 10.673 | NGM | Biopharmaceuticals Inc | (2.882) |
| (179) | NewMarket Corp | HSBC | 714 | 8.897 | NI Holdings Inc | Bank of America | |
| (4.563) | Newmont Corp | Bank of America | | 11.120 | NI Holdings Inc | Merrill Lynch | 845 |
| | | Merrill Lynch | (16.290) | 17.241 | NI Holdings Inc | Barclays Bank | 7.617 |
| (25.349) | Newmont Corp | Barclays Bank | (40.305) | 16.681 | NI Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.638 |
| (24.023) | Newmont Corp | HSBC | (32.236) | 6.252 | NI Holdings Inc | HSBC | 13.428 |
| (2.160) | Newmont Corp | Morgan Stanley | (3.434) | (8.117) | NI Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.283 |
| 6.249 | Newpark Resources Inc | Bank of America | | (11.834) | Nicolet Bankshares Inc | Barclays Bank | (10.146) |
| | | Merrill Lynch | 2.500 | (14.425) | Nicolet Bankshares Inc | Goldman Sachs | (40.591) |
| 14.792 | Newpark Resources Inc | Barclays Bank | 592 | (3.014) | Nicolet Bankshares Inc | HSBC | (2.020) |
| 37.884 | Newpark Resources Inc | HSBC | 40.157 | (9.616) | NIKE Inc 'B' | Morgan Stanley | (3.768) |
| 34.408 | News Corp 'A' | Barclays Bank | (1.055) | 12.454 | NIKE Inc 'B' | Barclays Bank | (72.697) |
| 38.379 | News Corp 'A' | Goldman Sachs | (11.130) | (7.330) | NIKE Inc 'B' | Barclays Bank | 94.152 |
| 66.455 | News Corp 'A' | HSBC | (3.252) | 1.861 | NIKE Inc 'B' | HSBC | (37.430) |
| 37.963 | News Corp 'A' | Morgan Stanley | 3.887 | 24.934 | Nikola Corp | HSBC | 17.109 |
| 26.913 | News Corp 'B' | Bank of America | | 18.086 | Nikola Corp | Goldman Sachs | 31.417 |
| | | Merrill Lynch | (7.835) | 5.016 | Nikola Corp | HSBC | 21.341 |
| 23.403 | News Corp 'B' | Barclays Bank | (6.553) | (40.223) | NiSource Inc | Morgan Stanley | 3.912 |
| 19.064 | News Corp 'B' | Goldman Sachs | (4.375) | 98.333 | NiSource Inc | Bank of America | |
| 43.614 | News Corp 'B' | HSBC | (5.042) | (24.125) | NiSource Inc | Merrill Lynch | (31.610) |
| 12.177 | News Corp 'B' | Morgan Stanley | (3.409) | (15.959) | NiSource Inc | Barclays Bank | 60.475 |
| 1.044 | NexImmune Inc | Bank of America | | (26.220) | NiSource Inc | Barclays Bank | (14.837) |
| | | Merrill Lynch | (104) | 2.745 | Nkarta Inc | Goldman Sachs | (14.922) |
| 968 | NexImmune Inc | Barclays Bank | (58) | | | HSBC | (50.474) |
| 3.020 | NexImmune Inc | HSBC | (1.842) | 3.446 | Nkarta Inc | Bank of America | |
| 1.296 | NexImmune Inc | Morgan Stanley | (78) | 3.658 | Nkarta Inc | Merrill Lynch | 2.971 |
| 3.971 | NexPoint Residential Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 6.155 | 1.062 | Nkarta Inc | Barclays Bank | 3.768 |
| 17.209 | NexPoint Residential Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 4.302 | (35.339) | NL Industries Inc | Goldman Sachs | 478 |
| 1.749 | NexPoint Residential Trust Inc (REIT) | HSBC | 2.221 | (2.310) | NL Industries Inc | HSBC | 244 |
| 1.970 | NexPoint Residential Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 3.054 | (21.055) | NL Industries Inc | Bank of America | |
| 5.964 | Nexstar Media Group Inc 'A' | Barclays Bank | 3.042 | (7.732) | nLight Inc | Merrill Lynch | (48.768) |
| (1.393) | Nexstar Media Group Inc 'A' | Barclays Bank | (710) | (7.535) | nLight Inc | Barclays Bank | (2.102) |
| (1.081) | Nexstar Media Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (4.454) | (2.210) | nLight Inc | Goldman Sachs | (29.056) |
| 5.294 | Nexstar Media Group Inc 'A' | HSBC | 124.250 | | | Barclays Bank | (4.330) |
| (2.667) | Nexstar Media Group Inc 'A' | HSBC | (24.648) | | | Goldman Sachs | (5.877) |
| (241) | Nexstar Media Group Inc 'A' | Morgan Stanley | (123) | | | HSBC | 1.370 |
| 10.410 | NextCure Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 3.852 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 15.992 | NMI Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 10.235 | 3.870 | Northwest Natural Holding Co | Bank of America Merrill Lynch | 11.416 |
| 27.915 | NMI Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | 17.586 | 3.465 | Northwest Natural Holding Co | Barclays Bank | 358 |
| 19.489 | NMI Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 11.199 | 21.482 | Northwest Natural Holding Co | Goldman Sachs | 63.372 |
| 43.381 | NMI Holdings Inc 'A' | HSBC | 23.971 | 30.007 | Northwest Natural Holding Co | HSBC | 125.729 |
| 14.682 | NMI Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 9.250 | (956) | Northwest Pipe Co | Bank of America Merrill Lynch | (2.906) |
| (22.692) | NN Inc | Bank of America Merrill Lynch | (11.346) | (15.711) | Northwest Pipe Co | Barclays Bank | (2.200) |
| (26.938) | NN Inc | Barclays Bank | (2.694) | (5.425) | Northwest Pipe Co | Goldman Sachs | (16.492) |
| (12.015) | NN Inc | Goldman Sachs | (6.008) | (1.589) | Northwest Pipe Co | Morgan Stanley | (222) |
| (8.618) | NN Inc | HSBC | 3.792 | 35.610 | NorthWestern Corp | Barclays Bank | (5.342) |
| (14.139) | NN Inc | Morgan Stanley | (1.414) | 13.296 | NorthWestern Corp | Goldman Sachs | 5.451 |
| 1.234 | Noble Corp | Barclays Bank | 5.072 | 18.998 | NorthWestern Corp | HSBC | 35.336 |
| 20.694 | Noodles & Co | Barclays Bank | 20.694 | 13.211 | NorthWestern Corp | Morgan Stanley | (1.982) |
| 10.442 | Noodles & Co | Goldman Sachs | 10.129 | (7.605) | NortonLifeLock Inc | Barclays Bank | (228) |
| 71.029 | Nordic American Tankers Ltd | Goldman Sachs | (38.356) | (26.529) | NortonLifeLock Inc | Goldman Sachs | (19.897) |
| 2.846 | Nordic American Tankers Ltd | Morgan Stanley | (427) | (24.416) | NortonLifeLock Inc | HSBC | (4.732) |
| 1.497 | Nordson Corp | Bank of America Merrill Lynch | 9.020 | 17.776 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 533 |
| 4.191 | Nordson Corp | Barclays Bank | 37.694 | 79.243 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | Barclays Bank | 80.828 |
| 2.311 | Nordson Corp | Goldman Sachs | 11.786 | 5.040 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | Goldman Sachs | 151 |
| 6.509 | Nordson Corp | HSBC | 47.224 | 38.539 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | HSBC | 6.551 |
| 2.125 | Nordson Corp | Morgan Stanley | 20.995 | 7.222 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | Morgan Stanley | 7.366 |
| 2.576 | Nordstrom Inc | Bank of America Merrill Lynch | 8.866 | (2.074) | Norwood Financial Corp | Barclays Bank | 1.276 |
| 17.929 | Nordstrom Inc | Barclays Bank | 79.246 | (758) | Norwood Financial Corp | HSBC | 1.004 |
| 18.752 | Nordstrom Inc | Goldman Sachs | 33.995 | (860) | Norwood Financial Corp | Morgan Stanley | 529 |
| 7.345 | Nordstrom Inc | HSBC | 21.578 | (18.981) | NOV Inc | Bank of America Merrill Lynch | (35.874) |
| 9.097 | Nordstrom Inc | Morgan Stanley | 42.196 | (26.279) | NOV Inc | Barclays Bank | (37.579) |
| 3.775 | Norfolk Southern Corp | Bank of America Merrill Lynch | (19.167) | (59.913) | NOV Inc | Goldman Sachs | (113.235) |
| 6.782 | Norfolk Southern Corp | Barclays Bank | 51.604 | (28.681) | NOV Inc | HSBC | (84.182) |
| 7.410 | Norfolk Southern Corp | Goldman Sachs | (31.859) | (13.020) | NOV Inc | Morgan Stanley | (18.619) |
| 5.927 | Norfolk Southern Corp | HSBC | (42.249) | 3.176 | Novagold Resources Inc | Bank of America Merrill Lynch | 730 |
| 2.239 | Norfolk Southern Corp | Morgan Stanley | 16.913 | 108.466 | Novagold Resources Inc | Barclays Bank | 5.423 |
| (5.490) | Northeast Bank | Bank of America Merrill Lynch | (10.376) | 111.366 | Novagold Resources Inc | Goldman Sachs | 25.614 |
| (628) | Northeast Bank | Goldman Sachs | (1.187) | 13.667 | Novagold Resources Inc | HSBC | 4.100 |
| (5.774) | Northeast Bank | HSBC | (12.645) | 700 | Novagold Resources Inc | Morgan Stanley | 35 |
| (1.826) | Northeast Bank | Morgan Stanley | (2.301) | (10.041) | Novanta Inc | Barclays Bank | 5.824 |
| (17.683) | Northern Oil and Gas Inc | Goldman Sachs | (96.549) | (4.579) | Novanta Inc | Goldman Sachs | 14.012 |
| (12.784) | Northern Oil and Gas Inc | HSBC | (98.565) | (731) | Novanta Inc | HSBC | (4.496) |
| (941) | Northern Oil and Gas Inc | Morgan Stanley | (4.244) | (2.878) | Novavax Inc | Bank of America Merrill Lynch | (26.075) |
| 1.180 | Northern Technologies International Corp | Goldman Sachs | 389 | (2.426) | Novavax Inc | Barclays Bank | (17.049) |
| 6.051 | Northern Technologies International Corp | Morgan Stanley | 4.296 | (767) | Novavax Inc | Goldman Sachs | (6.949) |
| (3.773) | Northern Trust Corp | Barclays Bank | (20.110) | (714) | Novavax Inc | Morgan Stanley | (4.041) |
| (15.473) | Northern Trust Corp | Goldman Sachs | (124.491) | (6.026) | Novocure Ltd | Barclays Bank | (25.792) |
| (3.067) | Northern Trust Corp | HSBC | (20.733) | (4.432) | Novocure Ltd | Goldman Sachs | (62.080) |
| (91.670) | Northfield Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (19.251) | (658) | Novocure Ltd | HSBC | (12.186) |
| (30.035) | Northfield Bancorp Inc | Barclays Bank | (6.608) | (5.471) | Novocure Ltd | Morgan Stanley | (23.416) |
| (40.622) | Northfield Bancorp Inc | Goldman Sachs | (8.531) | (59.920) | Novume Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (14.381) |
| (12.235) | Northfield Bancorp Inc | HSBC | 612 | (24.176) | Novume Solutions Inc | Barclays Bank | (5.077) |
| (13.691) | Northfield Bancorp Inc | Morgan Stanley | (3.012) | (4.322) | Novume Solutions Inc | HSBC | (951) |
| 3.775 | Northrim BanCorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 10.645 | (226) | Novume Solutions Inc | Morgan Stanley | (47) |
| 27.480 | Northrim BanCorp Inc | Barclays Bank | 49.739 | (11.506) | NOW Inc | Barclays Bank | (7.939) |
| 18.563 | Northrim BanCorp Inc | Goldman Sachs | 52.348 | (4.621) | NRG Energy Inc | Barclays Bank | 416 |
| 10.186 | Northrim BanCorp Inc | HSBC | 11.612 | 27.232 | NRG Energy Inc | Goldman Sachs | 55.009 |
| 265 | Northrim BanCorp Inc | Morgan Stanley | 480 | 16.886 | NRG Energy Inc | Morgan Stanley | (1.520) |
| (19.785) | Northwest Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (8.843) | (11.184) | NRG Energy Inc | Morgan Stanley | 1.007 |
| (101.547) | Northwest Bancshares Inc | Barclays Bank | (23.356) | (2.523) | Nu Skin Enterprises Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.690) |
| (54.545) | Northwest Bancshares Inc | Goldman Sachs | (29.156) | (10.307) | Nu Skin Enterprises Inc 'A' | Barclays Bank | (12.059) |
| (38.621) | Northwest Bancshares Inc | HSBC | (18.406) | | | | |
| (32.360) | Northwest Bancshares Inc | Morgan Stanley | (7.443) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (6.903) | Nu Skin Enterprises Inc 'A' | Goldman Sachs | (4.625) | 6.480 | Oak Valley Bancorp | Barclays Bank | — |
| (6.437) | Nucor Corp | Barclays Bank | (54.843) | 10.269 | Oak Valley Bancorp | Goldman Sachs | (2.156) |
| (4.226) | Nucor Corp | Goldman Sachs | (66.468) | 6.612 | Oak Valley Bancorp | HSBC | (1.719) |
| (10.239) | Nucor Corp | HSBC | (49.100) | 3.345 | Oak Valley Bancorp | Morgan Stanley | — |
| (11.211) | Nucor Corp | Morgan Stanley | (95.517) | 1.766 | Oasis Petroleum Inc | Bank of America | — |
| (3.169) | Nurix Therapeutics Inc | Barclays Bank | 380 | | | Merrill Lynch | 38.658 |
| (3.660) | Nurix Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.061) | 625 | Oasis Petroleum Inc | Barclays Bank | 8.469 |
| 32.437 | Nutanix Inc 'A' | Barclays Bank | (162.509) | 2.727 | Oasis Petroleum Inc | Goldman Sachs | 59.694 |
| 20.292 | Nutanix Inc 'A' | Goldman Sachs | (106.869) | 5.625 | Oasis Petroleum Inc | HSBC | 147.917 |
| 28.559 | Nutanix Inc 'A' | HSBC | (132.593) | 370 | Oasis Petroleum Inc | Morgan Stanley | 5.014 |
| (1.266) | Nuvalent Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.494) | (642) | Occidental Petroleum Corp | Bank of America | — |
| (6.651) | Nuvalent Inc 'A' | HSBC | (4.257) | | | Merrill Lynch | (3.139) |
| (864) | NuVasive Inc | Bank of America | — | 998 | Occidental Petroleum Corp | Bank of America | — |
| | | Merrill Lynch | (3.594) | | | Merrill Lynch | 4.880 |
| (5.396) | NuVasive Inc | Barclays Bank | (14.104) | 3.757 | Occidental Petroleum Corp | Bank of America | — |
| 20.185 | Nuvation Bio Inc | Barclays Bank | (5.652) | | | Merrill Lynch | 18.334 |
| 34.161 | Nuvation Bio Inc | Goldman Sachs | (18.789) | 1.112 | Occidental Petroleum Corp | Barclays Bank | 7.984 |
| 7.243 | Nuvve Holding Corp | Barclays Bank | 4.491 | 3.458 | Occidental Petroleum Corp | Goldman Sachs | 18.303 |
| 4.756 | Nuvve Holding Corp | Goldman Sachs | 2.806 | (3.362) | Occidental Petroleum Corp | HSBC | (49.119) |
| (1.409) | NV5 Global Inc | Barclays Bank | (12.089) | 3.371 | Occidental Petroleum Corp | HSBC | 49.400 |
| (2.347) | NV5 Global Inc | Goldman Sachs | (21.827) | 2.916 | Occidental Petroleum Corp | HSBC | 42.603 |
| (2.299) | NV5 Global Inc | HSBC | (24.199) | (1.729) | Occidental Petroleum Corp | Morgan Stanley | (12.259) |
| (690) | NV5 Global Inc | Morgan Stanley | (4.403) | 1.189 | Occidental Petroleum Corp | Morgan Stanley | 9.804 |
| (1.849) | NVE Corp | Bank of America | — | 79 | Ocean Bio-Chem Inc | Bank of America | — |
| | | Merrill Lynch | (2.884) | | | Merrill Lynch | (36) |
| (13.725) | NVE Corp | Barclays Bank | (2.745) | 578 | Ocean Bio-Chem Inc | Barclays Bank | (92) |
| (8.692) | NVE Corp | Goldman Sachs | (13.560) | 4.425 | Oceaneering International Inc | Bank of America | — |
| (2.315) | NVE Corp | HSBC | (6.968) | | | Merrill Lynch | 8.850 |
| (895) | NVE Corp | Morgan Stanley | (179) | 24.087 | Oceaneering International Inc | Barclays Bank | 28.182 |
| 3.317 | nVent Electric Plc | Bank of America | — | 51.397 | Oceaneering International Inc | Goldman Sachs | 102.794 |
| | | Merrill Lynch | 2.919 | 22.300 | Oceaneering International Inc | HSBC | 47.722 |
| 40.778 | nVent Electric Plc | Barclays Bank | 19.981 | 9.356 | Oceaneering International Inc | Morgan Stanley | 10.947 |
| 23.552 | nVent Electric Plc | Goldman Sachs | 20.725 | 23.365 | OceanFirst Financial Corp | Bank of America | — |
| 14.262 | nVent Electric Plc | HSBC | 15.260 | | | Merrill Lynch | 17.469 |
| 2.539 | nVent Electric Plc | Morgan Stanley | 1.244 | 115.623 | OceanFirst Financial Corp | Barclays Bank | 63.593 |
| (969) | NVIDIA Corp | Bank of America | — | 46.543 | OceanFirst Financial Corp | HSBC | 29.322 |
| | | Merrill Lynch | (12.568) | 42.685 | OceanFirst Financial Corp | Morgan Stanley | 23.477 |
| (2.082) | NVIDIA Corp | Barclays Bank | (34.624) | (680) | Oconee Federal Financial Corp | Barclays Bank | (469) |
| (2.057) | NVIDIA Corp | Goldman Sachs | (26.402) | (27.807) | Ocugen Inc | Barclays Bank | (5.561) |
| 4.091 | NVIDIA Corp | Goldman Sachs | 68.373 | (3.634) | Ocular Therapeutix Inc | Barclays Bank | 563 |
| (1.631) | NVIDIA Corp | HSBC | (25.263) | (16.813) | Ocular Therapeutix Inc | Goldman Sachs | 3.951 |
| (1.427) | NVIDIA Corp | Morgan Stanley | (23.731) | (7.196) | Ocular Therapeutix Inc | HSBC | 971 |
| 973 | NVIDIA Corp | Morgan Stanley | 16.181 | 4.508 | Ocwen Financial Corp | Barclays Bank | 4.373 |
| (76) | NVR Inc | Bank of America | — | 3.306 | Ocwen Financial Corp | Goldman Sachs | 16.728 |
| | | Merrill Lynch | (13.402) | 1.246 | Ocwen Financial Corp | HSBC | 5.433 |
| (65) | NVR Inc | Barclays Bank | (11.130) | (1.964) | ODP Corp | Barclays Bank | 1.650 |
| (273) | NVR Inc | Goldman Sachs | (42.286) | (7.108) | ODP Corp | Goldman Sachs | 22.319 |
| (173) | NVR Inc | HSBC | (2.147) | (4.508) | ODP Corp | HSBC | 20.196 |
| (281) | NVR Inc | Morgan Stanley | (48.119) | (10.017) | Offerpad Solutions Inc | Barclays Bank | 4.107 |
| (514) | NXP Semiconductors NV | Bank of America | — | (4.382) | Offerpad Solutions Inc | HSBC | 438 |
| | | Merrill Lynch | (7.217) | 12.943 | Office Properties Income Trust (REIT) | Bank of America | — |
| (11.906) | NXP Semiconductors NV | Barclays Bank | (123.108) | | | Merrill Lynch | 9.433 |
| 4.844 | NXP Semiconductors NV | Goldman Sachs | 68.010 | 5.300 | Office Properties Income Trust (REIT) | Barclays Bank | 2.226 |
| (759) | NXP Semiconductors NV | Goldman Sachs | (9.087) | 11.100 | Office Properties Income Trust (REIT) | Goldman Sachs | 9.102 |
| (3.568) | NXP Semiconductors NV | HSBC | (50.470) | 3.203 | Office Properties Income Trust (REIT) | HSBC | 3.031 |
| 600 | NXP Semiconductors NV | Morgan Stanley | 6.204 | 17.415 | Office Properties Income Trust (REIT) | Morgan Stanley | 7.314 |
| (4.968) | NXP Semiconductors NV | Morgan Stanley | (51.369) | (1.209) | OFG Bancorp | HSBC | (342) |
| 4.708 | Nymox Pharmaceutical Corp | Bank of America | — | 18.499 | OGE Energy Corp | Bank of America | — |
| | | Merrill Lynch | (4.402) | | | Merrill Lynch | 31.633 |
| 21.780 | Nymox Pharmaceutical Corp | Goldman Sachs | (20.364) | 57.717 | OGE Energy Corp | Barclays Bank | 53.677 |
| 46.926 | Nymox Pharmaceutical Corp | Morgan Stanley | (1.666) | 42.960 | OGE Energy Corp | Goldman Sachs | 73.462 |
| (5.222) | Oak Street Health Inc | Bank of America | — | | | | |
| | | Merrill Lynch | (9.608) | | | | |
| 12.860 | Oak Street Health Inc | Goldman Sachs | 23.662 | | | | |
| (4.875) | Oak Street Health Inc | Goldman Sachs | (8.970) | | | | |
| 4.971 | Oak Street Health Inc | HSBC | 12.974 | | | | |
| 899 | Oak Street Health Inc | Morgan Stanley | 872 | | | | |
| (2.961) | Oak Street Health Inc | Morgan Stanley | (2.872) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------|---|-----------------|---|----------|---|-----------------|---|
| | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | |
| 7.244 | OGE Energy Corp | HSBC | 13.981 | (2.350) | Olin Corp | Bank of America | |
| 157.824 | OGE Energy Corp | Morgan Stanley | 146.776 | | | Merrill Lynch | (9.189) |
| (1.627) | Ohio Valley Banc Corp | Bank of America | | (17.716) | Olin Corp | Barclays Bank | (54.565) |
| | | Merrill Lynch | 586 | (8.016) | Olin Corp | Morgan Stanley | (24.689) |
| (1.071) | Ohio Valley Banc Corp | Morgan Stanley | 1.157 | (631) | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Bank of America | |
| (41.642) | O-I Glass Inc | Barclays Bank | (73.706) | | | Merrill Lynch | 907 |
| (3.499) | O-I Glass Inc | Goldman Sachs | (8.573) | 2.164 | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Barclays Bank | 6.579 |
| (13.376) | O-I Glass Inc | HSBC | (40.839) | (5.868) | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.467) |
| (2.476) | O-I Glass Inc | Morgan Stanley | (4.383) | | | | |
| 39.132 | Oil States International Inc | Barclays Bank | 34.045 | 1.466 | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Goldman Sachs | 367 |
| 31.201 | Oil States International Inc | Goldman Sachs | 26.833 | 954 | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.900 |
| 42.416 | Oil States International Inc | HSBC | 70.411 | | | | |
| (7.002) | Oil-Dri Corp of America | Goldman Sachs | 2.661 | 1.172 | Olympic Steel Inc | Bank of America | 3.551 |
| (2.153) | Oil-Dri Corp of America | HSBC | 3.186 | | | Merrill Lynch | (3.864) |
| 2.651 | Okta Inc | Bank of America | | 7.025 | Olympic Steel Inc | Barclays Bank | 53.158 |
| | | Merrill Lynch | (3.238) | 17.544 | Olympic Steel Inc | Goldman Sachs | 1.016 |
| 1.830 | Okta Inc | Barclays Bank | 2.452 | 342 | Omega Flex Inc | Morgan Stanley | |
| 4.529 | Okta Inc | Goldman Sachs | (15.370) | (15.747) | Omega Healthcare Investors Inc (REIT) | Bank of America | 1.701 |
| 2.461 | Okta Inc | HSBC | (9.053) | (19.253) | Omega Healthcare Investors Inc (REIT) | Barclays Bank | (21.178) |
| 983 | Okta Inc | Morgan Stanley | 1.317 | (50.115) | Omega Healthcare Investors Inc (REIT) | Goldman Sachs | (24.125) |
| (19.598) | Olaplex Holdings Inc | Bank of America | | (22.500) | Omega Healthcare Investors Inc (REIT) | HSBC | (35.550) |
| | | Merrill Lynch | (50.759) | (8.937) | Omega Healthcare Investors Inc (REIT) | Morgan Stanley | (9.831) |
| (25.131) | Olaplex Holdings Inc | Goldman Sachs | (65.089) | 13.377 | Omega Therapeutics Inc | Barclays Bank | (2.675) |
| (22.941) | Olaplex Holdings Inc | HSBC | (89.453) | 2.756 | Omega Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (744) |
| (1.357) | Old Dominion Freight Line Inc | Bank of America | | 306 | Omega Therapeutics Inc | HSBC | (67) |
| | | Merrill Lynch | 9.295 | 18.594 | Omeros Corp | Bank of America | (8.925) |
| 4.998 | Old Dominion Freight Line Inc | Barclays Bank | 27.839 | | | Merrill Lynch | (4.319) |
| (551) | Old Dominion Freight Line Inc | Barclays Bank | (3.069) | 15.425 | Omeros Corp | Barclays Bank | (4.304) |
| 775 | Old Dominion Freight Line Inc | Goldman Sachs | (5.309) | 8.966 | Omeros Corp | Goldman Sachs | (551) |
| (449) | Old Dominion Freight Line Inc | Goldman Sachs | 3.076 | 3.934 | Omeros Corp | HSBC | (2.183) |
| (531) | Old Dominion Freight Line Inc | HSBC | 7.995 | 7.795 | Omeros Corp | Morgan Stanley | (2.183) |
| 11.026 | Old National Bancorp | Bank of America | 4.741 | 8.066 | Omniceil Inc | Barclays Bank | 3.065 |
| (14.212) | Old National Bancorp | Bank of America | | 10.834 | Omniceil Inc | Goldman Sachs | 22.969 |
| | | Merrill Lynch | (6.111) | 4.051 | Omniceil Inc | HSBC | (2.795) |
| 156.794 | Old National Bancorp | Barclays Bank | 23.672 | 325 | Omniceil Inc | Morgan Stanley | 55 |
| (21.340) | Old National Bancorp | Barclays Bank | (3.841) | 3.316 | Omnicom Group Inc | Bank of America | |
| 125.020 | Old National Bancorp | Goldman Sachs | 53.759 | | | Merrill Lynch | (8.787) |
| (7.665) | Old National Bancorp | Goldman Sachs | (3.296) | 2.865 | Omnicom Group Inc | Barclays Bank | (4.326) |
| 44.073 | Old National Bancorp | HSBC | 12.208 | 8.033 | Omnicom Group Inc | Goldman Sachs | (13.912) |
| (28.471) | Old National Bancorp | HSBC | (5.345) | 8.747 | Omnicom Group Inc | HSBC | (25.706) |
| 16.089 | Old National Bancorp | Morgan Stanley | 3.358 | 2.003 | Omnicom Group Inc | Morgan Stanley | 7.095 |
| (10.430) | Old National Bancorp | Morgan Stanley | (1.877) | (2.735) | ON Semiconductor Corp | Barclays Bank | (10.966) |
| 6.701 | Old Republic International Corp | Bank of America | | (11.990) | ON Semiconductor Corp | Goldman Sachs | (58.151) |
| | | Merrill Lynch | 5.428 | (18.595) | ON Semiconductor Corp | HSBC | (164.140) |
| 85.774 | Old Republic International Corp | Barclays Bank | 54.895 | (1.864) | ON Semiconductor Corp | Morgan Stanley | (7.661) |
| 90.704 | Old Republic International Corp | Goldman Sachs | 73.470 | 15.681 | ON24 Inc | HSBC | 19.288 |
| 37.267 | Old Republic International Corp | HSBC | 36.894 | 3.961 | ON24 Inc | Morgan Stanley | 3.248 |
| 38.792 | Old Republic International Corp | Morgan Stanley | 24.827 | (12.359) | Oncocyte Corp | Goldman Sachs | 1.730 |
| 10.289 | Old Second Bancorp Inc | Bank of America | | (14.620) | Oncocyte Corp | HSBC | 1.170 |
| | | Merrill Lynch | 10.495 | (32.664) | Oncocyte Corp | Morgan Stanley | 1.960 |
| 36.685 | Old Second Bancorp Inc | Barclays Bank | 13.207 | 216 | Oncorus Inc | Bank of America | |
| 22.825 | Old Second Bancorp Inc | Goldman Sachs | 23.281 | | | Merrill Lynch | (2) |
| 13.014 | Old Second Bancorp Inc | HSBC | 12.363 | 9.268 | Oncorus Inc | Barclays Bank | (927) |
| 52.884 | Old Second Bancorp Inc | Morgan Stanley | 19.038 | 11.874 | Oncorus Inc | Goldman Sachs | (119) |
| 3.798 | Olema Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | 3.206 | Oncorus Inc | Morgan Stanley | (321) |
| | | Merrill Lynch | 2.583 | 5.848 | Oncernal Therapeutics Inc | Bank of America | |
| 3.827 | Olema Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 1.952 | | | Merrill Lynch | 3.359 |
| 22.059 | Olema Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 15.000 | 3.627 | Oncernal Therapeutics Inc | Barclays Bank | 1.796 |
| 10.150 | Olema Pharmaceuticals Inc | HSBC | 8.323 | 3.484 | Oncernal Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 2.001 |
| 26.186 | Olema Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 13.355 | 7.969 | Oncernal Therapeutics Inc | HSBC | 2.627 |
| | | | | (32.170) | Ondas Holdings Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (16.085) |
| | | | | (12.840) | Ondas Holdings Inc | Barclays Bank | (5.393) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 4.781 | ONE Gas Inc | Bank of America | | 3.044 | Ooma Inc | HSBC | 4.536 |
| | | Merrill Lynch | 1.352 | 14.487 | Ooma Inc | Morgan Stanley | 5.650 |
| 26.256 | ONE Gas Inc | Barclays Bank | 1.557 | 23.388 | OP Bancorp | Goldman Sachs | 8.887 |
| (5.687) | ONE Gas Inc | Barclays Bank | (739) | 23.417 | OP Bancorp | Morgan Stanley | 8.898 |
| 33.006 | ONE Gas Inc | Goldman Sachs | 27.471 | 10.765 | Open Lending Corp 'A' | Bank of America | |
| 20.786 | ONE Gas Inc | HSBC | 25.089 | | | Merrill Lynch | 4.161 |
| (7.409) | ONE Gas Inc | HSBC | (9.970) | 6.152 | Open Lending Corp 'A' | Barclays Bank | 1.538 |
| 7.064 | ONE Gas Inc | Morgan Stanley | (3.885) | 19.181 | Open Lending Corp 'A' | Goldman Sachs | 7.424 |
| (2.500) | ONE Gas Inc | Morgan Stanley | (325) | 2.653 | Open Lending Corp 'A' | HSBC | (516) |
| 2.426 | ONE Group Hospitality Inc | Bank of America | | 8.343 | Open Lending Corp 'A' | Morgan Stanley | 2.086 |
| | | Merrill Lynch | 1.650 | 5.480 | Opendoor Technologies Inc | Bank of America | |
| 2.284 | ONE Group Hospitality Inc | Barclays Bank | 1.782 | | | Merrill Lynch | 493 |
| 11.602 | ONE Group Hospitality Inc | Morgan Stanley | 9.050 | (4.086) | Opendoor Technologies Inc | Bank of America | |
| (46.395) | One Liberty Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (58.922) | | | Merrill Lynch | (368) |
| (44.641) | One Liberty Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (47.319) | 12.156 | Opendoor Technologies Inc | Barclays Bank | 5.835 |
| (8.123) | One Liberty Properties Inc (REIT) | HSBC | (18.764) | (41.390) | Opendoor Technologies Inc | Barclays Bank | (19.867) |
| (5.445) | OneMain Holdings Inc | Bank of America | | 10.201 | Opendoor Technologies Inc | Goldman Sachs | 918 |
| | | Merrill Lynch | (12.193) | 31.522 | Opendoor Technologies Inc | HSBC | 39.402 |
| 3.332 | OneMain Holdings Inc | Bank of America | | 13.313 | OPKO Health Inc | HSBC | 8.520 |
| | | Merrill Lynch | 5.764 | 11.583 | OPKO Health Inc | Morgan Stanley | (232) |
| (2.878) | OneMain Holdings Inc | Barclays Bank | (5.180) | 8.079 | Oportun Financial Corp | Bank of America | |
| (3.468) | OneMain Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.670) | | | Merrill Lynch | (1.858) |
| 6.738 | OneMain Holdings Inc | Goldman Sachs | 5.884 | 13.126 | Oportun Financial Corp | Barclays Bank | (656) |
| (15.893) | OneMain Holdings Inc | HSBC | (33.517) | 24.548 | Oportun Financial Corp | Goldman Sachs | (5.646) |
| 973 | OneMain Holdings Inc | HSBC | 1.522 | 11.809 | Oportun Financial Corp | HSBC | 2.008 |
| (2.300) | OneMain Holdings Inc | Morgan Stanley | (4.140) | 4.016 | Oportun Financial Corp | Morgan Stanley | (201) |
| (14.436) | ONEOK Inc | Bank of America | | (862) | Oppenheimer Holdings Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (18.443) | (7.954) | Oppenheimer Holdings Inc 'A' | Merrill Lynch | (2.113) |
| (8.865) | ONEOK Inc | Barclays Bank | (28.988) | (1.516) | Oppenheimer Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (11.430) |
| (34.665) | ONEOK Inc | Goldman Sachs | (60.016) | (3.107) | Oppenheimer Holdings Inc 'A' | HSBC | (191) |
| (19.286) | ONEOK Inc | HSBC | (66.717) | (1.646) | OptimizeRx Corp | Morgan Stanley | (5.624) |
| (15.746) | ONEOK Inc | Morgan Stanley | (51.714) | | | Bank of America | |
| (24.892) | OneSpan Inc | Barclays Bank | (8.712) | (2.310) | OptimizeRx Corp | Merrill Lynch | (1.959) |
| (38.203) | OneSpan Inc | Goldman Sachs | (55.012) | (5.283) | OptimizeRx Corp | Barclays Bank | 185 |
| (6.437) | OneSpan Inc | HSBC | (12.423) | (3.912) | OptimizeRx Corp | Goldman Sachs | (3.720) |
| (21.339) | OneSpan Inc | Morgan Stanley | (7.469) | (13.315) | OptimizeRx Corp | HSBC | (6.729) |
| 7.676 | OneSpaWorld Holdings Ltd | Bank of America | | 66.840 | Optinose Inc | Morgan Stanley | 1.065 |
| | | Merrill Lynch | 1.535 | 27.036 | Optinose Inc | Barclays Bank | 9.358 |
| 31.697 | OneSpaWorld Holdings Ltd | Barclays Bank | (2.219) | 30.661 | Optinose Inc | Goldman Sachs | 5.407 |
| 31.722 | OneSpaWorld Holdings Ltd | Goldman Sachs | 6.344 | 26.068 | Optinose Inc | HSBC | 2.759 |
| 35.093 | OneSpaWorld Holdings Ltd | HSBC | 12.468 | (9.583) | Option Care Health Inc | Morgan Stanley | 3.650 |
| 12.260 | OneSpaWorld Holdings Ltd | Morgan Stanley | (858) | | | Bank of America | |
| (2.255) | OneWater Marine Inc 'A' | Bank of America | | (23.620) | Option Care Health Inc | Merrill Lynch | (17.921) |
| | | Merrill Lynch | (699) | (9.644) | Option Care Health Inc | Barclays Bank | (47.240) |
| (14.127) | OneWater Marine Inc 'A' | Barclays Bank | (13.986) | (11.322) | Option Care Health Inc | Goldman Sachs | (18.034) |
| (2.562) | OneWater Marine Inc 'A' | HSBC | 3.741 | (13.597) | Option Care Health Inc | HSBC | (26.438) |
| (1.314) | OneWater Marine Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.301) | (260) | Oracle Corp | Morgan Stanley | (27.194) |
| (825) | Onto Innovation Inc | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (5.750) | (35.466) | Oracle Corp | Merrill Lynch | (551) |
| 1.186 | Onto Innovation Inc | Bank of America | | (18.880) | Oracle Corp | Barclays Bank | (74.124) |
| | | Merrill Lynch | 8.266 | 6.522 | OraMed | Morgan Stanley | (39.459) |
| (3.216) | Onto Innovation Inc | Barclays Bank | (18.588) | | | Barclays Bank | 1.500 |
| 8.388 | Onto Innovation Inc | Barclays Bank | 48.483 | 4.290 | OraMed Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 760 |
| (21.273) | Onto Innovation Inc | Goldman Sachs | (148.273) | 1.853 | OraMed Pharmaceuticals Inc | HSBC | 760 |
| 5.997 | Onto Innovation Inc | Goldman Sachs | 41.799 | 781 | OraMed Pharmaceuticals Inc | HSBC | 760 |
| (2.251) | Onto Innovation Inc | HSBC | (21.848) | | | Morgan Stanley | 180 |
| 1.473 | Onto Innovation Inc | HSBC | 12.882 | (2.676) | OraSure Technologies Inc | Bank of America | |
| (1.607) | Onto Innovation Inc | Morgan Stanley | (9.288) | | | Merrill Lynch | 2.301 |
| 1.048 | Onto Innovation Inc | Morgan Stanley | 6.057 | (9.849) | OraSure Technologies Inc | Barclays Bank | 13.001 |
| (2.519) | Ontrak Inc | Bank of America | | (15.123) | OraSure Technologies Inc | Goldman Sachs | 13.006 |
| | | Merrill Lynch | (529) | (18.681) | OraSure Technologies Inc | HSBC | 25.967 |
| (5.278) | Ontrak Inc | Barclays Bank | (1.478) | (5.383) | Orbital Energy Group Inc | Goldman Sachs | (269) |
| 15.433 | Ooma Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 22.687 | | | | |
| 25.354 | Ooma Inc | Barclays Bank | 9.888 | | | | |
| 15.806 | Ooma Inc | Goldman Sachs | 23.235 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (27.239) | Orchid Island Capital Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (2.860) | 6.797 | Oshkosh Corp | Barclays Bank | 12.931 |
| (76.781) | Orchid Island Capital Inc (REIT) | Barclays Bank | (3.455) | (2.260) | Oshkosh Corp | Goldman Sachs | 816 |
| (66.253) | Orchid Island Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | (6.957) | (10.000) | Oshkosh Corp | HSBC | (12.336) |
| (229.416) | Orchid Island Capital Inc (REIT) | HSBC | (30.971) | 11.082 | Oshkosh Corp | HSBC | 13.631 |
| (30.355) | Orchid Island Capital Inc (REIT) | Morgan Stanley | (1.366) | 11.498 | OSI Systems Inc | Barclays Bank | 7.819 |
| (2.272) | O'Reilly Automotive Inc | Barclays Bank | (145.158) | 4.397 | OSI Systems Inc | Goldman Sachs | 7.387 |
| (1.230) | O'Reilly Automotive Inc | Goldman Sachs | (1.043) | 24.337 | OSI Systems Inc | Morgan Stanley | 16.549 |
| (1.396) | O'Reilly Automotive Inc | HSBC | (45.970) | 801 | Otis Worldwide Corp | Bank of America Merrill Lynch | (873) |
| (27.630) | Organogenesis Holdings Inc | Barclays Bank | (1.934) | 3.350 | Otis Worldwide Corp | Barclays Bank | 1.005 |
| (14.502) | Organon & Co | Barclays Bank | (5.365) | 32.705 | Otis Worldwide Corp | Goldman Sachs | (3.311) |
| (17.947) | Organon & Co | Goldman Sachs | (42.297) | 954 | Otis Worldwide Corp | HSBC | 275 |
| 2.019 | Orgenesis Inc | Bank of America Merrill Lynch | (464) | 1.891 | Otis Worldwide Corp | Morgan Stanley | 567 |
| 7.279 | Orgenesis Inc | Barclays Bank | 2.766 | (1.669) | Otter Tail Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.217) |
| 6.742 | Orgenesis Inc | Goldman Sachs | (1.551) | (21.002) | Otter Tail Corp | Barclays Bank | (29.110) |
| 6.736 | Orgenesis Inc | Morgan Stanley | 2.560 | (7.390) | Otter Tail Corp | Goldman Sachs | (15.557) |
| (13.802) | ORIC Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (3.036) | (1.814) | Otter Tail Corp | HSBC | (2.617) |
| (11.856) | ORIC Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 237 | (1.952) | Otter Tail Corp | Morgan Stanley | (1.269) |
| 4.118 | Origin Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.889 | 30.193 | Ouster Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.404) |
| 34.234 | Origin Bancorp Inc | Barclays Bank | 30.173 | 11.666 | Ouster Inc | Barclays Bank | (992) |
| 35.539 | Origin Bancorp Inc | Goldman Sachs | 49.983 | 11.160 | Ouster Inc | HSBC | (5.413) |
| 24.579 | Origin Bancorp Inc | HSBC | 8.357 | 48.571 | Outbrain Inc | Barclays Bank | 1.457 |
| 7.452 | Origin Bancorp Inc | Morgan Stanley | 6.781 | 12.194 | Outbrain Inc | Goldman Sachs | 2.561 |
| 70.084 | Origin Materials Inc | Barclays Bank | 18.923 | 2.598 | Outbrain Inc | HSBC | (6.547) |
| (9.331) | Orion Energy Systems Inc | Barclays Bank | 1.026 | 2.607 | Outbrain Inc | Morgan Stanley | 78 |
| (46.866) | Orion Engineered Carbons SA | Goldman Sachs | (79.204) | 10.329 | Outfront Media Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (2.025) |
| (4.817) | Orion Engineered Carbons SA | HSBC | (11.127) | 97.280 | Outfront Media Inc (REIT) | Barclays Bank | 39.109 |
| 6.129 | Orion Office Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.630 | 64.640 | Outfront Media Inc (REIT) | Goldman Sachs | (18.263) |
| 22.889 | Orion Office Inc (REIT) | Barclays Bank | 6.867 | 87.424 | Outfront Media Inc (REIT) | HSBC | (16.469) |
| (32.305) | Orion Office Inc (REIT) | Barclays Bank | (9.692) | 12.381 | Outfront Media Inc (REIT) | Morgan Stanley | 4.334 |
| 8.963 | Orion Office Inc (REIT) | Goldman Sachs | 2.609 | (55.361) | Outlook Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 44.943 |
| (11.842) | Orion Office Inc (REIT) | Goldman Sachs | (5.210) | (34.682) | Outlook Therapeutics Inc | HSBC | 24.534 |
| (14.621) | Orion Office Inc (REIT) | HSBC | (9.065) | (11.688) | Outlook Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 9.350 |
| 1.873 | Orion Office Inc (REIT) | Morgan Stanley | 562 | (6.984) | Outset Medical Inc | Barclays Bank | 13.479 |
| (25.247) | Ormat Technologies Inc | Barclays Bank | (141.636) | (4.281) | Outset Medical Inc | Goldman Sachs | 16.268 |
| (11.787) | Ormat Technologies Inc | Goldman Sachs | (128.361) | (6.874) | Outset Medical Inc | HSBC | 7.424 |
| (8.135) | Ormat Technologies Inc | HSBC | (71.425) | (1.356) | Outset Medical Inc | Morgan Stanley | 2.617 |
| (1.558) | Ormat Technologies Inc | Morgan Stanley | (8.740) | (138.038) | Overseas Shipholding Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (12.423) |
| 4.585 | Orrstown Financial Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.714 | (25.219) | Overseas Shipholding Group Inc 'A' | Barclays Bank | (3.278) |
| 11.022 | Orrstown Financial Services Inc | Barclays Bank | 7.054 | (11.707) | Overseas Shipholding Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.054) |
| 9.211 | Orrstown Financial Services Inc | Goldman Sachs | 7.461 | (9.870) | Overseas Shipholding Group Inc 'A' | HSBC | (2.073) |
| 11.169 | Orrstown Financial Services Inc | HSBC | 7.801 | 1.516 | Overstock.com Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.760 |
| 1.015 | Orrstown Financial Services Inc | Morgan Stanley | 650 | 9.123 | Overstock.com Inc | Goldman Sachs | 27.492 |
| 8.937 | Orthofix Medical Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.860) | 8.568 | Overstock.com Inc | HSBC | (18.335) |
| 20.762 | Orthofix Medical Inc | Barclays Bank | 3.322 | (11.490) | Ovid therapeutics Inc | Barclays Bank | 2.068 |
| 7.505 | Orthofix Medical Inc | Goldman Sachs | (2.402) | (29.084) | Ovid therapeutics Inc | Goldman Sachs | 9.889 |
| 1.469 | Orthofix Medical Inc | HSBC | (823) | 5.858 | Ovintiv Inc | Bank of America Merrill Lynch | 71.369 |
| 4.449 | Orthofix Medical Inc | Morgan Stanley | 712 | 30.733 | Ovintiv Inc | Barclays Bank | 253.505 |
| (4.610) | OrthoPediatrics Corp | Bank of America Merrill Lynch | (11.940) | 29.979 | Ovintiv Inc | Goldman Sachs | 408.234 |
| (545) | OrthoPediatrics Corp | Barclays Bank | (921) | 1.659 | Ovintiv Inc | HSBC | 17.901 |
| (5.095) | OrthoPediatrics Corp | Goldman Sachs | (13.196) | 3.420 | Ovintiv Inc | Morgan Stanley | 28.283 |
| (549) | OrthoPediatrics Corp | HSBC | (2.057) | (1.883) | Owens & Minor Inc | Bank of America Merrill Lynch | 659 |
| (6.155) | OrthoPediatrics Corp | Morgan Stanley | (10.402) | (7.580) | Owens & Minor Inc | Goldman Sachs | 2.653 |
| (1.056) | Oshkosh Corp | Barclays Bank | 740 | (5.537) | Owens & Minor Inc | HSBC | 7.608 |
| | | | | (3.449) | Owens & Minor Inc | Morgan Stanley | (517) |
| | | | | 1.117 | Owens Corning | Bank of America Merrill Lynch | 1.765 |
| | | | | 5.439 | Owens Corning | Barclays Bank | 12.945 |
| | | | | 27.750 | Owens Corning | Goldman Sachs | 43.845 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 14.885 | Owens Corning | Morgan Stanley | 35.426 | (8.804) | PAM Transportation Services Inc | Morgan Stanley | 4.402 |
| 1.926 | Oxford Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9.476 | 10.265 | Pan American Silver Corp (Right) | Bank of America Merrill Lynch | 103 |
| 2.706 | Oxford Industries Inc | Barclays Bank | 17.589 | 46.959 | Pan American Silver Corp (Right) | Goldman Sachs | 470 |
| 2.537 | Oxford Industries Inc | Goldman Sachs | 12.482 | 21.553 | Pan American Silver Corp (Right) | Morgan Stanley | 216 |
| 4.964 | Oxford Industries Inc | HSBC | 35.954 | (48.986) | Pangaea Logistics Solutions Ltd | Barclays Bank | (8.817) |
| 1.160 | Oxford Industries Inc | Morgan Stanley | 7.540 | (12.333) | Pangaea Logistics Solutions Ltd | Goldman Sachs | (16.033) |
| 8.427 | Oyster Point Pharma Inc | Goldman Sachs | (6.742) | (16.851) | Pangaea Logistics Solutions Ltd | HSBC | (33.533) |
| 3.594 | Oyster Point Pharma Inc | HSBC | (4.205) | 5.099 | Papa John's International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 29.471 |
| 6.392 | PACCAR Inc | Bank of America Merrill Lynch | 8.865 | 9.108 | Papa John's International Inc | Barclays Bank | 85.889 |
| 21.630 | PACCAR Inc | Barclays Bank | 71.523 | 27.521 | Papa John's International Inc | Goldman Sachs | 153.842 |
| 16.728 | PACCAR Inc | Goldman Sachs | 34.460 | 8.121 | Papa John's International Inc | HSBC | 37.562 |
| 14.854 | PACCAR Inc | HSBC | 17.722 | 6.866 | Papa John's International Inc | Morgan Stanley | 64.747 |
| 18.204 | PACCAR Inc | Morgan Stanley | 62.834 | (2.394) | Par Pacific Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.232) |
| (836) | Pacific Biosciences of California Inc | Bank of America Merrill Lynch | (251) | (6.483) | Par Pacific Holdings Inc | Barclays Bank | (6.289) |
| 14.338 | Pacific Biosciences of California Inc | Barclays Bank | 2.129 | (12.601) | Par Pacific Holdings Inc | Goldman Sachs | (17.011) |
| 6.258 | Pacific Biosciences of California Inc | Goldman Sachs | 1.877 | (12.814) | Par Pacific Holdings Inc | HSBC | (41.902) |
| (8.253) | Pacific Biosciences of California Inc | HSBC | (4.374) | (9.691) | PAR Technology Corp | Barclays Bank | (21.029) |
| 5.510 | Pacific Biosciences of California Inc | HSBC | 2.920 | (3.103) | PAR Technology Corp | HSBC | (21.069) |
| (5.619) | Pacific Premier Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (8.148) | 11.518 | Paragon 28 Inc | Barclays Bank | 10.597 |
| (37.380) | Pacific Premier Bancorp Inc | Barclays Bank | (26.166) | 3.465 | Paragon 28 Inc | HSBC | 11.294 |
| (55.294) | Pacific Premier Bancorp Inc | Goldman Sachs | (75.441) | 12.634 | Paramount Group Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 3.411 |
| (2.616) | Pacific Premier Bancorp Inc | HSBC | (732) | 41.403 | Paramount Group Inc (REIT) | Barclays Bank | 12.421 |
| (2.731) | Pacific Premier Bancorp Inc | Morgan Stanley | (1.912) | 49.723 | Paramount Group Inc (REIT) | Goldman Sachs | 13.425 |
| (2.678) | Pacira BioSciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | (54) | 65.061 | Paramount Group Inc (REIT) | HSBC | 14.964 |
| (5.331) | Pacira BioSciences Inc | Barclays Bank | (2.399) | 74.784 | Paramount Group Inc (REIT) | Morgan Stanley | 22.435 |
| (753) | Pacira BioSciences Inc | Goldman Sachs | (15) | (29.496) | Paratek Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 3.245 |
| (914) | Pacira BioSciences Inc | HSBC | (3.702) | (15.672) | Paratek Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 627 |
| (4.528) | Pacira BioSciences Inc | Morgan Stanley | (2.038) | 6.914 | Pardes Biosciences Inc | Barclays Bank | (4.425) |
| (6.798) | Packaging Corp of America | Barclays Bank | (27.396) | 8.617 | Pardes Biosciences Inc | Goldman Sachs | 259 |
| (3.691) | Packaging Corp of America | Goldman Sachs | (5.278) | 1.872 | Pardes Biosciences Inc | HSBC | (1.853) |
| 3.498 | Packaging Corp of America | Goldman Sachs | (8.581) | (197) | Park Aerospace Corp | Bank of America Merrill Lynch | (18) |
| (9.974) | Packaging Corp of America | HSBC | 38.001 | (63.928) | Park Aerospace Corp | Barclays Bank | (18.539) |
| (54.436) | Pactiv Evergreen Inc | Barclays Bank | (10.887) | (73.633) | Park Aerospace Corp | Goldman Sachs | (6.627) |
| (31.645) | Pactiv Evergreen Inc | Goldman Sachs | 1.582 | (45.376) | Park Aerospace Corp | HSBC | (13.159) |
| (3.875) | PacWest Bancorp | Barclays Bank | (3.836) | (16.426) | Park Aerospace Corp | Morgan Stanley | (4.764) |
| 5.561 | PacWest Bancorp | Barclays Bank | 5.505 | (21.646) | Park City Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (14.070) |
| (48.772) | PacWest Bancorp | Goldman Sachs | (61.940) | (81.158) | Park City Group Inc | Barclays Bank | (17.043) |
| 15.865 | PacWest Bancorp | Goldman Sachs | 20.149 | (5.136) | Park Hotels & Resorts Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.438 |
| 36.873 | PacWest Bancorp | HSBC | (5.162) | 115.113 | Park Hotels & Resorts Inc (REIT) | Barclays Bank | 168.065 |
| 12.151 | PacWest Bancorp | Morgan Stanley | 12.029 | (11.996) | Park Hotels & Resorts Inc (REIT) | Barclays Bank | (17.514) |
| 5.397 | PagerDuty Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6.584 | 20.807 | Park Hotels & Resorts Inc (REIT) | Goldman Sachs | (5.826) |
| 40.208 | PagerDuty Inc | Barclays Bank | 46.240 | (3.563) | Park National Corp | Barclays Bank | (9.549) |
| 17.148 | PagerDuty Inc | Goldman Sachs | 20.921 | (237) | Park National Corp | Goldman Sachs | (1.187) |
| 1.537 | Pain Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.322 | (2.382) | Park National Corp | HSBC | (2.588) |
| (40.187) | Palantir Technologies Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (28.952) | | | | |
| (21.481) | Palantir Technologies Inc 'A' | Barclays Bank | (16.003) | | | | |
| (50.787) | Palantir Technologies Inc 'A' | Goldman Sachs | (36.312) | | | | |
| (52.801) | Palantir Technologies Inc 'A' | Morgan Stanley | (39.337) | | | | |
| 197 | Palo Alto Networks Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.437 | | | | |
| 465 | Palo Alto Networks Inc | Barclays Bank | 1.419 | | | | |
| 497 | Palo Alto Networks Inc | Goldman Sachs | 28.849 | | | | |
| 1.094 | Palo Alto Networks Inc | HSBC | 47.928 | | | | |
| 1.300 | Palo Alto Networks Inc | Morgan Stanley | 3.965 | | | | |
| (3.491) | Palomar Holdings Inc | Barclays Bank | (9.077) | | | | |
| (2.639) | Palomar Holdings Inc | Goldman Sachs | (11.849) | | | | |
| (1.102) | Palomar Holdings Inc | HSBC | (9.170) | | | | |
| (1.024) | PAM Transportation Services Inc | Barclays Bank | 512 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (26.040) | Park National Corp | Morgan Stanley | (69.787) | (2.861) | Paycor HCM Inc | Barclays Bank | 1.688 |
| (11.201) | Parke Bancorp Inc | Bank of America | | (5.079) | Paycor HCM Inc | Goldman Sachs | (13.358) |
| | | Merrill Lynch | (9.633) | (1.324) | Paycor HCM Inc | HSBC | (2.861) |
| (20.690) | Parke Bancorp Inc | Barclays Bank | (10.759) | 3.170 | Paylocity Holding Corp | Bank of America | |
| (9.181) | Parke Bancorp Inc | Goldman Sachs | (7.896) | | | Merrill Lynch | 36.582 |
| (904) | Parke Bancorp Inc | HSBC | (1.094) | 2.783 | Paylocity Holding Corp | Barclays Bank | 17.477 |
| (9.235) | Parke Bancorp Inc | Morgan Stanley | (4.802) | 2.915 | Paylocity Holding Corp | Goldman Sachs | 29.012 |
| 2.489 | Parker Drilling Co | HSBC | 622 | 1.254 | Paylocity Holding Corp | HSBC | 10.860 |
| (1.277) | Parker-Hannifin Corp | Bank of America | | 2.439 | Paylocity Holding Corp | Morgan Stanley | 13.009 |
| | | Merrill Lynch | (6.372) | 2.726 | PayPal Holdings Inc | Barclays Bank | 7.715 |
| (3.182) | Parker-Hannifin Corp | Barclays Bank | (27.874) | 2.013 | PayPal Holdings Inc | Goldman Sachs | 12.803 |
| (2.048) | Parker-Hannifin Corp | Goldman Sachs | (10.496) | 17.199 | PayPal Holdings Inc | HSBC | 77.052 |
| (1.401) | Parker-Hannifin Corp | HSBC | (4.238) | 64.462 | Paysafe Ltd | Bank of America | |
| 4.472 | Parker-Hannifin Corp | Morgan Stanley | 39.175 | | | Merrill Lynch | 27.326 |
| (2.701) | Parker-Hannifin Corp | Morgan Stanley | (23.661) | 108.732 | Paysafe Ltd | Barclays Bank | 28.271 |
| (4.823) | Park-Ohio Holdings Corp | Bank of America | | 128.281 | Paysafe Ltd | Goldman Sachs | 64.140 |
| | | Merrill Lynch | (5.836) | 23.013 | Paysafe Ltd | HSBC | 6.674 |
| (7.585) | Park-Ohio Holdings Corp | Barclays Bank | (12.895) | 41.541 | Paysafe Ltd | Morgan Stanley | 10.801 |
| (1.848) | Park-Ohio Holdings Corp | Goldman Sachs | (2.236) | (41.190) | Paysign Inc | Bank of America | |
| (2.859) | Park-Ohio Holdings Corp | HSBC | (16.840) | | | Merrill Lynch | (9.062) |
| (2.215) | Park-Ohio Holdings Corp | Morgan Stanley | (3.766) | (17.193) | Paysign Inc | Barclays Bank | (3.439) |
| (1.120) | Parsons Corp | Bank of America | | (4.817) | Paysign Inc | Goldman Sachs | (1.060) |
| | | Merrill Lynch | (1.154) | (11.281) | Paysign Inc | HSBC | (226) |
| (6.047) | Parsons Corp | Barclays Bank | (6.470) | (15.724) | Paysign Inc | Morgan Stanley | (3.145) |
| (5.938) | Parsons Corp | Goldman Sachs | (6.116) | 1.745 | PBF Energy Inc 'A' | Bank of America | |
| (4.842) | Parsons Corp | HSBC | (17.141) | | | Merrill Lynch | 5.706 |
| (1.867) | Parsons Corp | Morgan Stanley | (1.998) | 4.245 | PBF Energy Inc 'A' | Barclays Bank | 16.471 |
| 4.623 | PARTS iD Inc | Bank of America | | 1.695 | PBF Energy Inc 'A' | Goldman Sachs | 5.543 |
| | | Merrill Lynch | (2) | 4.569 | PBF Energy Inc 'A' | HSBC | 25.908 |
| 1.606 | PARTS iD Inc | Barclays Bank | (104) | 899 | PC Connection Inc | Bank of America | |
| 1.300 | PARTS iD Inc | Goldman Sachs | (1) | | | Merrill Lynch | (1.315) |
| 8.472 | PARTS iD Inc | Morgan Stanley | (551) | 4.990 | PC Connection Inc | Barclays Bank | 3.892 |
| (24.180) | Party City Holdco Inc | Barclays Bank | (1.934) | 1.057 | PC Connection Inc | HSBC | (2.703) |
| (7.637) | Party City Holdco Inc | Goldman Sachs | 153 | 23.407 | PC Connection Inc | Morgan Stanley | 18.257 |
| (13.800) | Party City Holdco Inc | HSBC | (3.036) | (1.110) | PCB Bancorp | Bank of America | |
| 5.521 | Passage Bio Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (422) |
| | | Merrill Lynch | 635 | (15.194) | PCB Bancorp | Barclays Bank | (11.851) |
| 13.784 | Passage Bio Inc | Barclays Bank | (1.172) | 16.879 | PCSB Financial Corp | Barclays Bank | 26.500 |
| 27.029 | Passage Bio Inc | Goldman Sachs | 3.108 | 41.532 | PCSB Financial Corp | Goldman Sachs | 71.435 |
| 6.061 | Passage Bio Inc | HSBC | (1.182) | 14.856 | PCSB Financial Corp | HSBC | 17.976 |
| 8.630 | Passage Bio Inc | Morgan Stanley | (734) | 36.352 | PCSB Financial Corp | Morgan Stanley | 57.073 |
| 8.950 | Patrick Industries Inc | Barclays Bank | 3.849 | (12.121) | PCTEL Inc | Bank of America | |
| 3.858 | Patrick Industries Inc | Goldman Sachs | (25.386) | | | Merrill Lynch | (727) |
| 1.818 | Patrick Industries Inc | HSBC | (17.016) | (16.023) | PCTEL Inc | Barclays Bank | (1.602) |
| 8.030 | Patterson Cos Inc | Barclays Bank | (803) | (39.394) | PCTEL Inc | Goldman Sachs | (2.364) |
| 18.493 | Patterson Cos Inc | Goldman Sachs | (2.034) | (12.130) | PCTEL Inc | Morgan Stanley | (1.213) |
| 14.289 | Patterson Cos Inc | HSBC | 5.020 | (6.773) | PDC Energy Inc | Bank of America | |
| 8.075 | Patterson Cos Inc | Morgan Stanley | (808) | | | Merrill Lynch | (93.806) |
| 2.229 | Patterson-UTI Energy Inc | Bank of America | | (12.814) | PDC Energy Inc | Barclays Bank | (124.938) |
| | | Merrill Lynch | 8.403 | (30.483) | PDC Energy Inc | Goldman Sachs | (422.189) |
| 9.114 | Patterson-UTI Energy Inc | Barclays Bank | 22.238 | (4.228) | PDC Energy Inc | HSBC | (61.395) |
| 17.622 | Patterson-UTI Energy Inc | Goldman Sachs | 66.435 | (2.940) | PDF Solutions Inc | Bank of America | |
| 16.075 | Patterson-UTI Energy Inc | HSBC | 82.465 | | | Merrill Lynch | 853 |
| (140.548) | PAVmed Inc | Barclays Bank | (1.405) | (8.046) | PDF Solutions Inc | Barclays Bank | (8.529) |
| (6.200) | PAVmed Inc | HSBC | 2.232 | (12.593) | PDF Solutions Inc | Goldman Sachs | 3.652 |
| 21.445 | Paya Holdings Inc | Barclays Bank | (858) | (9.212) | PDF Solutions Inc | HSBC | (9.028) |
| 4.699 | Paya Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.477 | (4.930) | PDF Solutions Inc | Morgan Stanley | (5.226) |
| 4.161 | Paya Holdings Inc | HSBC | 4.868 | (337.585) | PDL BioPharma Inc* | Bank of America | |
| 18.000 | Paya Holdings Inc | Morgan Stanley | (720) | | | Merrill Lynch | 486.460 |
| 4.045 | Paychex Inc | Bank of America | | (46.279) | PDL BioPharma Inc* | Barclays Bank | 66.688 |
| | | Merrill Lynch | 9.859 | (74.293) | PDL BioPharma Inc* | Goldman Sachs | 107.056 |
| 5.489 | Paychex Inc | Barclays Bank | 18.073 | (98.282) | PDL BioPharma Inc* | HSBC | 141.624 |
| 15.734 | Paychex Inc | Goldman Sachs | 36.500 | (141.740) | PDL BioPharma Inc* | Morgan Stanley | 204.247 |
| 4.524 | Paychex Inc | HSBC | 18.663 | (4.938) | PDS Biotechnology Corp | Barclays Bank | 1.037 |
| 3.377 | Paychex Inc | Morgan Stanley | 14.859 | (1.282) | Peapack-Gladstone Financial Corp | Bank of America | |
| 4.407 | Paycom Software Inc | Barclays Bank | 53.368 | | | Merrill Lynch | (2.602) |
| 2.143 | Paycom Software Inc | Goldman Sachs | 14.315 | (1.464) | Peapack-Gladstone Financial Corp | Barclays Bank | (2.284) |
| 962 | Paycom Software Inc | HSBC | 6.080 | (4.886) | Peapack-Gladstone Financial Corp | Goldman Sachs | (9.919) |
| (1.089) | Paycor HCM Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 341 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|---------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3.047) | Peapack-Gladstone Financial Corp | HSBC | (4.845) | 20.132 | Pentair Plc | Bank of America Merrill Lynch | 12.699 |
| (4.787) | Peapack-Gladstone Financial Corp | Morgan Stanley | (7.468) | (3.894) | Pentair Plc | Bank of America Merrill Lynch | 312 |
| (3.623) | Pebblebrook Hotel Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 942 | 12.691 | Pentair Plc | Barclays Bank | 5.159 |
| (20.779) | Pebblebrook Hotel Trust (REIT) | Barclays Bank | (27.220) | 16.337 | Pentair Plc | Goldman Sachs | (1.986) |
| (57.520) | Pebblebrook Hotel Trust (REIT) | Goldman Sachs | 14.248 | (3.910) | Pentair Plc | Goldman Sachs | 3.683 |
| (11.927) | Pebblebrook Hotel Trust (REIT) | HSBC | (6.415) | 13.713 | Pentair Plc | HSBC | 4.463 |
| 2.586 | Pegasystems Inc | Barclays Bank | 3.103 | 15.356 | Pentair Plc | Morgan Stanley | 1.880 |
| 749 | Pegasystems Inc | Goldman Sachs | (517) | 761 | Penumbra Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.662 |
| (8.589) | Pegasystems Inc | HSBC | 139.142 | 4.236 | Penumbra Inc | Barclays Bank | 22.578 |
| 1.075 | Pegasystems Inc | HSBC | 785 | 4.556 | Penumbra Inc | Goldman Sachs | 33.896 |
| 1.275 | Pegasystems Inc | Morgan Stanley | 1.530 | 2.071 | Penumbra Inc | Morgan Stanley | 11.038 |
| 8.486 | Peloton Interactive Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (10.862) | (2.380) | Peoples Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.356) |
| 6.405 | Peloton Interactive Inc 'A' | Goldman Sachs | (8.198) | (14.014) | Peoples Bancorp Inc | Barclays Bank | (7.147) |
| (12.017) | Peloton Interactive Inc 'A' | Goldman Sachs | 10.413 | (29.652) | Peoples Bancorp Inc | Goldman Sachs | (29.355) |
| 1.678 | Peloton Interactive Inc 'A' | HSBC | 1.153 | (15.281) | Peoples Bancorp Inc | HSBC | (9.780) |
| (7.596) | Peloton Interactive Inc 'A' | HSBC | 4.303 | (32.287) | Peoples Bancorp Inc | Morgan Stanley | (16.466) |
| 1.827 | Peloton Interactive Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.060 | (607) | Peoples Financial Services Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.499) |
| 2.612 | Penn National Gaming Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.637 | (5.551) | Peoples Financial Services Corp | Barclays Bank | (7.327) |
| 1.686 | Penn National Gaming Inc | Barclays Bank | 1.332 | (2.652) | Peoples Financial Services Corp | Goldman Sachs | (6.550) |
| 5.576 | Penn National Gaming Inc | Goldman Sachs | 9.776 | (1.872) | Peoples Financial Services Corp | Morgan Stanley | (2.471) |
| 5.074 | Penn National Gaming Inc | HSBC | 3.057 | (2.847) | PepsiCo Inc | Bank of America Merrill Lynch | 22.580 |
| 2.310 | Penn Virginia Corp | Bank of America Merrill Lynch | 23.131 | (19.485) | PepsiCo Inc | Barclays Bank | 1.242 |
| 626 | Penn Virginia Corp | Barclays Bank | 4.908 | (6.599) | PepsiCo Inc | Goldman Sachs | 44.548 |
| 2.390 | Penn Virginia Corp | Goldman Sachs | 23.135 | (4.913) | PepsiCo Inc | HSBC | 33.961 |
| 3.334 | Penn Virginia Corp | Morgan Stanley | 26.139 | (1.270) | PepsiCo Inc | Morgan Stanley | — |
| (3.444) | Pennant Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.754) | (41.870) | Perdoceo Education Corp | Barclays Bank | (23.866) |
| (4.447) | Pennant Group Inc | Barclays Bank | (4.669) | (7.756) | Perdoceo Education Corp | Goldman Sachs | (6.205) |
| (1.440) | Pennant Group Inc | Goldman Sachs | (1.570) | (23.043) | Perdoceo Education Corp | HSBC | (14.978) |
| (4.279) | Pennant Group Inc | HSBC | (24.818) | 5.132 | Perella Weinberg Partners | Bank of America Merrill Lynch | 3.284 |
| (8.430) | Pennant Group Inc | Morgan Stanley | (8.852) | 44.514 | Perella Weinberg Partners | Barclays Bank | 28.489 |
| 7.906 | Penns Woods Bancorp Inc | Barclays Bank | 3.716 | 24.965 | Perella Weinberg Partners | Goldman Sachs | 15.978 |
| 3.598 | Penns Woods Bancorp Inc | Morgan Stanley | 1.691 | 14.139 | Perella Weinberg Partners | HSBC | 17.674 |
| (3.369) | PennyMac Financial Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | (14.588) | 8.920 | Perella Weinberg Partners | Morgan Stanley | 5.709 |
| (15.594) | PennyMac Financial Services Inc | Barclays Bank | (7.486) | (6.468) | Perficient Inc | Barclays Bank | (6.856) |
| (19.491) | PennyMac Financial Services Inc | Goldman Sachs | (84.396) | (2.968) | Perficient Inc | Goldman Sachs | (3.740) |
| (10.647) | PennyMac Financial Services Inc | HSBC | (25.020) | (3.151) | Perficient Inc | HSBC | (17.743) |
| (17.748) | PennyMac Financial Services Inc | Morgan Stanley | (8.519) | (124) | Perficient Inc | Morgan Stanley | (131) |
| (3.170) | PennyMac Mortgage Investment Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (2.631) | 12.392 | Performance Food Group Co | Bank of America Merrill Lynch | (2.141) |
| (52.892) | PennyMac Mortgage Investment Trust (REIT) | Barclays Bank | (20.099) | 14.064 | Performance Food Group Co | Barclays Bank | 27.073 |
| (36.863) | PennyMac Mortgage Investment Trust (REIT) | Goldman Sachs | (30.596) | 24.104 | Performance Food Group Co | Goldman Sachs | (12.173) |
| (31.765) | PennyMac Mortgage Investment Trust (REIT) | HSBC | (20.547) | 7.899 | Performance Food Group Co | HSBC | (13.152) |
| (1.512) | PennyMac Mortgage Investment Trust (REIT) | Morgan Stanley | (575) | 7.597 | Performance Food Group Co | Morgan Stanley | 18.426 |
| 12.788 | Penske Automotive Group Inc | Barclays Bank | 76.925 | (2.590) | PerkinElmer Inc | Bank of America Merrill Lynch | (11.344) |
| 2.510 | Penske Automotive Group Inc | Goldman Sachs | (2.786) | (5.846) | PerkinElmer Inc | Barclays Bank | (27.418) |
| 2.885 | Penske Automotive Group Inc | HSBC | 5.014 | (13.124) | PerkinElmer Inc | Goldman Sachs | (65.328) |
| 938 | Penske Automotive Group Inc | Morgan Stanley | 5.731 | (2.103) | PerkinElmer Inc | HSBC | (17.153) |
| | | | | (5.813) | PerkinElmer Inc | Morgan Stanley | (27.263) |
| | | | | 56.750 | Perrigo Co Plc | Barclays Bank | 68.668 |
| | | | | 38.814 | Perrigo Co Plc | Goldman Sachs | 94.318 |
| | | | | 1.869 | Perrigo Co Plc | Morgan Stanley | 2.261 |
| | | | | 2.858 | Personalis Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.172) |
| | | | | 26.998 | Personalis Inc | Barclays Bank | 810 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 39.123 | Personalis Inc | Goldman Sachs | (16.040) | 9.983 | Phillips Edison | | |
| 30.075 | Personalis Inc | HSBC | 1.931 | | & Co Inc (REIT) | Barclays Bank | 16.272 |
| 7.707 | Personalis Inc | Morgan Stanley | 231 | (20.489) | Phillips Edison | | |
| (13.556) | PET Acquisition LLC 'A' | Goldman Sachs | 33.483 | | & Co Inc (REIT) | Goldman Sachs | (20.935) |
| 6.090 | PET Acquisition LLC 'A' | Goldman Sachs | (15.042) | 8.289 | Phillips Edison | | |
| 5.345 | PET Acquisition LLC 'A' | HSBC | (17.742) | | & Co Inc (REIT) | Goldman Sachs | 8.123 |
| (9.979) | PET Acquisition LLC 'A' | Morgan Stanley | (12.873) | (10.029) | Phillips Edison | | |
| 16.189 | PetIQ Inc | Barclays Bank | 39.015 | | & Co Inc (REIT) | HSBC | (12.876) |
| 3.959 | PetIQ Inc | Goldman Sachs | 1.702 | 13.556 | Phillips Edison | | |
| 2.800 | PetIQ Inc | HSBC | 560 | | & Co Inc (REIT) | HSBC | 37.200 |
| (39.378) | PetMed Express Inc | Barclays Bank | (42.134) | (41.731) | Phillips Edison | | |
| (2.936) | PetMed Express Inc | HSBC | (2.026) | | & Co Inc (REIT) | Morgan Stanley | (66.282) |
| (19.748) | Pfizer Inc | Barclays Bank | 15.996 | (6.316) | Photronics Inc | Barclays Bank | (36.633) |
| (8.779) | Pfizer Inc | Goldman Sachs | (12.290) | (19.408) | Photronics Inc | Goldman Sachs | (112.760) |
| (10.569) | Pfizer Inc | HSBC | (15.408) | 4.193 | Phreesia Inc | Bank of America | |
| (5.715) | Pfizer Inc | Morgan Stanley | 4.629 | | | Merrill Lynch | 11.111 |
| (30.870) | PFSweb Inc | Bank of America | | 5.355 | Phreesia Inc | Barclays Bank | 7.604 |
| | | Merrill Lynch | (6.483) | 6.727 | Phreesia Inc | Goldman Sachs | 17.827 |
| (7.885) | PFSweb Inc | Goldman Sachs | (1.656) | 6.224 | Phreesia Inc | HSBC | 12.012 |
| (13.124) | PG&E Corp | Bank of America | | 4.076 | Phreesia Inc | Morgan Stanley | 5.788 |
| | | Merrill Lynch | (4.397) | (31.171) | PHX Minerals Inc | Bank of America | |
| (230.722) | PG&E Corp | Goldman Sachs | (77.292) | | | Merrill Lynch | (1.559) |
| (56.647) | PG&E Corp | Morgan Stanley | (3.116) | (17.887) | PHX Minerals Inc | Barclays Bank | (4.293) |
| 11.078 | PGT Innovations Inc | Barclays Bank | 8.641 | (11.531) | PHX Minerals Inc | Goldman Sachs | (577) |
| 26.062 | PGT Innovations Inc | Goldman Sachs | 38.832 | (2.276) | PHX Minerals Inc | HSBC | (569) |
| 26.845 | PGT Innovations Inc | HSBC | 60.670 | 66.516 | Physicians Realty Trust (REIT) | Barclays Bank | 35.254 |
| 27.840 | PhaseBio | | | 89.197 | Physicians Realty Trust (REIT) | Goldman Sachs | 74.926 |
| | Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (476) | 39.341 | Physicians Realty Trust (REIT) | HSBC | 30.686 |
| 20.545 | PhaseBio | | | 68.219 | Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Barclays Bank | 12.279 |
| | Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (351) | 99.593 | Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (30.341) |
| 4.152 | Phathom | Bank of America | | 37.401 | Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (REIT) | HSBC | (12.404) |
| | Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | (3.571) | 3.230 | Pieris Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| 3.612 | Phathom | | | | | Merrill Lynch | 145 |
| | Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (3.901) | 33.189 | Pieris Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (498) |
| 4.915 | Phathom | | | 31.703 | Pieris Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 1.427 |
| | Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (4.227) | 20.185 | Pieris Pharmaceuticals Inc | HSBC | (8.579) |
| 3.935 | Phathom | | | 3.890 | Pieris Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (58) |
| | Pharmaceuticals Inc | HSBC | (6.296) | (7.415) | Pilgrim's Pride Corp | Barclays Bank | (18.538) |
| 2.499 | Phathom | | | (871) | Pilgrim's Pride Corp | Goldman Sachs | 92 |
| | Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (2.699) | 9.800 | Pilgrim's Pride Corp | Goldman Sachs | 33.026 |
| 4.341 | Phibro Animal Health Corp 'A' | Bank of America | | (833) | Pilgrim's Pride Corp | HSBC | (1.272) |
| | | Merrill Lynch | 4.211 | (5.795) | Pilgrim's Pride Corp | Morgan Stanley | (14.488) |
| 17.133 | Phibro Animal Health Corp 'A' | Barclays Bank | 19.874 | (3.995) | Ping Identity Holding Corp | Bank of America | |
| 18.256 | Phibro Animal Health Corp 'A' | | | | | Merrill Lynch | 200 |
| | | Goldman Sachs | 17.708 | (6.329) | Ping Identity Holding Corp | Barclays Bank | 823 |
| 11.309 | Phibro Animal Health Corp 'A' | | | (11.029) | Ping Identity Holding Corp | Goldman Sachs | 918 |
| | | HSBC | 13.797 | (27.653) | Ping Identity Holding Corp | HSBC | 15.113 |
| 3.358 | Phibro Animal Health Corp 'A' | | | (3.617) | Ping Identity Holding Corp | Morgan Stanley | 470 |
| | | Morgan Stanley | 3.895 | 11.959 | Pinnacle Financial Partners Inc | Bank of America | |
| (8.655) | Philip Morris International Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 72.324 |
| | | Merrill Lynch | 4.377 | 16.155 | Pinnacle Financial Partners Inc | Barclays Bank | 51.373 |
| (9.350) | Philip Morris International Inc | | | 30.118 | Pinnacle Financial Partners Inc | Goldman Sachs | 191.249 |
| (1.319) | Philip Morris International Inc | Barclays Bank | 26.559 | 10.625 | Pinnacle Financial Partners Inc | HSBC | 43.881 |
| | | Goldman Sachs | 4.128 | 9.551 | Pinnacle Financial Partners Inc | Morgan Stanley | 30.373 |
| (8.217) | Philip Morris International Inc | | | (4.621) | Pinnacle West Capital Corp | Bank of America | |
| (1.974) | Philip Morris International Inc | HSBC | (52.681) | | | Merrill Lynch | (17.883) |
| 2.779 | Phillips 66 | Morgan Stanley | 2.474 | 3.973 | Pinnacle West Capital Corp | Barclays Bank | 9.575 |
| | | Bank of America | | (7.306) | Pinnacle West Capital Corp | Barclays Bank | (17.607) |
| 6.971 | Phillips 66 | Merrill Lynch | 11.868 | 34.417 | Pinnacle West Capital Corp | Goldman Sachs | 133.194 |
| 26.788 | Phillips 66 | Barclays Bank | 57.232 | (2.814) | Pinnacle West Capital Corp | HSBC | (9.427) |
| (9.910) | Phillips Edison & Co Inc (REIT) | Goldman Sachs | 166.353 | | | | |
| | | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (4.272) | | | | |
| 3.405 | Phillips Edison & Co Inc (REIT) | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 3.337 | | | | |
| (22.139) | Phillips Edison & Co Inc (REIT) | Barclays Bank | (36.086) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-----------------|---|---|--------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 13.909 | Pinnacle West Capital Corp | Morgan Stanley | 33.521 | (530) | Plumas Bancorp | Barclays Bank | 1.081 |
| (16.785) | Pinterest Inc 'A' | Goldman Sachs | 26.856 | (1.764) | Plumas Bancorp | Morgan Stanley | 3.599 |
| (16.924) | Pinterest Inc 'A' | HSBC | 5.835 | (9.149) | PLx Pharma Inc | Barclays Bank | 3.202 |
| (42.101) | Pinterest Inc 'A' | Morgan Stanley | 113.673 | 4.650 | Plymouth Industrial Inc (REIT) | Bank of America | |
| (3.203) | Pioneer Bancorp Inc | Goldman Sachs | (993) | | | Merrill Lynch | (6.138) |
| (94.050) | Pioneer Bancorp Inc | Morgan Stanley | (15.989) | 4.636 | Plymouth Industrial Inc (REIT) | Barclays Bank | 3.384 |
| (243) | Pioneer Natural Resources Co | Bank of America | | 13.530 | Plymouth Industrial Inc (REIT) | Goldman Sachs | (17.860) |
| (9.591) | Pioneer Natural Resources Co | Merrill Lynch | (3.888) | 38.064 | Plymouth Industrial Inc (REIT) | HSBC | (32.354) |
| (3.701) | Pioneer Natural Resources Co | Barclays Bank | (122.573) | 1.006 | Plymouth Industrial Inc (REIT) | | |
| (2.288) | Pioneer Natural Resources Co | Goldman Sachs | (54.108) | 7.888 | PMV Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 734 |
| (355) | Pioneer Natural Resources Co | HSBC | (74.832) | 6.656 | | Bank of America | |
| 8.203 | Piper Sandler Cos | Morgan Stanley | (4.537) | 6.656 | PMV Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | 8.913 |
| 5.435 | Piper Sandler Cos | Barclays Bank | 47.331 | 8.015 | PMV Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (8.120) |
| 4.387 | Piper Sandler Cos | Goldman Sachs | 12.664 | 6.127 | PNM Resources Inc | Goldman Sachs | 9.057 |
| (8.913) | Pitney Bowes Inc | HSBC | (4.650) | 35.939 | PNM Resources Inc | Barclays Bank | 2.451 |
| | | Bank of America | | 13.412 | PNM Resources Inc | HSBC | 58.932 |
| | | Merrill Lynch | (178) | 7.521 | Point Biopharma Global Inc | Barclays Bank | 20.923 |
| (54.663) | Pitney Bowes Inc | Barclays Bank | 1.640 | 2.988 | Point Biopharma Global Inc | Goldman Sachs | 22.864 |
| (14.330) | Pitney Bowes Inc | Goldman Sachs | (287) | (2.233) | Point Biopharma Global Inc | Morgan Stanley | 4.661 |
| (77.185) | Pitney Bowes Inc | HSBC | 10.806 | | Polaris Inc | Bank of America | |
| (40.175) | Pixelworks Inc | Barclays Bank | (5.625) | (13.185) | Polaris Inc | Merrill Lynch | (15.701) |
| (15.935) | Pixelworks Inc | Goldman Sachs | (159) | (1.291) | Polaris Inc | Barclays Bank | (52.081) |
| (9.939) | Pixelworks Inc | Morgan Stanley | (1.391) | (5.295) | Polaris Inc | Goldman Sachs | 8.796 |
| 3.689 | PJT Partners Inc 'A' | Bank of America | | (4.639) | Polaris Inc | HSBC | (1.190) |
| | | Merrill Lynch | 13.612 | (1.832) | PolarityTE Inc | Morgan Stanley | (18.325) |
| 608 | PJT Partners Inc 'A' | Barclays Bank | 1.411 | 7.758 | PolyMet Mining Corp | Morgan Stanley | (73) |
| 15.071 | PJT Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | 56.215 | | | Bank of America | |
| 2.204 | PJT Partners Inc 'A' | HSBC | 15.133 | 15.394 | PolyMet Mining Corp | Merrill Lynch | 388 |
| (3.232) | Planet Fitness Inc 'A' | Bank of America | | 34.064 | PolyMet Mining Corp | Barclays Bank | (308) |
| | | Merrill Lynch | (6.143) | 8.324 | PolyMet Mining Corp | Goldman Sachs | 1.703 |
| 1.197 | Planet Fitness Inc 'A' | Bank of America | | 8.352 | Ponca Financial Group Inc | HSBC | 1.415 |
| | | Merrill Lynch | (2.155) | 81 | Pool Corp | Goldman Sachs | 1.545 |
| (1.125) | Planet Fitness Inc 'A' | Barclays Bank | (3.870) | | | Bank of America | |
| 1.964 | Planet Fitness Inc 'A' | Barclays Bank | 6.756 | 557 | Pool Corp | Merrill Lynch | (151) |
| (8.338) | Planet Fitness Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.270 | 1.888 | Pool Corp | Barclays Bank | (3.036) |
| (5.305) | Planet Fitness Inc 'A' | HSBC | (5.913) | 1.714 | Popular Inc | HSBC | (291) |
| 1.195 | Planet Fitness Inc 'A' | HSBC | 1.434 | | | Bank of America | |
| (2.033) | Planet Fitness Inc 'A' | Morgan Stanley | (6.994) | 15.639 | Popular Inc | Merrill Lynch | 5.416 |
| 1.027 | Planet Fitness Inc 'A' | Morgan Stanley | 3.533 | 15.089 | Popular Inc | Barclays Bank | 26.223 |
| 16.146 | PlayAGS Inc | Barclays Bank | 9.688 | 1.826 | Popular Inc | HSBC | 29.613 |
| 17.779 | PlayAGS Inc | Goldman Sachs | 5.867 | (7.621) | Porch Group Inc | Morgan Stanley | 3.524 |
| 33.600 | PlayAGS Inc | HSBC | (6.720) | | | Bank of America | |
| 2.316 | PlayAGS Inc | Morgan Stanley | 1.390 | (11.744) | Porch Group Inc | Merrill Lynch | (533) |
| (8.821) | Playstudios Inc | HSBC | (5.868) | (23.651) | Porch Group Inc | Barclays Bank | 804 |
| (8.225) | Playstudios Inc | Morgan Stanley | (1.810) | 983 | Portage Biotech Inc | Goldman Sachs | (1.656) |
| 11.341 | Playtika Holding Corp | Barclays Bank | 10.831 | | | Bank of America | |
| (4.056) | Playtika Holding Corp | Barclays Bank | (3.873) | 5.655 | Portage Biotech Inc | Merrill Lynch | 3.509 |
| 4.394 | Playtika Holding Corp | Morgan Stanley | 5.221 | 1.291 | Portage Biotech Inc | Barclays Bank | 4.694 |
| (22.363) | PLBY Group Inc | Bank of America | | 1.378 | Portage Biotech Inc | Goldman Sachs | 4.609 |
| | | Merrill Lynch | (7.156) | 3.044 | Portage Biotech Inc | HSBC | 5.595 |
| (5.294) | PLBY Group Inc | Barclays Bank | 1.429 | 8.139 | Portland General Electric Co | Morgan Stanley | 2.527 |
| (4.907) | PLBY Group Inc | Morgan Stanley | 1.325 | | | Bank of America | |
| (8.631) | Plexus Corp | Barclays Bank | (21.578) | 94.231 | Portland General Electric Co | Merrill Lynch | 6.626 |
| 7.061 | Pliant Therapeutics Inc | Bank of America | | | | Barclays Bank | 16.019 |
| | | Merrill Lynch | 6.567 | 60.077 | Portland General Electric Co | Barclays Bank | 16.019 |
| 11.519 | Pliant Therapeutics Inc | Barclays Bank | 8.063 | | | Goldman Sachs | 63.081 |
| 35.847 | Pliant Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 33.338 | 4.213 | Portland General Electric Co | HSBC | 5.098 |
| 18.070 | Pliant Therapeutics Inc | HSBC | 21.142 | 43.195 | Portland General Electric Co | | |
| 9.002 | Pliant Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 6.301 | | | Morgan Stanley | 5.964 |
| (23.695) | Plug Power Inc | Bank of America | | 29.428 | Poseida Therapeutics Inc | Barclays Bank | 1.177 |
| | | Merrill Lynch | (93.951) | 11.662 | Poseida Therapeutics Inc | Barclays Bank | 1.177 |
| (32.201) | Plug Power Inc | Barclays Bank | (70.905) | 10.072 | Poseida Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (583) |
| (5.923) | Plug Power Inc | Goldman Sachs | (23.485) | (19.701) | Post Holdings Inc | Morgan Stanley | 403 |
| (5.929) | Plug Power Inc | Morgan Stanley | (10.820) | (8.772) | Post Holdings Inc | Barclays Bank | (65.999) |
| (5.196) | Plumas Bancorp | Bank of America | | (6.848) | Post Holdings Inc | Goldman Sachs | (13.936) |
| | | Merrill Lynch | 20.836 | | | HSBC | (21.436) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (50.439) | Potbelly Corp | Bank of America | | (9.649) | Premier Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 11.097 | | | Merrill Lynch | (4.843) |
| (1.626) | Potbelly Corp | HSBC | 959 | (16.363) | Premier Inc 'A' | Barclays Bank | (597) |
| (18.477) | Potbelly Corp | Morgan Stanley | 2.402 | (14.386) | Premier Inc 'A' | Goldman Sachs | (7.049) |
| 7.707 | PotlatchDeltic Corp (REIT) | Barclays Bank | (1.002) | (26.223) | Premier Inc 'A' | HSBC | (30.096) |
| 8.705 | PotlatchDeltic Corp (REIT) | Goldman Sachs | 8.357 | (25.649) | Premier Inc 'A' | Morgan Stanley | (4.827) |
| 24.884 | PotlatchDeltic Corp (REIT) | HSBC | (6.354) | 25.910 | Prestige Consumer Healthcare Inc | Barclays Bank | (21.505) |
| (1.341) | Powell Industries Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (577) | 1.759 | Prestige Consumer Healthcare Inc | Goldman Sachs | (2.762) |
| (3.505) | Powell Industries Inc | Barclays Bank | (1.753) | 2.704 | Prestige Consumer Healthcare Inc | HSBC | (5.435) |
| (8.975) | Powell Industries Inc | Goldman Sachs | (3.859) | 1.045 | PriceSmart Inc | Bank of America | |
| (989) | Powell Industries Inc | HSBC | (1.226) | | | Merrill Lynch | (637) |
| 9.870 | Power Integrations Inc | Bank of America | | 8.610 | PriceSmart Inc | Barclays Bank | 24.022 |
| | | Merrill Lynch | 11.351 | 7.722 | PriceSmart Inc | Goldman Sachs | (4.710) |
| 3.700 | Power Integrations Inc | Barclays Bank | 5.167 | 5.407 | PriceSmart Inc | HSBC | 598 |
| 7.045 | Power Integrations Inc | Goldman Sachs | 8.101 | 2.377 | PriceSmart Inc | Morgan Stanley | 6.632 |
| 11.936 | Power Integrations Inc | HSBC | 40.490 | (460) | Primerica Inc | Bank of America | |
| 20.084 | Power Integrations Inc | Morgan Stanley | 31.733 | | | Merrill Lynch | (1.187) |
| (10.778) | Powerfleet Inc | Bank of America | | (15.040) | Primerica Inc | Barclays Bank | (52.941) |
| | | Merrill Lynch | (754) | (10.783) | Primerica Inc | Goldman Sachs | (27.820) |
| (37.316) | Powerfleet Inc | Barclays Bank | (746) | (6.652) | Primerica Inc | HSBC | (49.823) |
| (17.161) | Powerfleet Inc | Goldman Sachs | (1.201) | (3.610) | Primerica Inc | Morgan Stanley | (12.707) |
| (11.752) | Powerfleet Inc | HSBC | 6.464 | (33.283) | Primis Financial Corp | Bank of America | |
| (9.519) | Powerfleet Inc | Morgan Stanley | (190) | | | Merrill Lynch | (13.979) |
| (1.328) | PowerSchool Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (903) | (40.442) | Primis Financial Corp | Barclays Bank | (11.324) |
| (16.885) | PowerSchool Holdings Inc 'A' | HSBC | 7.261 | (27.744) | Primis Financial Corp | Goldman Sachs | (11.652) |
| 2.086 | PPG Industries Inc | Bank of America | | (4.252) | Primis Financial Corp | HSBC | (1.092) |
| | | Merrill Lynch | 11.035 | (7.838) | Primis Financial Corp | Morgan Stanley | (2.195) |
| 11.279 | PPG Industries Inc | Barclays Bank | 33.273 | 31.550 | Primo Water Corp | Bank of America | |
| 6.722 | PPG Industries Inc | Goldman Sachs | 35.559 | | | Merrill Lynch | 3.471 |
| 368 | PPG Industries Inc | HSBC | (508) | 47.636 | Primo Water Corp | Barclays Bank | 16.196 |
| 18.841 | PPG Industries Inc | Morgan Stanley | 55.581 | 21.501 | Primo Water Corp | Goldman Sachs | 2.365 |
| (14.305) | PPL Corp | Bank of America | | 21.584 | Primo Water Corp | HSBC | 5.180 |
| | | Merrill Lynch | (16.880) | 22.633 | Primo Water Corp | Morgan Stanley | 7.695 |
| (20.960) | PPL Corp | Barclays Bank | (12.366) | 4.602 | Primoris Services Corp | Bank of America | |
| (54.657) | PPL Corp | Goldman Sachs | (64.495) | | | Merrill Lynch | 5.292 |
| (136.404) | PPL Corp | HSBC | (186.873) | 4.532 | Primoris Services Corp | Barclays Bank | 2.719 |
| (129.333) | PPL Corp | Morgan Stanley | (76.306) | 10.679 | Primoris Services Corp | Goldman Sachs | 12.281 |
| 21.017 | PRA Group Inc | Barclays Bank | 210 | 2.615 | Primoris Services Corp | HSBC | 2.092 |
| 16.677 | PRA Group Inc | Goldman Sachs | (14.175) | (5.625) | Principal Financial Group Inc | Bank of America | |
| 1.385 | PRA Group Inc | Morgan Stanley | 14 | | | Merrill Lynch | (12.507) |
| (5.649) | Praxis Precision Medicines Inc | Barclays Bank | 6.609 | 2.594 | Principal Financial Group Inc | Bank of America | |
| (22.687) | Precigen Inc | Barclays Bank | (2.496) | (59.795) | Principal Financial Group Inc | Merrill Lynch | 6.148 |
| 25.178 | Precision BioSciences Inc | Bank of America | | | | Barclays Bank | (104.470) |
| | | Merrill Lynch | (1.637) | 3.440 | Principal Financial Group Inc | Barclays Bank | 6.605 |
| 49.459 | Precision BioSciences Inc | Barclays Bank | 1.236 | (414) | Principal Financial Group Inc | Goldman Sachs | (981) |
| 37.390 | Precision BioSciences Inc | Goldman Sachs | (2.430) | 24.130 | Principal Financial Group Inc | Goldman Sachs | 57.188 |
| 8.443 | Precision BioSciences Inc | HSBC | (380) | (13.787) | Principal Financial Group Inc | HSBC | (24.321) |
| 12.135 | Precision BioSciences Inc | Morgan Stanley | 303 | (4.853) | Principal Financial Group Inc | HSBC | (24.321) |
| (6.693) | Preferred Bank | Barclays Bank | (11.043) | | | Morgan Stanley | (10.656) |
| (6.224) | Preferred Bank | Goldman Sachs | (11.141) | 2.726 | Principal Financial Group Inc | Morgan Stanley | 5.234 |
| (676) | Preferred Bank | HSBC | (189) | (4.456) | Priority Technology Holdings Inc | Barclays Bank | 446 |
| 519 | Preformed Line Products Co | Barclays Bank | 581 | 8.587 | Privia Health Group Inc | Bank of America | |
| 374 | Preformed Line Products Co | Goldman Sachs | 629 | | | Merrill Lynch | 12.194 |
| 4.287 | Preformed Line Products Co | Morgan Stanley | 4.801 | 8.441 | Privia Health Group Inc | Barclays Bank | 3.630 |
| 6.586 | Prelude Therapeutics Inc | Bank of America | | 4.995 | Privia Health Group Inc | HSBC | 21.728 |
| | | Merrill Lynch | (1.185) | (16.178) | ProAssurance Corp | Bank of America | |
| 4.060 | Prelude Therapeutics Inc | Barclays Bank | 122 | | | Merrill Lynch | (28.635) |
| 5.062 | Prelude Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (911) | (15.588) | ProAssurance Corp | Barclays Bank | (12.938) |
| 9.408 | Prelude Therapeutics Inc | HSBC | 5.174 | (9.456) | ProAssurance Corp | Goldman Sachs | (16.737) |
| 723 | Prelude Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 22 | (21.229) | ProAssurance Corp | HSBC | 46.279 |
| 41.397 | Premier Financial Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 27.736 | | | | |
| 18.567 | Premier Financial Corp | Barclays Bank | 8.726 | | | | |
| 31.230 | Premier Financial Corp | Goldman Sachs | 20.924 | | | | |
| 7.966 | Premier Financial Corp | HSBC | 2.629 | | | | |
| 2.283 | Premier Financial Corp | Morgan Stanley | 1.073 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-----------------|---|---|-------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (1.378) | PROCEPT BioRobotics Corp | Morgan Stanley | (3.335) | 1.998 | Protara Therapeutics Inc | Barclays Bank | 579 |
| (4.682) | Procore Technologies Inc | Bank of America | | 3.446 | Protara Therapeutics Inc | HSBC | 1.137 |
| | | Merrill Lynch | (13.485) | (6.530) | Prothena Corp Plc | Barclays Bank | (8.489) |
| (3.954) | Procore Technologies Inc | Barclays Bank | (15.658) | (3.351) | Prothena Corp Plc | Goldman Sachs | (5.576) |
| (14.574) | Procore Technologies Inc | Goldman Sachs | (41.973) | (4.866) | Prothena Corp Plc | HSBC | (5.056) |
| (24.710) | Procore Technologies Inc | HSBC | (21.931) | (4.496) | Prothena Corp Plc | Morgan Stanley | (5.845) |
| (1.447) | Procore Technologies Inc | Morgan Stanley | (5.730) | 1.473 | Proto Labs Inc | Bank of America | |
| 18.444 | Procter & Gamble Co | Barclays Bank | 25.822 | 4.536 | Proto Labs Inc | Merrill Lynch | 7.439 |
| (18.916) | Procter & Gamble Co | Barclays Bank | (26.482) | 5.565 | Proto Labs Inc | Barclays Bank | 2.830 |
| 1.481 | Procter & Gamble Co | Goldman Sachs | (6.168) | 6.565 | Proto Labs Inc | Goldman Sachs | 33.153 |
| (11.254) | Procter & Gamble Co | Goldman Sachs | 39.099 | 1.858 | Proto Labs Inc | Morgan Stanley | 1.003 |
| 3.298 | Procter & Gamble Co | HSBC | (30.210) | 10.254 | Provention Bio Inc | Barclays Bank | 513 |
| 6.592 | Procter & Gamble Co | Morgan Stanley | 9.229 | 8.533 | Provention Bio Inc | Goldman Sachs | (1.451) |
| (16.022) | Professional Holding Corp | Barclays Bank | 961 | 11.070 | Provident Bancorp Inc | Barclays Bank | 1.328 |
| (2.606) | Professional Holding Corp | Goldman Sachs | (756) | (6.771) | Provident Financial Holdings Inc | Bank of America | |
| (3.511) | Professional Holding Corp | Morgan Stanley | 211 | (17.179) | Provident Financial Holdings Inc | Merrill Lynch | (1.659) |
| 1.163 | PROG Holdings Inc | Bank of America | | (18.189) | Provident Financial Holdings Inc | Barclays Bank | (6.614) |
| | | Merrill Lynch | 2.535 | (11.112) | Provident Financial Services Inc | Goldman Sachs | (4.456) |
| 31.330 | PROG Holdings Inc | Barclays Bank | 84.904 | (49.076) | Provident Financial Services Inc | Bank of America | |
| 1.261 | PROG Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.427 | (24.307) | Provident Financial Services Inc | Merrill Lynch | (13.112) |
| 4.859 | PROG Holdings Inc | HSBC | 4.705 | (51.019) | Provident Financial Services Inc | Barclays Bank | (20.612) |
| 7.736 | PROG Holdings Inc | Morgan Stanley | 17.938 | (2.987) | Provident Financial Services Inc | Goldman Sachs | (28.682) |
| 2.298 | Progress Software Corp | Bank of America | | (10.635) | Prudential Bancorp Inc | HSBC | (21.428) |
| | | Merrill Lynch | 2.068 | (10.167) | Prudential Bancorp Inc | Morgan Stanley | (1.255) |
| 20.142 | Progress Software Corp | Barclays Bank | 17.281 | (15.743) | Prudential Bancorp Inc | Bank of America | |
| 6.050 | Progress Software Corp | HSBC | 4.140 | (2.571) | Prudential Bancorp Inc | Merrill Lynch | (7.976) |
| (3.466) | Progressive Corp | Bank of America | | 21.494 | Prudential Bancorp Inc | Barclays Bank | (1.627) |
| | | Merrill Lynch | (31.055) | (17.431) | Prudential Financial Inc | Goldman Sachs | (11.807) |
| (16.504) | Progressive Corp | Barclays Bank | (95.228) | (18.550) | pSivida Corp | Morgan Stanley | (411) |
| (20.046) | Progressive Corp | Goldman Sachs | (179.612) | (1.386) | pSivida Corp | Bank of America | |
| (7.959) | Progressive Corp | HSBC | (79.272) | (1.231) | pSivida Corp | Merrill Lynch | 102.035 |
| (607) | Progyny Inc | Bank of America | | (424) | PTC Inc | Barclays Bank | 88.322 |
| | | Merrill Lynch | 1.275 | (6.032) | PTC Inc | Barclays Bank | (110.827) |
| (14.019) | Progyny Inc | Barclays Bank | 7.710 | (3.873) | PTC Inc | Goldman Sachs | 47.958 |
| (19.711) | Progyny Inc | Goldman Sachs | 41.393 | (2.100) | PTC Inc | HSBC | 10.305 |
| (28.790) | Progyny Inc | HSBC | (31.615) | (1.379) | PTC Inc | Morgan Stanley | 11.316 |
| 25.646 | Prologis Inc (REIT) | Barclays Bank | 150.286 | 1.021 | PTC Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (10.884) |
| (366) | Prologis Inc (REIT) | Barclays Bank | (2.145) | 6.995 | PTC Therapeutics Inc | Barclays Bank | (15.879) |
| (2.052) | Prologis Inc (REIT) | Goldman Sachs | (10.473) | 4.731 | PTC Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (4.069) |
| (1.284) | Prologis Inc (REIT) | HSBC | 7.743 | 10.397 | PTC Therapeutics Inc | HSBC | (9.669) |
| 7.528 | Prologis Inc (REIT) | Morgan Stanley | 44.114 | 2.956 | PTC Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (6.710) |
| (3.639) | Prologis Inc (REIT) | Morgan Stanley | (21.325) | (19.822) | Public Service Enterprise Group Inc | Bank of America | |
| (2.958) | Prometheus Biosciences Inc | Goldman Sachs | 8.164 | (43.882) | Public Service Enterprise Group Inc | Merrill Lynch | (4.163) |
| (4.175) | Prometheus Biosciences Inc | HSBC | (16.241) | (17.459) | Public Service Enterprise Group Inc | Barclays Bank | 439 |
| (1.292) | Prometheus Biosciences Inc | Morgan Stanley | 2.364 | (17.375) | Public Service Enterprise Group Inc | Goldman Sachs | (3.666) |
| 15.028 | ProPetro Holding Corp | Bank of America | | (34.818) | Public Service Enterprise Group Inc | HSBC | 6.449 |
| | | Merrill Lynch | 7.624 | 7.436 | Public Storage (REIT) | Morgan Stanley | 523 |
| 31.886 | ProPetro Holding Corp | Barclays Bank | 30.611 | 1.778 | Public Storage (REIT) | Barclays Bank | 94.363 |
| 24.793 | ProPetro Holding Corp | Goldman Sachs | 8.698 | | | Goldman Sachs | 24.216 |
| 7.899 | ProPetro Holding Corp | HSBC | 9.400 | | | | |
| 23.952 | ProPetro Holding Corp | Morgan Stanley | 22.994 | | | | |
| (1.896) | PROS Holdings Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 1.192 | | | | |
| (2.635) | PROS Holdings Inc | Barclays Bank | 660 | | | | |
| (961) | PROS Holdings Inc | Goldman Sachs | 638 | | | | |
| (8.334) | PROS Holdings Inc | HSBC | (3.475) | | | | |
| (1.165) | PROS Holdings Inc | Morgan Stanley | 967 | | | | |
| (14.926) | Prosperity Bancshares Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (45.667) | | | | |
| (35.720) | Prosperity Bancshares Inc | Barclays Bank | (50.590) | | | | |
| (18.793) | Prosperity Bancshares Inc | Goldman Sachs | (77.866) | | | | |
| (16.137) | Prosperity Bancshares Inc | HSBC | (30.067) | | | | |
| (8.112) | Prosperity Bancshares Inc | Morgan Stanley | (10.627) | | | | |
| (10.391) | Protagonist Therapeutics Inc | Barclays Bank | (9.456) | | | | |
| (10.054) | Protagonist Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.508) | | | | |
| (8.225) | Protagonist Therapeutics Inc | HSBC | 658 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|----------------------------------|---|---|------------------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 7.081 | Public Storage (REIT) | Morgan Stanley | 89.858 | 3.481 | QCR Holdings Inc | HSBC | 4.978 |
| (2.190) | Pulmonx Corp | Bank of America Merrill Lynch | (701) | 1.063 | QCR Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.967 |
| (5.334) | Pulmonx Corp | Barclays Bank | 7.308 | 1.564 | QIAGEN NV | Bank of America Merrill Lynch | 313 |
| (3.603) | Pulmonx Corp | Goldman Sachs | (1.153) | (12.478) | QIAGEN NV | Barclays Bank | (7.046) |
| (1.930) | Pulmonx Corp | HSBC | (4.478) | 1.839 | QIAGEN NV | Barclays Bank | 1.214 |
| (1.697) | Pulmonx Corp | Morgan Stanley | 2.325 | 2.083 | QIAGEN NV | Goldman Sachs | 705 |
| (862) | Pulse Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | — | (546) | QIAGEN NV | HSBC | (639) |
| (862) | Pulse Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | — | 2.000 | QIAGEN NV | HSBC | 3.320 |
| (22.608) | Pulse Biosciences Inc | Barclays Bank | (7.687) | 3.919 | QIAGEN NV | Morgan Stanley | 2.587 |
| (22.608) | Pulse Biosciences Inc ^{TT} | Barclays Bank | — | (2.563) | Qorvo Inc | Bank of America Merrill Lynch | (18.530) |
| (33.110) | Pulse Biosciences Inc | Goldman Sachs | — | 791 | Qorvo Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.109 |
| (8.313) | Pulse Biosciences Inc | HSBC | 1.496 | (6.522) | Qorvo Inc | Barclays Bank | (32.928) |
| (8.313) | Pulse Biosciences Inc ^{TT} | HSBC | — | 3.036 | Qorvo Inc | Barclays Bank | 13.875 |
| (8.732) | Pulse Biosciences Inc | Morgan Stanley | (2.969) | (387) | Qorvo Inc | Goldman Sachs | (2.074) |
| (8.732) | Pulse Biosciences Inc ^{TT} | Morgan Stanley | — | (579) | Qorvo Inc | HSBC | (2.677) |
| 4.502 | Pulse Evolution Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 315 | 2.195 | Qorvo Inc | HSBC | 3.745 |
| 42.467 | Pulse Evolution Group Inc | Barclays Bank | 4.247 | (7.209) | Qorvo Inc | Morgan Stanley | (32.945) |
| 12.551 | Pulse Evolution Group Inc | Goldman Sachs | 878 | (8.442) | Quad/Graphics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.546 |
| 24.607 | Pulse Evolution Group Inc | HSBC | 10.335 | (7.891) | Quad/Graphics Inc | Barclays Bank | (2.525) |
| 13.486 | PulteGroup Inc | Bank of America Merrill Lynch | 28.984 | (23.188) | Quad/Graphics Inc | HSBC | (596) |
| 24.956 | PulteGroup Inc | Barclays Bank | 59.645 | 1.793 | Quaker Chemical Corp | Bank of America Merrill Lynch | 19.203 |
| 12.426 | PulteGroup Inc | Morgan Stanley | 29.698 | 1.621 | Quaker Chemical Corp | Goldman Sachs | 17.361 |
| 8.946 | Puma Biotechnology Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.074 | 1.742 | Quaker Chemical Corp | HSBC | (3.449) |
| 47.066 | Puma Biotechnology Inc | Barclays Bank | 3.765 | 6.281 | QUALCOMM Inc | Bank of America Merrill Lynch | 28.076 |
| 70.959 | Puma Biotechnology Inc | Goldman Sachs | 8.515 | 675 | QUALCOMM Inc | Barclays Bank | 4.226 |
| 23.284 | Puma Biotechnology Inc | HSBC | 7.451 | 3.651 | QUALCOMM Inc | Goldman Sachs | 13.622 |
| 12.283 | Puma Biotechnology Inc | Morgan Stanley | 983 | 5.686 | QUALCOMM Inc | Morgan Stanley | 35.594 |
| (9.005) | Pure Cycle Corp | Bank of America Merrill Lynch | (9.005) | 18.482 | Qualtrics International Inc 'A' | Goldman Sachs | (19.036) |
| (2.666) | Pure Cycle Corp | Barclays Bank | (1.973) | 4.981 | Qualtrics International Inc 'A' | HSBC | (7.870) |
| (36.487) | Pure Cycle Corp | Goldman Sachs | (36.487) | 1.520 | Qualys Inc | Bank of America Merrill Lynch | 24.948 |
| (41.131) | Pure Cycle Corp | HSBC | (43.656) | (8.284) | Qualys Inc | Barclays Bank | (89.025) |
| (3.541) | Pure Cycle Corp | Morgan Stanley | (2.620) | 1.433 | Qualys Inc | Barclays Bank | 15.591 |
| 6.555 | Pure Storage Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (7.421) | (4.234) | Qualys Inc | Goldman Sachs | (60.824) |
| 11.957 | Pure Storage Inc 'A' | Barclays Bank | 6.098 | 591 | Qualys Inc | Goldman Sachs | 11.564 |
| 24.129 | Pure Storage Inc 'A' | Goldman Sachs | (47.798) | (2.807) | Qualys Inc | HSBC | (59.747) |
| 2.408 | Pure Storage Inc 'A' | HSBC | 4.397 | 1.266 | Qualys Inc | HSBC | 24.670 |
| 2.799 | Pure Storage Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.427 | (1.963) | Qualys Inc | Morgan Stanley | (21.357) |
| (30.956) | Purple Innovation Inc | Barclays Bank | (8.358) | 354 | Qualys Inc | Morgan Stanley | 3.852 |
| (30.915) | Purple Innovation Inc | Goldman Sachs | (25.041) | (1.437) | Quanex Building Products Corp | Bank of America Merrill Lynch | (52) |
| (8.231) | Purple Innovation Inc | HSBC | (18.964) | (37.375) | Quanex Building Products Corp | Barclays Bank | (15.322) |
| 8.171 | PVH Corp | Barclays Bank | 46.248 | (34.943) | Quanex Building Products Corp | Goldman Sachs | (25.676) |
| 14.657 | PVH Corp | Goldman Sachs | 42.066 | 971 | Quanta Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9.040 |
| (465) | PVH Corp | Goldman Sachs | (1.953) | (5.988) | Quanta Services Inc | Barclays Bank | (30.359) |
| 6.431 | PVH Corp | HSBC | 18.457 | 844 | Quanta Services Inc | Barclays Bank | 4.279 |
| 4.049 | Pyxis Oncology Inc | Goldman Sachs | 1.944 | (2.649) | Quanta Services Inc | Goldman Sachs | (14.434) |
| 1.686 | Pyxis Oncology Inc | Morgan Stanley | 34 | 1.785 | Quanta Services Inc | Goldman Sachs | 16.618 |
| 1.907 | Pzena Investment Management Inc 'A' | Barclays Bank | 1.220 | (3.619) | Quanta Services Inc | HSBC | (42.234) |
| 10.314 | Pzena Investment Management Inc 'A' | Goldman Sachs | 8.870 | 1.319 | Quanta Services Inc | HSBC | 10.999 |
| 3.851 | Pzena Investment Management Inc 'A' | HSBC | 2.965 | (5.071) | Quanta Services Inc | Morgan Stanley | (25.710) |
| 36.517 | Pzena Investment Management Inc 'A' | Morgan Stanley | 23.371 | 3.040 | Quanta Services Inc | Morgan Stanley | 15.413 |
| 1.352 | Q2 Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 14.426 | (6.941) | Quanterix Corp | Barclays Bank | (1.735) |
| 6.596 | Q2 Holdings Inc | Barclays Bank | (395) | (1.990) | Quanterix Corp | Goldman Sachs | 1.274 |
| 33.345 | Q2 Holdings Inc | Goldman Sachs | 355.791 | (2.770) | Quanterix Corp | HSBC | 746 |
| 3.272 | Q2 Holdings Inc | HSBC | 36.548 | (21.407) | Quantum Corp | Bank of America Merrill Lynch | (4.710) |
| 3.892 | Q2 Holdings Inc | Morgan Stanley | (234) | (16.400) | Quantum Corp | Barclays Bank | (2.624) |
| 9.463 | QCR Holdings Inc | Barclays Bank | 17.507 | (22.726) | Quantum Corp | Goldman Sachs | (5.000) |
| 16.902 | QCR Holdings Inc | Goldman Sachs | 51.551 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------|-----------------|---|---|----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (68.594) | QuantumScape Corp | Barclays Bank | (88.486) | 4.604 | Rallybio Corp | Barclays Bank | 829 |
| 31.458 | Quantum-Si Inc | Barclays Bank | 9.437 | 2.102 | Rallybio Corp | Goldman Sachs | 4.078 |
| 4.495 | Quantum-Si Inc | Goldman Sachs | 3.551 | 5.091 | Rallybio Corp | HSBC | 14.051 |
| (687) | Quest Diagnostics Inc | Bank of America | | 1.692 | Rallybio Corp | Morgan Stanley | 305 |
| | | Merrill Lynch | (3.318) | 841 | Ralph Lauren Corp | Bank of America | |
| (5.848) | Quest Diagnostics Inc | Barclays Bank | (3.976) | | | Merrill Lynch | (197) |
| (2.977) | Quest Diagnostics Inc | Goldman Sachs | (14.379) | 12.078 | Ralph Lauren Corp | Barclays Bank | 90.464 |
| (7.132) | Quest Diagnostics Inc | HSBC | (42.408) | 10.662 | Ralph Lauren Corp | Goldman Sachs | 1.493 |
| (2.132) | Quest Diagnostics Inc | Morgan Stanley | (1.450) | 8.643 | Ralph Lauren Corp | HSBC | 33.059 |
| (236) | QuidelOrtho Corp | Bank of America | | 3.598 | Ralph Lauren Corp | Morgan Stanley | 26.949 |
| | | Merrill Lynch | (786) | (17.432) | Ramaco Resources Inc | Barclays Bank | 20.918 |
| (1.865) | QuidelOrtho Corp | Barclays Bank | (261) | (5.633) | Ramaco Resources Inc | Goldman Sachs | 9.914 |
| (4.265) | QuidelOrtho Corp | Goldman Sachs | (12.765) | (15.589) | Rambus Inc | Bank of America | |
| (862) | QuidelOrtho Corp | HSBC | (7.939) | | | Merrill Lynch | (4.209) |
| 23.379 | QuinStreet Inc | Barclays Bank | 19.872 | (21.938) | Rambus Inc | Barclays Bank | (8.117) |
| 34.646 | QuinStreet Inc | Goldman Sachs | 30.835 | (8.306) | Rambus Inc | Goldman Sachs | (2.243) |
| (67.942) | Quotient Ltd | Barclays Bank | (2.446) | (4.464) | Rambus Inc | HSBC | (1.671) |
| (67.240) | Quotient Ltd | Goldman Sachs | 558 | (3.488) | Rambus Inc | Morgan Stanley | (1.291) |
| (8.164) | Quotient Ltd | HSBC | 773 | 7.587 | Range Resources Corp | Barclays Bank | 47.987 |
| (15.063) | Quotient Ltd | Morgan Stanley | (542) | 10.070 | Range Resources Corp | Goldman Sachs | 78.538 |
| (8.996) | Quotient Technology Inc | Bank of America | | (3.976) | Range Resources Corp | Goldman Sachs | (31.490) |
| | | Merrill Lynch | (1.349) | (4.679) | Range Resources Corp | HSBC | (41.316) |
| (26.170) | Quotient Technology Inc | Barclays Bank | (1.832) | (10.514) | Range Resources Corp | Morgan Stanley | (66.133) |
| (29.872) | Quotient Technology Inc | Goldman Sachs | (4.481) | 3.928 | Ranger Energy Services Inc | Bank of America | |
| (33.058) | Quotient Technology Inc | HSBC | (1.983) | | | Merrill Lynch | 2.200 |
| (5.362) | Quotient Technology Inc | Morgan Stanley | (375) | 3.685 | Ranger Energy Services Inc | Goldman Sachs | 2.064 |
| 1.097 | Qurate Retail Inc (Pref) | Goldman Sachs | 4.180 | 9.263 | Ranger Energy Services Inc | Morgan Stanley | (1.204) |
| 599 | Qurate Retail Inc (Pref) | HSBC | 1.635 | (33.294) | Ranpak Holdings Corp | Barclays Bank | (12.985) |
| 330 | Qurate Retail Inc (Pref) | Morgan Stanley | 205 | (37.541) | Ranpak Holdings Corp | Goldman Sachs | (36.794) |
| 9.259 | Qurate Retail Inc 'A' | Barclays Bank | 46 | 8.052 | Rapid7 Inc | Barclays Bank | (3.221) |
| (14.017) | Qurate Retail Inc 'A' | Barclays Bank | (70) | 17.073 | Rapid7 Inc | Goldman Sachs | 49.511 |
| 27.718 | Qurate Retail Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.802) | 150 | Rapid7 Inc | Morgan Stanley | (60) |
| (68.887) | Qurate Retail Inc 'A' | Goldman Sachs | 4.478 | (14.016) | RAPT Therapeutics Inc | Barclays Bank | (24.668) |
| 65.624 | Qurate Retail Inc 'A' | HSBC | (5.680) | (249) | RAPT Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (142) |
| (27.638) | Qurate Retail Inc 'A' | HSBC | 3.178 | (1.786) | Rattler Midstream LP | Bank of America | |
| 5.829 | Qurate Retail Inc 'A' | Morgan Stanley | 29 | | | Merrill Lynch | (5.537) |
| (13.972) | R1 RCM Inc | Bank of America | | (46.212) | Rattler Midstream LP | Barclays Bank | (119.227) |
| | | Merrill Lynch | 12.674 | (2.991) | Raymond James | Bank of America | |
| (29.287) | R1 RCM Inc | Barclays Bank | 11.894 | | Financial Inc | Merrill Lynch | (15.314) |
| (15.487) | R1 RCM Inc | Goldman Sachs | 17.346 | (23.751) | Raymond James | | |
| (24.441) | R1 RCM Inc | HSBC | (42.888) | | Financial Inc | Barclays Bank | (120.655) |
| (28.348) | R1 RCM Inc | Morgan Stanley | 15.308 | (6.474) | Raymond James | | |
| (7.516) | Rackspace Technology Inc | Bank of America | | | Financial Inc | HSBC | (36.513) |
| | | Merrill Lynch | 902 | (400) | Raymond James | | |
| (8.449) | Rackspace Technology Inc | Barclays Bank | (3.633) | | Financial Inc | Morgan Stanley | (2.622) |
| (30.325) | Rackspace Technology Inc | Goldman Sachs | 3.639 | (2.528) | Rayonier Advanced | Bank of America | |
| 1.400 | Rackspace Technology Inc | HSBC | (112) | | Materials Inc | Merrill Lynch | 2.857 |
| (21.979) | Rackspace Technology Inc | HSBC | 1.758 | (39.235) | Rayonier Advanced | | |
| 14.946 | Rackspace Technology Inc | Morgan Stanley | 6.427 | | Materials Inc | Barclays Bank | 14.125 |
| 125.668 | Radian Group Inc | Barclays Bank | 71.631 | (10.546) | Rayonier Advanced | | |
| 65.444 | Radian Group Inc | Goldman Sachs | 5.221 | | Materials Inc | Goldman Sachs | 11.917 |
| 107.929 | Radian Group Inc | HSBC | 15.109 | (4.370) | Rayonier Advanced | | |
| 18.561 | Radian Group Inc | Morgan Stanley | 10.579 | | Materials Inc | HSBC | 4.676 |
| 26.471 | Radiant Logistics Inc | Bank of America | | (19.064) | Rayonier Advanced | | |
| | | Merrill Lynch | (6.353) | | Materials Inc | Morgan Stanley | 6.863 |
| 26.454 | Radiant Logistics Inc | Barclays Bank | (794) | (3.854) | Rayonier Inc (REIT) | Bank of America | |
| 20.165 | Radiant Logistics Inc | Goldman Sachs | (4.840) | | | Merrill Lynch | (15.493) |
| 46.536 | Radiant Logistics Inc | HSBC | 27.456 | (16.600) | Rayonier Inc (REIT) | Barclays Bank | (36.188) |
| 47.942 | Radiant Logistics Inc | Morgan Stanley | (1.438) | (22.653) | Rayonier Inc (REIT) | Goldman Sachs | (91.065) |
| (24.192) | Radius Health Inc | Barclays Bank | (5.564) | (5.102) | Rayonier Inc (REIT) | HSBC | (18.928) |
| 1.156 | RadNet Inc | Bank of America | | (14.039) | Rayonier Inc (REIT) | Morgan Stanley | (30.605) |
| | | Merrill Lynch | 180 | (2.081) | RBB Bancorp | Bank of America | |
| 4.839 | RadNet Inc | Barclays Bank | 2.807 | | | Merrill Lynch | (1.845) |
| 1.286 | RadNet Inc | Goldman Sachs | 1.184 | (5.281) | RBB Bancorp | Barclays Bank | (1.901) |
| 8.888 | RadNet Inc | HSBC | 15.818 | (8.537) | RBB Bancorp | Goldman Sachs | (11.098) |
| 2.775 | RadNet Inc | Morgan Stanley | 1.610 | (12.193) | RBB Bancorp | HSBC | (2.561) |
| (16.350) | Rafael Holdings Inc 'B' | Barclays Bank | (2.453) | (3.977) | RBC Bearings Inc | Bank of America | |
| (12.818) | Rafael Holdings Inc 'B' | Goldman Sachs | (3.205) | | | Merrill Lynch | (95.686) |
| (2.725) | Rafael Holdings Inc 'B' | HSBC | 136 | (14.094) | RBC Bearings Inc | Barclays Bank | (304.572) |
| (1.904) | Rafael Holdings Inc 'B' | Morgan Stanley | (286) | (13.689) | RBC Bearings Inc | Goldman Sachs | (329.357) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (2.166) | RBC Bearings Inc | HSBC | (45.638) | (4.178) | Red Rock Resorts Inc 'A' | Morgan Stanley | (7.646) |
| (6.637) | RBC Bearings Inc | Morgan Stanley | (143.426) | (9.248) | Red Violet Inc | Barclays Bank | (740) |
| (2.569) | RCI Hospitality Holdings Inc | Bank of America | | (2.028) | Red Violet Inc | HSBC | 264 |
| | | Merrill Lynch | 1.966 | (10.200) | Redfin Corp | Bank of America | |
| (1.000) | RCI Hospitality Holdings Inc | Barclays Bank | (2.404) | | | Merrill Lynch | 1.632 |
| (1.409) | RCI Hospitality Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.874 | (14.627) | Redfin Corp | Barclays Bank | 1.755 |
| (3.014) | RCI Hospitality Holdings Inc | HSBC | 7.208 | (10.838) | Redfin Corp | Goldman Sachs | 1.734 |
| 1.535 | RCM Technologies Inc | Barclays Bank | 1.949 | (12.586) | Redfin Corp | Morgan Stanley | 1.510 |
| 1.054 | RCM Technologies Inc | HSBC | 1.773 | 4.980 | Redwood Trust Inc (REIT) | Bank of America | |
| 1.600 | RCM Technologies Inc | Morgan Stanley | 2.032 | | | Merrill Lynch | 1.244 |
| 9.590 | RE/MAX Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | 7.288 | 20.621 | Redwood Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 8.042 |
| 1.950 | RE/MAX Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.243 | 4.154 | Redwood Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.537 |
| 25.623 | RE/MAX Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 19.473 | 61.623 | Redwood Trust Inc (REIT) | HSBC | 31.640 |
| (497) | Reading International Inc 'A' | Bank of America | | 15.753 | Redwood Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 6.144 |
| | | Merrill Lynch | (109) | 3.003 | Regal Rexnord Corp | Bank of America | |
| (30.500) | Reading International Inc 'A' | HSBC | 1.830 | | | Merrill Lynch | 4.409 |
| (8.868) | Ready Capital Corp (REIT) | Bank of America | | 7.680 | Regal Rexnord Corp | Barclays Bank | 20.046 |
| | | Merrill Lynch | (177) | 5.311 | Regal Rexnord Corp | Goldman Sachs | 13.395 |
| (20.047) | Ready Capital Corp (REIT) | Barclays Bank | (5.613) | 7.896 | Regal Rexnord Corp | HSBC | 12.731 |
| (35.006) | Ready Capital Corp (REIT) | Goldman Sachs | (700) | 2.665 | Regal Rexnord Corp | Morgan Stanley | 7.864 |
| (33.924) | Ready Capital Corp (REIT) | HSBC | (12.642) | 1.831 | Regency Centers Corp (REIT) | | |
| (15.321) | Ready Capital Corp (REIT) | Morgan Stanley | (4.290) | (2.123) | Regency Centers Corp (REIT) | Barclays Bank | 9.375 |
| 2.038 | Realogy Holdings Corp | Bank of America | | | | Barclays Bank | (10.870) |
| | | Merrill Lynch | 1.814 | 13.185 | Regency Centers Corp (REIT) | | |
| 22.629 | Realogy Holdings Corp | Barclays Bank | 13.577 | (8.844) | Regency Centers Corp (REIT) | Goldman Sachs | 17.738 |
| 4.636 | Realogy Holdings Corp | Goldman Sachs | 6.027 | | | | |
| 14.715 | Realogy Holdings Corp | HSBC | 17.571 | | | | |
| 17.934 | RealReal Inc | Barclays Bank | (179) | | | | |
| 28.019 | RealReal Inc | Goldman Sachs | (4.728) | 3.555 | Regency Centers Corp (REIT) | Goldman Sachs | (4.156) |
| 11.738 | RealReal Inc | HSBC | (16.785) | | | HSBC | 2.253 |
| (14.074) | Realty Income Corp (REIT) | Bank of America | | 18.733 | Regency Centers Corp (REIT) | Morgan Stanley | 95.913 |
| | | Merrill Lynch | 7.218 | (5.231) | Regency Centers Corp (REIT) | | |
| (60.797) | Realty Income Corp (REIT) | Barclays Bank | (18.239) | (41) | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (26.783) |
| (66.084) | Realty Income Corp (REIT) | Goldman Sachs | 35.331 | (841) | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 2.107 |
| (46.070) | Realty Income Corp (REIT) | HSBC | (74.169) | (754) | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (18.394) |
| (8.704) | Realty Income Corp (REIT) | Morgan Stanley | (2.611) | (1.023) | Regeneron Pharmaceuticals Inc | HSBC | (81.467) |
| (3.974) | Reata Pharmaceuticals Inc 'A' | HSBC | (31.593) | (360) | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 902 |
| (2.206) | Reata Pharmaceuticals Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.015) | (4.806) | REGENXBIO Inc | Bank of America | |
| (31.919) | Recro Pharma Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (7.285) |
| | | Merrill Lynch | 3.192 | (1.128) | REGENXBIO Inc | Barclays Bank | (2.279) |
| (41.295) | Recro Pharma Inc | Barclays Bank | 2.065 | (4.117) | REGENXBIO Inc | Goldman Sachs | (3.746) |
| (45.995) | Recro Pharma Inc | Goldman Sachs | 4.600 | (3.766) | REGENXBIO Inc | HSBC | (3.215) |
| (3.123) | Recro Pharma Inc | HSBC | 1.499 | (2.241) | REGENXBIO Inc | Morgan Stanley | (4.527) |
| (7.345) | Recro Pharma Inc | Morgan Stanley | 367 | 2.081 | Regional Management Corp | Barclays Bank | 2.664 |
| 13.685 | Recursion Pharmaceuticals Inc 'A' | Barclays Bank | 3.695 | 7.226 | Regional Management Corp | Goldman Sachs | 24.930 |
| 7.396 | Recursion Pharmaceuticals Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.958 | 12.064 | Regional Management Corp | Morgan Stanley | 15.442 |
| 13.071 | Recursion Pharmaceuticals Inc 'A' | HSBC | 7.844 | 30.294 | Regions Financial Corp | Bank of America | |
| (7.878) | Red River Bancshares Inc | Barclays Bank | 4.845 | | | Merrill Lynch | 62.708 |
| (6.513) | Red River Bancshares Inc | Goldman Sachs | 5.373 | 72.393 | Regions Financial Corp | Barclays Bank | 77.460 |
| (3.874) | Red River Bancshares Inc | HSBC | 5.985 | 145.266 | Regions Financial Corp | Goldman Sachs | 300.701 |
| (5.908) | Red River Bancshares Inc | Morgan Stanley | 3.633 | 56.993 | Regions Financial Corp | HSBC | 69.531 |
| 3.417 | Red Robin Gourmet Burgers Inc | Barclays Bank | 9.499 | 88.506 | Regions Financial Corp | Morgan Stanley | 94.701 |
| 4.295 | Red Robin Gourmet Burgers Inc | Goldman Sachs | 7.173 | (23.054) | Regis Corp | Bank of America | |
| 5.722 | Red Robin Gourmet Burgers Inc | HSBC | 5.150 | (8.027) | Regis Corp | Merrill Lynch | 5.199 |
| 5.517 | Red Robin Gourmet Burgers Inc | Morgan Stanley | 15.337 | (5.604) | Regis Corp | Barclays Bank | 519 |
| (14.794) | Red Rock Resorts Inc 'A' | Bank of America | | (29.549) | Regis Corp | Goldman Sachs | 1.264 |
| | | Merrill Lynch | (6.719) | (7.687) | Regis Corp | HSBC | 14.568 |
| (24.161) | Red Rock Resorts Inc 'A' | Barclays Bank | (44.215) | 1.039 | Reinsurance Group of America Inc | Morgan Stanley | 497 |
| (15.423) | Red Rock Resorts Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.085) | | | Bank of America | |
| (21.362) | Red Rock Resorts Inc 'A' | HSBC | (24.450) | 14.178 | Reinsurance Group of America Inc | Merrill Lynch | 6.743 |
| | | | | | | Barclays Bank | 54.160 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------|---|-----------------|---|-----------|---|-----------------|---|
| | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | |
| 17.123 | Reinsurance | | | (301) | Replimune Group Inc | Morgan Stanley | (147) |
| | Group of America Inc | Goldman Sachs | 111.128 | (49.825) | Repro-Med Systems Inc | Bank of America | |
| 3.947 | Reinsurance | | | | | Merrill Lynch | (2.491) |
| | Group of America Inc | HSBC | 39.707 | (3.548) | Repro-Med Systems Inc | Morgan Stanley | (568) |
| 2.328 | Reinsurance | | | (528) | Republic Bancorp Inc 'A' | Bank of America | |
| | Group of America Inc | Morgan Stanley | 8.893 | | | Merrill Lynch | (1.035) |
| 8.402 | Relay Therapeutics Inc | Barclays Bank | (4.285) | (9.063) | Republic Bancorp Inc 'A' | Barclays Bank | (10.422) |
| 1.498 | Relay Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (749) | (11.263) | Republic Bancorp Inc 'A' | Goldman Sachs | (22.075) |
| 6.773 | Relay Therapeutics Inc | HSBC | 2.301 | (4.459) | Republic Bancorp Inc 'A' | HSBC | (5.752) |
| 16.475 | Reliance Steel | | | 91.287 | Republic First Bancorp Inc | Barclays Bank | 5.477 |
| | & Aluminum Co | Barclays Bank | 340.688 | 121.205 | Republic First Bancorp Inc | Goldman Sachs | 2.424 |
| 71 | Reliance Steel | | | 13.200 | Republic First Bancorp Inc | Morgan Stanley | 792 |
| | & Aluminum Co | Goldman Sachs | 1.097 | 709 | Republic Services Inc | Bank of America | |
| 3.379 | Reliance Steel | | | | | Merrill Lynch | 2.758 |
| | & Aluminum Co | HSBC | 26.964 | 20.990 | Republic Services Inc | Barclays Bank | 76.813 |
| 2.485 | Reliance Steel | | | 4.868 | Republic Services Inc | Goldman Sachs | 17.964 |
| | & Aluminum Co | Morgan Stanley | 51.936 | 19.256 | Republic Services Inc | HSBC | 72.403 |
| 5.807 | Relmada Therapeutics Inc | Barclays Bank | (1.452) | (14.831) | Research Frontiers Inc | Barclays Bank | (1.483) |
| 7.740 | Relmada Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (9.985) | (14.789) | Research Frontiers Inc | HSBC | 444 |
| 8.755 | Relmada Therapeutics Inc | HSBC | (5.778) | (66.270) | Research Frontiers Inc | Morgan Stanley | (6.627) |
| 5.400 | Relmada Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.350) | (3.646) | Resideo Technologies Inc | Bank of America | |
| 10.678 | Remitly Global Inc | Barclays Bank | 3.844 | | | Merrill Lynch | (3.938) |
| 14.831 | Remitly Global Inc | Goldman Sachs | 25.954 | (20.425) | Resideo Technologies Inc | Barclays Bank | (20.834) |
| 3.852 | Remitly Global Inc | HSBC | 12.750 | (25.452) | Resideo Technologies Inc | HSBC | (1.093) |
| (9.474) | RenaissanceRe | | | (951) | ResMed Inc | Bank of America | |
| | Holdings Ltd | Barclays Bank | (31.548) | | | Merrill Lynch | (6.423) |
| 5.985 | RenaissanceRe | | | 248 | ResMed Inc | Bank of America | |
| | Holdings Ltd | Barclays Bank | 19.930 | | | Merrill Lynch | 1.694 |
| (8.425) | RenaissanceRe | | | 137 | ResMed Inc | Barclays Bank | 723 |
| | Holdings Ltd | HSBC | (88.463) | (6.285) | ResMed Inc | Goldman Sachs | (42.927) |
| 2.115 | RenaissanceRe | | | 2.005 | ResMed Inc | Goldman Sachs | 13.461 |
| | Holdings Ltd | HSBC | 22.207 | (1.229) | ResMed Inc | Morgan Stanley | (6.489) |
| (2.526) | RenaissanceRe | | | 37.762 | Resources Connection Inc | Barclays Bank | 29.832 |
| | Holdings Ltd | Morgan Stanley | (8.412) | (119.769) | Retail Opportunity | | |
| (9.300) | Renasant Corp | Bank of America | | | Investments Corp (REIT) | Barclays Bank | (128.752) |
| | | Merrill Lynch | (10.642) | (103.438) | Retail Opportunity | | |
| (13.076) | Renasant Corp | Barclays Bank | (3.298) | | Investments Corp (REIT) | Goldman Sachs | (20.170) |
| (8.015) | Renasant Corp | HSBC | (3.204) | (157.951) | Retail Opportunity | | |
| (12.310) | Renasant Corp | Morgan Stanley | (4.897) | | Investments Corp (REIT) | HSBC | (114.514) |
| 1.801 | Reneo Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | (4.635) | Retractable | | |
| | | Merrill Lynch | 36 | | Technologies Inc | Morgan Stanley | (1.391) |
| 2.149 | Reneo Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 322 | (35.335) | REV Group Inc | Barclays Bank | (16.961) |
| 1.471 | Reneo Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 221 | (34.216) | REV Group Inc | Goldman Sachs | (9.238) |
| (2.893) | Renewable Energy | | | (1.780) | REV Group Inc | HSBC | (178) |
| | Group Inc | Barclays Bank | 145 | (1.877) | REV Group Inc | Morgan Stanley | (901) |
| (813) | Renewable Energy | | | 8.162 | Revance Therapeutics Inc | Barclays Bank | 6.122 |
| | Group Inc | Goldman Sachs | (154) | 23.597 | Revance Therapeutics Inc | HSBC | (17.632) |
| (886) | Renewable Energy | | | (11.645) | Revlon Inc 'A' | HSBC | 8.268 |
| | Group Inc | HSBC | (310) | (8.375) | REVOLUTION | | |
| (8.180) | Rent the Runway Inc 'A' | Barclays Bank | (5.399) | | Medicines Inc | Barclays Bank | (586) |
| (3.880) | Rent the Runway Inc 'A' | HSBC | 4.889 | (6.264) | REVOLUTION | | |
| (7.338) | Rent-A-Center Inc | Barclays Bank | (18.125) | | Medicines Inc | Goldman Sachs | (8.412) |
| (9.392) | Rent-A-Center Inc | Goldman Sachs | 18.127 | (3.520) | REVOLUTION | | |
| (6.967) | Rent-A-Center Inc | HSBC | 9.754 | | Medicines Inc | HSBC | (6.019) |
| (18.799) | Rentech Inc | Morgan Stanley | 56 | (1.756) | REVOLUTION | | |
| 12.137 | Repay Holdings Corp | Bank of America | | | Medicines Inc | Morgan Stanley | (123) |
| | | Merrill Lynch | 20.624 | (64) | Revolve Group Inc | Bank of America | |
| 7.305 | Repay Holdings Corp | Barclays Bank | (950) | | | Merrill Lynch | (20) |
| 9.643 | Repay Holdings Corp | Goldman Sachs | 15.865 | 949 | Revolve Group Inc | Bank of America | |
| 9.860 | Repay Holdings Corp | HSBC | 7.338 | | | Merrill Lynch | 304 |
| 401 | Repligen Corp | Bank of America | | (11.386) | Revolve Group Inc | Barclays Bank | (19.584) |
| | | Merrill Lynch | 5.441 | (10.560) | Revolve Group Inc | Goldman Sachs | (3.379) |
| 434 | Repligen Corp | Barclays Bank | 5.821 | (646) | Revolve Group Inc | HSBC | 1.518 |
| 1.773 | Repligen Corp | Goldman Sachs | 27.889 | (2.214) | Revolve Group Inc | Morgan Stanley | (3.808) |
| 1.010 | Repligen Corp | HSBC | 19.254 | (1.075) | REX American | | |
| 528 | Repligen Corp | Morgan Stanley | 6.494 | | Resources Corp | Barclays Bank | 2.387 |
| (2.233) | Replimune Group Inc | Barclays Bank | (1.094) | (517) | REX American | | |
| (9.882) | Replimune Group Inc | Goldman Sachs | (1.779) | | Resources Corp | Goldman Sachs | 2.099 |
| (3.976) | Replimune Group Inc | HSBC | (3.539) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3) | REX American Resources Corp | Morgan Stanley | 7 | 24.562 | Riverview Bancorp Inc | Goldman Sachs | 15.720 |
| 6.111 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | Bank of America | | 31.593 | Riverview Bancorp Inc | Morgan Stanley | 10.110 |
| 8.715 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | Merrill Lynch | (341) | (6.401) | Rivian Automotive Inc 'A' | Goldman Sachs | (38.854) |
| 11.023 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | Barclays Bank | 4.619 | 3.299 | Rivian Automotive Inc 'A' | Goldman Sachs | 12.009 |
| 10.993 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | Goldman Sachs | (16.135) | (1.166) | Rivian Automotive Inc 'A' | Morgan Stanley | (5.533) |
| 4.144 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | HSBC | (32.787) | 19.461 | RLI Corp | Barclays Bank | 65.584 |
| (856) | Reynolds Consumer Products Inc | Morgan Stanley | 2.196 | 11.734 | RLI Corp | Goldman Sachs | (1.408) |
| (14.156) | Reynolds Consumer Products Inc | Merrill Lynch | 984 | 2.448 | RLI Corp | HSBC | (1.151) |
| (15.780) | Reynolds Consumer Products Inc | Barclays Bank | (708) | (10.088) | RLJ Lodging Trust (REIT) | Bank of America | |
| 10.431 | Reynolds Consumer Products Inc | Goldman Sachs | 18.147 | (34.186) | RLJ Lodging Trust (REIT) | Merrill Lynch | (3.929) |
| (41.345) | Reynolds Consumer Products Inc | HSBC | 73.032 | (10.957) | RLJ Lodging Trust (REIT) | Barclays Bank | (32.477) |
| 9.713 | Reynolds Consumer Products Inc | Morgan Stanley | 486 | (10.536) | RLJ Lodging Trust (REIT) | Goldman Sachs | (821) |
| (5.830) | RGC Resources Inc | Bank of America | | (10.536) | RLJ Lodging Trust (REIT) | HSBC | (11.800) |
| (6.892) | RGC Resources Inc | Merrill Lynch | (583) | 4.516 | RMR Group Inc 'A' | Bank of America | |
| (7.553) | RGC Resources Inc | Barclays Bank | (414) | 20.372 | RMR Group Inc 'A' | Merrill Lynch | 5.329 |
| (7.122) | RGC Resources Inc | Goldman Sachs | (755) | 8.299 | RMR Group Inc 'A' | Barclays Bank | 31.861 |
| (1.716) | RH | HSBC | 1.211 | 14.164 | RMR Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 9.793 |
| (1.623) | RH | Bank of America | (15.221) | 7.989 | RMR Group Inc 'A' | HSBC | 31.302 |
| (1.370) | RH | Merrill Lynch | (52.391) | (11.680) | Roadrunner Transportation Systems Inc | Morgan Stanley | 13.102 |
| (1.319) | RH | Barclays Bank | (2.466) | (1.411) | Roadrunner Transportation Systems Inc | Bank of America | (1.752) |
| 9.289 | Rhythm Pharmaceuticals Inc | HSBC | 42.577) | (11.046) | Roadrunner Transportation Systems Inc | Merrill Lynch | (212) |
| 2.606 | Ribbon Communications Inc | Morgan Stanley | 372 | (11.046) | Robert Half International Inc | Goldman Sachs | 42.859 |
| 16.458 | Ribbon Communications Inc | Bank of America | (339) | (46.902) | Robinhood Markets Inc 'A' | Barclays Bank | (11.726) |
| 12.272 | Ribbon Communications Inc | Merrill Lynch | 1.975 | (6.746) | ROBLOX Corp 'A' | Barclays Bank | (6.881) |
| 14.805 | Ribbon Communications Inc | Barclays Bank | (1.595) | 1.208 | ROBLOX Corp 'A' | Goldman Sachs | (1.280) |
| 13.800 | Richmond Mutual BanCorp Inc | Goldman Sachs | 4.278 | (2.494) | ROBLOX Corp 'A' | Goldman Sachs | (10.556) |
| 27.600 | Richmond Mutual BanCorp Inc | HSBC | 8.556 | 9.387 | ROBLOX Corp 'A' | Goldman Sachs | 60.734 |
| 4.463 | Richmond Mutual BanCorp Inc | Barclays Bank | 1.384 | 3.800 | ROBLOX Corp 'A' | HSBC | 7.850 |
| (40.652) | Rigel Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 4.878 | (130.187) | Rocket Cos Inc 'A' | Morgan Stanley | |
| (47.407) | Rigel Pharmaceuticals Inc | Bank of America | 9.007 | (23.118) | Rocket Cos Inc 'A' | Bank of America | |
| (40.152) | Rigel Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | 4.417 | (2.688) | Rocket Cos Inc 'A' | Merrill Lynch | (111.961) |
| (7.771) | Riley Exploration Permian Inc | Barclays Bank | (31.783) | (17.933) | Rocket Cos Inc 'A' | Barclays Bank | (9.479) |
| (10.720) | Rimini Street Inc | Goldman Sachs | (4.074) | (9.442) | Rocket Lab USA Inc | Goldman Sachs | (2.312) |
| (15.143) | Rimini Street Inc | Barclays Bank | (8.026) | (7.128) | Rocket Lab USA Inc | Morgan Stanley | (7.353) |
| (23.899) | Rimini Street Inc | Goldman Sachs | (11.950) | 22.095 | Rocket Lab USA Inc | Barclays Bank | (2.974) |
| 6.216 | Ring Energy Inc | HSBC | 3.108 | 19.856 | Rocket Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (2.245) |
| 8.089 | Ring Energy Inc | Barclays Bank | 3.108 | 8.540 | Rocket Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| 7.386 | Ring Energy Inc | Goldman Sachs | 3.155 | 2.288 | Rocket Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | 59.656 |
| 7.157 | RingCentral Inc 'A' | HSBC | 3.693 | (3.167) | Rocket Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 47.815 |
| 10.521 | RingCentral Inc 'A' | Barclays Bank | 13.098 | 222 | Rockwell Automation Inc | HSBC | 29.890 |
| 15.694 | RingCentral Inc 'A' | Goldman Sachs | 33.207 | (7.637) | Rockwell Automation Inc | Bank of America | |
| 15.780 | RingCentral Inc 'A' | Barclays Bank | 26.374 | (7.637) | Rockwell Automation Inc | Merrill Lynch | 13.911 |
| (43.303) | Riot Blockchain Inc | Goldman Sachs | (21.002) | 2.692 | Rockwell Automation Inc | Barclays Bank | (18.400) |
| (4.329) | Riot Blockchain Inc | HSBC | (2.100) | (465) | Rockwell Automation Inc | Goldman Sachs | 1.290 |
| 4.598 | Rite Aid Corp | Barclays Bank | (276) | (1.775) | Rockwell Automation Inc | Goldman Sachs | (46.433) |
| 14.050 | Rite Aid Corp | Morgan Stanley | (2.248) | (1.810) | Rockwell Medical Inc | HSBC | 17.291 |
| 5.922 | Rite Aid Corp | Barclays Bank | 2.426 | (725) | Rockwell Medical Inc | HSBC | (2.441) |
| 24.268 | Rite Aid Corp | Goldman Sachs | (1.456) | (7.942) | Rockwell Medical Inc | Morgan Stanley | (10.313) |
| 106.206 | Riverview Bancorp Inc | HSBC | 67.972 | (1.846) | Rocky Brands Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | | (6.844) | Rocky Brands Inc | Merrill Lynch | 222 |
| | | | | (4.784) | Rocky Brands Inc | Barclays Bank | (19.437) |
| | | | | (6.218) | Rocky Brands Inc | Goldman Sachs | 574 |
| | | | | 3.120 | Roivant Sciences Ltd | HSBC | (13.991) |
| | | | | 9.182 | Roivant Sciences Ltd | Barclays Bank | 1.030 |
| | | | | 14.684 | Roivant Sciences Ltd | Goldman Sachs | 4.132 |
| | | | | (2.193) | Roku Inc | HSBC | 12.041 |
| | | | | 3.926 | Roku Inc | Bank of America | |
| | | | | (887) | Roku Inc | Merrill Lynch | (13.273) |
| | | | | 452 | Roku Inc | Barclays Bank | 12.288 |
| | | | | 1.019 | Roku Inc | Barclays Bank | (2.776) |
| | | | | (796) | Rollins Inc | HSBC | 5.109 |
| | | | | (28.624) | Rollins Inc | Morgan Stanley | 5.693 |
| | | | | | | Morgan Stanley | (2.491) |
| | | | | | | Barclays Bank | (16.130) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (17.487) | Rollins Inc | Goldman Sachs | (17.237) | 4.679 | Rush Enterprises Inc 'A' | HSBC | (6.902) |
| (38.773) | Rollins Inc | HSBC | (79.523) | 3.115 | Rush Enterprises Inc 'B' | Bank of America | |
| (13.139) | Rollins Inc | Morgan Stanley | (7.695) | | | Merrill Lynch | 1.184 |
| (5.945) | Romeo Power Inc | Bank of America | | 12.287 | Rush Enterprises Inc 'B' | Barclays Bank | 25.434 |
| | | Merrill Lynch | 1.006 | 8.302 | Rush Enterprises Inc 'B' | Goldman Sachs | 3.155 |
| (161.760) | Romeo Power Inc | Barclays Bank | 12.973 | 4.585 | Rush Enterprises Inc 'B' | HSBC | (734) |
| (21.694) | Romeo Power Inc | Goldman Sachs | 3.673 | 8.509 | Rush Enterprises Inc 'B' | Morgan Stanley | 17.614 |
| (2.224) | Romeo Power Inc | Morgan Stanley | 178 | 5.135 | Rush Street Interactive Inc | Bank of America | |
| 20.852 | Root Inc 'A' | Barclays Bank | 3.232 | | | Merrill Lynch | (197) |
| 10.447 | Root Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.410 | 9.352 | Rush Street Interactive Inc | Barclays Bank | — |
| 789 | Roper Technologies Inc | Bank of America | | 13.219 | Rush Street Interactive Inc | Goldman Sachs | 2.926 |
| | | Merrill Lynch | 19.288 | 12.013 | Rush Street Interactive Inc | HSBC | 6.487 |
| 96 | Roper Technologies Inc | Barclays Bank | 1.542 | 2.903 | Rush Street Interactive Inc | Morgan Stanley | — |
| 816 | Roper Technologies Inc | Goldman Sachs | 8.250 | (2.368) | Ruth's Hospitality Group Inc | Bank of America | |
| 4.107 | Roper Technologies Inc | HSBC | 29.211 | | | Merrill Lynch | 47 |
| 6.965 | Roper Technologies Inc | Morgan Stanley | 111.858 | (6.079) | Ruth's Hospitality Group Inc | Barclays Bank | (7.778) |
| (6.480) | Ross Stores Inc | Bank of America | | (10.137) | Ruth's Hospitality Group Inc | Goldman Sachs | 203 |
| | | Merrill Lynch | 43.934 | (40.929) | Ruth's Hospitality Group Inc | HSBC | (5.908) |
| (7.705) | Ross Stores Inc | Goldman Sachs | 53.940 | (1.294) | Ruth's Hospitality Group Inc | Morgan Stanley | (1.721) |
| 22.836 | Ross Stores Inc | HSBC | (106.459) | (4.992) | RxSight Inc | Barclays Bank | (1.448) |
| 890 | Ross Stores Inc | Morgan Stanley | 5.589 | (1.554) | RxSight Inc | HSBC | (4.864) |
| (934) | Ross Stores Inc | Morgan Stanley | (5.866) | 9.916 | Ryder System Inc | Barclays Bank | 7.834 |
| (7.139) | Roth CH Acquisition I Co | | | 5.607 | Ryerson Holding Corp | Goldman Sachs | 19.064 |
| | Parent Corp | Goldman Sachs | (5.140) | (2.771) | Ryman Hospitality | Bank of America | |
| (29.557) | Roth CH Acquisition I Co | | | | Properties Inc (REIT) | Merrill Lynch | (4.115) |
| | Parent Corp | HSBC | (40.789) | (20.403) | Ryman Hospitality | | |
| (1.652) | Rover Group Inc | Goldman Sachs | (1.520) | | Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (118.949) |
| (25.831) | Rover Group Inc | HSBC | (3.487) | (2.165) | Ryman Hospitality | | |
| 1.262 | Royal Caribbean | Bank of America | | | Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (346) |
| | Cruises Ltd | Merrill Lynch | 715 | (5.452) | Ryman Hospitality | | |
| 2.109 | Royal Caribbean | Barclays Bank | 6.158 | | Properties Inc (REIT) | HSBC | (23.649) |
| | Cruises Ltd | | | (1.112) | Ryman Hospitality | | |
| (6.924) | Royal Caribbean | Goldman Sachs | 7.505 | | Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (6.483) |
| | Cruises Ltd | | | 4.350 | S&P Global Inc | HSBC | 110.403 |
| 8.630 | Royal Caribbean | | | (31.691) | S&T Bancorp Inc | Barclays Bank | (19.965) |
| | Cruises Ltd | Goldman Sachs | (27.977) | (31.719) | S&T Bancorp Inc | Goldman Sachs | (55.508) |
| 15.067 | Royal Caribbean | | | (23.055) | S&T Bancorp Inc | HSBC | (18.905) |
| | Cruises Ltd | HSBC | (35.693) | (4.520) | S&T Bancorp Inc | Morgan Stanley | (2.848) |
| (1.674) | Royal Caribbean | | | (13.970) | Sabra Health Care Inc | Bank of America | |
| | Cruises Ltd | Morgan Stanley | (4.888) | | (REIT) | Merrill Lynch | (11.735) |
| 1.502 | Royal Gold Inc | Bank of America | | (104.791) | Sabra Health Care Inc | | |
| | | Merrill Lynch | (1.232) | | (REIT) | Barclays Bank | (84.881) |
| 6.799 | Royal Gold Inc | Barclays Bank | 12.344 | 9.465 | Sabra Health Care Inc | | |
| (2.108) | Royal Gold Inc | Barclays Bank | (4.026) | | (REIT) | Barclays Bank | 7.667 |
| (1.219) | Royal Gold Inc | Goldman Sachs | 1.000 | (44.098) | Sabra Health Care Inc | | |
| 4.139 | Royal Gold Inc | HSBC | (32.284) | | (REIT) | Goldman Sachs | (37.043) |
| (2.693) | Royal Gold Inc | HSBC | 2.962 | (26.786) | Sabra Health Care Inc | | |
| (5.935) | Royalty Pharma Plc 'A' | Barclays Bank | (3.620) | | (REIT) | HSBC | (24.911) |
| (19.475) | Royalty Pharma Plc 'A' | Goldman Sachs | (9.758) | (23.334) | Sabra Health Care Inc | | |
| (9.806) | Royalty Pharma Plc 'A' | HSBC | (30.693) | | (REIT) | Morgan Stanley | (18.901) |
| (10.301) | Royalty Pharma Plc 'A' | Morgan Stanley | (6.283) | 10.967 | Sabre Corp | Bank of America | |
| (54.252) | RPC Inc | Barclays Bank | (40.146) | | | Merrill Lynch | 7.019 |
| (17.348) | RPM International Inc | Barclays Bank | (63.320) | 18.545 | Sabre Corp | Barclays Bank | 2.411 |
| (36.312) | RPM International Inc | Goldman Sachs | (194.269) | 54.336 | Sabre Corp | Goldman Sachs | 34.775 |
| (9.450) | RPM International Inc | HSBC | (42.609) | (13.040) | Sabre Corp | Morgan Stanley | (1.695) |
| (15.359) | RPM International Inc | Morgan Stanley | (56.060) | 3.042 | Sabre Corp | Morgan Stanley | 395 |
| 24.987 | RPT Realty (REIT) | Bank of America | | (7.925) | Safe Bulkers Inc | Barclays Bank | (1.228) |
| | | Merrill Lynch | (6.497) | (45.671) | Safe Bulkers Inc | HSBC | (41.332) |
| 71.296 | RPT Realty (REIT) | Barclays Bank | 62.740 | (216.832) | Safeguard Scientifics Inc | Bank of America | |
| 106.357 | RPT Realty (REIT) | Goldman Sachs | (27.653) | | | Merrill Lynch | (184.307) |
| 62.007 | RPT Realty (REIT) | HSBC | (7.441) | (9.877) | Safeguard Scientifics Inc | Barclays Bank | (6.223) |
| 23.017 | RPT Realty (REIT) | Morgan Stanley | 20.255 | (6.589) | Safeguard Scientifics Inc | Goldman Sachs | (5.601) |
| (15.110) | Rubicon Technology Inc | Morgan Stanley | (378) | (2.105) | Safety Insurance Group Inc | Bank of America | |
| (21.926) | Rubius Therapeutics Inc | Barclays Bank | (2.631) | | | Merrill Lynch | (18.019) |
| 6.556 | Rush Enterprises Inc 'A' | Bank of America | | (8.900) | Safety Insurance Group Inc | Barclays Bank | (39.160) |
| | | Merrill Lynch | (4.491) | (17.222) | Safety Insurance Group Inc | Goldman Sachs | (147.420) |
| 37.590 | Rush Enterprises Inc 'A' | Barclays Bank | 46.800 | (10.206) | Safety Insurance Group Inc | HSBC | (61.793) |
| 29.161 | Rush Enterprises Inc 'A' | Goldman Sachs | (19.975) | (5.379) | Safety Insurance Group Inc | Morgan Stanley | (23.668) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------|---|-------------------------------|---|----------|---|-------------------------------|---|
| | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | |
| 225 | Saga Communications Inc 'A' | Barclays Bank | 43 | (23.676) | Sapiens International Corp NV | Barclays Bank | (22.966) |
| 6.550 | Saga Communications Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.048 | (3.872) | Sarcos Technology and Robotics Corp | Barclays Bank | (736) |
| 458 | Saga Communications Inc 'A' | HSBC | 32 | 620 | Sarepta Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.863 |
| 2.232 | Saga Communications Inc 'A' | Morgan Stanley | 424 | (1.373) | Sarepta Therapeutics Inc | Barclays Bank | (2.952) |
| 3.596 | Sage Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.994) | 653 | Sarepta Therapeutics Inc | Barclays Bank | 1.404 |
| (6.929) | Sage Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 6.098 | (830) | Sarepta Therapeutics Inc | HSBC | (7.138) |
| 6.727 | Sage Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (5.920) | 989 | Sarepta Therapeutics Inc | HSBC | 4.800 |
| 9.566 | Sage Therapeutics Inc | HSBC | 36.542 | (1.192) | Sarepta Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (2.563) |
| (2.513) | Saia Inc | Barclays Bank | (10.504) | 1.289 | Sarepta Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 2.771 |
| (3.568) | Saia Inc | Goldman Sachs | 16.876 | (2.758) | Saul Centers Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (855) |
| (1.191) | Saia Inc | HSBC | 18.082 | (22.060) | Saul Centers Inc (REIT) | Barclays Bank | (48.311) |
| (720) | Saia Inc | Morgan Stanley | (3.010) | (11.736) | Saul Centers Inc (REIT) | Goldman Sachs | (3.638) |
| (1.061) | Sailpoint Technologies Holdings Inc | Barclays Bank | (212) | (843) | Saul Centers Inc (REIT) | HSBC | (135) |
| 1.554 | Sailpoint Technologies Holdings Inc | Barclays Bank | 311 | (353) | Saul Centers Inc (REIT) | Morgan Stanley | (773) |
| (3.966) | Sailpoint Technologies Holdings Inc | Goldman Sachs | (9.558) | (58.571) | Savara Inc | Barclays Bank | 1.757 |
| (7.782) | Sailpoint Technologies Holdings Inc | HSBC | (2.724) | (3.687) | SB Financial Group Inc | Barclays Bank | (995) |
| 1.187 | salesforce.com Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.226) | 4.291 | SBA Communications Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 38.748 |
| 5.748 | salesforce.com Inc | Barclays Bank | 1.380 | 185 | SBA Communications Corp (REIT) | Barclays Bank | 622 |
| 1.675 | salesforce.com Inc | Goldman Sachs | (5.963) | (1.511) | SBA Communications Corp (REIT) | Barclays Bank | (5.077) |
| 2.461 | salesforce.com Inc | HSBC | (3.275) | 844 | SBA Communications Corp (REIT) | Goldman Sachs | 7.621 |
| 7.135 | salesforce.com Inc | Morgan Stanley | 1.712 | 988 | SBA Communications Corp (REIT) | HSBC | 14.188 |
| 6.032 | Salisbury Bancorp Inc | Barclays Bank | 12.004 | (311) | SBA Communications Corp (REIT) | HSBC | (4.466) |
| 7.322 | Salisbury Bancorp Inc | Goldman Sachs | 21.161 | 5.928 | SBA Communications Corp (REIT) | Morgan Stanley | 19.918 |
| 1.950 | Salisbury Bancorp Inc | HSBC | 6.513 | (406) | SBA Communications Corp (REIT) | Morgan Stanley | (1.364) |
| (2.779) | Sally Beauty Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (584) | 11.688 | ScanSource Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.831) |
| (1.764) | Sally Beauty Holdings Inc | Barclays Bank | (2.752) | 19.075 | ScanSource Inc | Barclays Bank | 33.572 |
| (22.365) | Sally Beauty Holdings Inc | Goldman Sachs | (4.042) | 4.809 | ScanSource Inc | Goldman Sachs | (3.222) |
| (27.778) | Sally Beauty Holdings Inc | HSBC | (6.908) | 2.640 | ScanSource Inc | HSBC | 10.270 |
| (2.301) | Sally Beauty Holdings Inc | Morgan Stanley | (3.590) | 3.177 | ScanSource Inc | Morgan Stanley | 5.592 |
| 29.816 | Sana Biotechnology Inc | Barclays Bank | 19.679 | 2.151 | Schlumberger NV | Bank of America Merrill Lynch | 12.196 |
| 11.047 | Sana Biotechnology Inc | HSBC | (7.291) | 65.184 | Schlumberger NV | Barclays Bank | 260.736 |
| 850 | Sanderson Farms Inc | Bank of America Merrill Lynch | 11.207 | 17.871 | Schlumberger NV | Goldman Sachs | 101.328 |
| (1.080) | Sanderson Farms Inc | Barclays Bank | (9.817) | 12.026 | Schlumberger NV | HSBC | 82.836 |
| 7.949 | Sanderson Farms Inc | Barclays Bank | 72.256 | 23.162 | Schneider National Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 6.717 |
| (549) | Sanderson Farms Inc | Goldman Sachs | (7.395) | (4.240) | Schneider National Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (1.230) |
| 5.688 | Sanderson Farms Inc | Goldman Sachs | 76.719 | 22.104 | Schneider National Inc 'B' | Barclays Bank | 19.452 |
| (1.856) | Sanderson Farms Inc | HSBC | (25.367) | (8.996) | Schneider National Inc 'B' | Barclays Bank | (7.916) |
| 9.894 | Sanderson Farms Inc | HSBC | 160.382 | 29.494 | Schneider National Inc 'B' | Goldman Sachs | 8.553 |
| (2.234) | Sanderson Farms Inc | Morgan Stanley | (20.027) | (4.174) | Schneider National Inc 'B' | Goldman Sachs | (1.210) |
| 1.355 | Sanderson Farms Inc | Morgan Stanley | 12.317 | 33.251 | Schneider National Inc 'B' | HSBC | (15.960) |
| 20.843 | SandRidge Energy Inc | Barclays Bank | 81.079 | 57.130 | Schneider National Inc 'B' | Morgan Stanley | 50.274 |
| 11.898 | Sandy Spring Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 38.759 | (1.791) | Schnitzer Steel Industries Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (6.018) |
| 36.333 | Sandy Spring Bancorp Inc | Barclays Bank | 50.866 | (2.542) | Schnitzer Steel Industries Inc 'A' | Barclays Bank | (6.122) |
| 15.767 | Sandy Spring Bancorp Inc | Goldman Sachs | 57.392 | (7.853) | Schnitzer Steel Industries Inc 'A' | Goldman Sachs | (27.207) |
| 13.673 | Sandy Spring Bancorp Inc | HSBC | 41.664 | (3.774) | Schnitzer Steel Industries Inc 'A' | HSBC | (10.261) |
| 4.864 | Sandy Spring Bancorp Inc | Morgan Stanley | 6.966 | (628) | Schnitzer Steel Industries Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.915) |
| 23.345 | Sangamo Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.603) | (4.441) | Scholar Rock Holding Corp | Barclays Bank | 1.332 |
| 83.103 | Sangamo Therapeutics Inc | Barclays Bank | (18.377) | (4.672) | Scholar Rock Holding Corp | Morgan Stanley | 1.402 |
| 51.593 | Sangamo Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (12.382) | (6.431) | Scholastic Corp | Barclays Bank | (12.540) |
| 44.952 | Sangamo Therapeutics Inc | HSBC | (4.497) | | | | |
| 29.231 | Sangamo Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.888) | | | | |
| 3.734 | Sanmina Corp | Bank of America Merrill Lynch | 10.567 | | | | |
| 8.991 | Sanmina Corp | Barclays Bank | 15.105 | | | | |
| 33.351 | Sanmina Corp | Goldman Sachs | 88.788 | | | | |
| 22.976 | Sanmina Corp | HSBC | 72.408 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|--------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (6.968) | Scholastic Corp | Goldman Sachs | (6.898) | (10.197) | Seagate Technology Holdings Plc | Morgan Stanley | (3.773) |
| 1.911 | Schrodinger Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.032 | (1.021) | Seagen Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.696 |
| 1.789 | Schrodinger Inc | Barclays Bank | 2.290 | (2.545) | Seagen Inc | Barclays Bank | 1.069 |
| 9.122 | Schrodinger Inc | Goldman Sachs | 19.247 | (1.424) | Seagen Inc | Goldman Sachs | 5.494 |
| 3.817 | Schrodinger Inc | HSBC | 9.886 | (2.214) | Seagen Inc | Morgan Stanley | (808) |
| 1.340 | Schrodinger Inc | Morgan Stanley | 1.715 | (5.706) | Sealed Air Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.343) |
| (15.467) | Schweitzer-Mauduit International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (619) | (326) | Sealed Air Corp | Barclays Bank | (505) |
| (25.195) | Schweitzer-Mauduit International Inc | Barclays Bank | (5.543) | 23.495 | Sealed Air Corp | Goldman Sachs | 1.645 |
| (22.395) | Schweitzer-Mauduit International Inc | Goldman Sachs | (1.362) | (4.655) | Sealed Air Corp | Goldman Sachs | (326) |
| (5.930) | Schweitzer-Mauduit International Inc | HSBC | (3.333) | (6.066) | Sealed Air Corp | HSBC | 4.950 |
| (1.146) | Schweitzer-Mauduit International Inc | Morgan Stanley | (252) | 12.777 | Sealed Air Corp | Morgan Stanley | 19.804 |
| 681 | Science Applications International Corp | Barclays Bank | 2.377 | (1.450) | Sealed Air Corp | Morgan Stanley | (2.248) |
| 5.870 | Science Applications International Corp | Goldman Sachs | 13.560 | 5.062 | SeaSpine Holdings Corp | Barclays Bank | 863 |
| (18.587) | Science Applications International Corp | HSBC | (84.199) | 10.497 | SeaSpine Holdings Corp | Goldman Sachs | 1.827 |
| 3.570 | Science Applications International Corp | HSBC | 16.172 | 3.068 | SeaSpine Holdings Corp | HSBC | 442 |
| 3.935 | Science Applications International Corp | Morgan Stanley | 13.733 | 18.526 | SeaSpine Holdings Corp | Morgan Stanley | 2.223 |
| (6.047) | Scientific Games Corp | Bank of America Merrill Lynch | (19.290) | (3.309) | SeaWorld Entertainment Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.522 |
| (28.857) | Scientific Games Corp | Barclays Bank | (40.688) | (24.097) | SeaWorld Entertainment Inc | Barclays Bank | (30.675) |
| (18.645) | Scientific Games Corp | HSBC | (78.161) | (10.520) | SeaWorld Entertainment Inc | Goldman Sachs | 19.898 |
| 758 | Scorpio Tankers Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.297 | (9.814) | SeaWorld Entertainment Inc | HSBC | 16.930 |
| 10.077 | Scorpio Tankers Inc | Barclays Bank | 28.417 | (6.016) | Second Sight Medical Products Inc | Barclays Bank | (1.444) |
| 1.410 | Scorpio Tankers Inc | Morgan Stanley | 3.976 | (1.405) | SecureWorks Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (660) |
| (2.765) | Scotts Miracle-Gro Co | Bank of America Merrill Lynch | (3.954) | (14.162) | SecureWorks Corp 'A' | Morgan Stanley | (1.133) |
| (4.177) | Scotts Miracle-Gro Co | Barclays Bank | (20.911) | (1.664) | Security Devices International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.195) |
| (2.135) | Scotts Miracle-Gro Co | Goldman Sachs | (3.053) | (35.102) | Security Devices International Inc | Barclays Bank | (28.082) |
| (4.853) | Scotts Miracle-Gro Co | HSBC | 33.437 | (3.876) | Security Devices International Inc | Goldman Sachs | (7.442) |
| (327) | Scotts Miracle-Gro Co | Morgan Stanley | (1.916) | (3.962) | Security Devices International Inc | HSBC | (9.073) |
| (13.909) | scPharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.252) | 13.316 | Security National Financial Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 11.785 |
| (15.143) | scPharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 5.754 | 27.563 | Security National Financial Corp 'A' | Barclays Bank | 23.015 |
| (8.135) | scPharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (732) | 26.179 | Security National Financial Corp 'A' | Goldman Sachs | 23.168 |
| (1.868) | Sculptor Capital Management Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.980) | 5.913 | Security National Financial Corp 'A' | HSBC | 5.470 |
| (17.507) | Sculptor Capital Management Inc | Barclays Bank | (7.878) | 10.095 | Security National Financial Corp 'A' | Morgan Stanley | 8.429 |
| (9.308) | Sculptor Capital Management Inc | HSBC | (10.124) | (2.073) | Seelos Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (132) |
| (128) | Seaboard Corp | Barclays Bank | (58.645) | (11.310) | Seelos Therapeutics Inc | Barclays Bank | 113 |
| (68) | Seaboard Corp | Goldman Sachs | (22.372) | 3.093 | Seer Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.585 |
| (44) | Seaboard Corp | HSBC | (16.766) | 6.464 | Seer Inc | Goldman Sachs | (65) |
| (435) | Seaboard Corp | Morgan Stanley | (199.300) | (8.327) | SEI Investments Co | Bank of America Merrill Lynch | (24.489) |
| 10 | Seaboard Corp | Morgan Stanley | 4.582 | (23.111) | SEI Investments Co | Barclays Bank | (57.315) |
| (107.981) | SeaChange International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.559 | (42.383) | SEI Investments Co | Goldman Sachs | (139.864) |
| (22.375) | Seacoast Banking Corp of Florida | Goldman Sachs | (41.170) | (9.572) | SEI Investments Co | HSBC | (29.290) |
| (7.893) | Seacoast Banking Corp of Florida | Morgan Stanley | (4.104) | (8.598) | SEI Investments Co | Morgan Stanley | (21.323) |
| (2.510) | Seagate Technology Holdings Plc | Bank of America Merrill Lynch | 2.034 | (33.538) | Select Energy Services Inc 'A' | Morgan Stanley | (28.843) |
| (7.403) | Seagate Technology Holdings Plc | Barclays Bank | (2.739) | 28.307 | Select Medical Holdings Corp | Barclays Bank | 13.587 |
| (3.931) | Seagate Technology Holdings Plc | Goldman Sachs | 8.326 | (39.438) | Select Medical Holdings Corp | Barclays Bank | (18.930) |
| (2.665) | Seagate Technology Holdings Plc | HSBC | (5.170) | 5.630 | Select Medical Holdings Corp | Goldman Sachs | 1.239 |
| | | | | (10.001) | Select Medical Holdings Corp | Goldman Sachs | (2.200) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (11.573) | Select Medical Holdings Corp | HSBC | (27.775) | 7.214 | Seres Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.218 |
| (3.177) | Select Medical Holdings Corp | Morgan Stanley | (1.525) | 7.627 | Seres Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.068) |
| 41.966 | Selecta Biosciences Inc | Barclays Bank | 3.592 | (4.906) | Seritage Growth Properties 'A' (REIT) | Bank of America | (442) |
| 21.461 | Selecta Biosciences Inc | Goldman Sachs | 1.389 | (41.725) | Seritage Growth Properties 'A' (REIT) | Barclays Bank | (12.504) |
| 11.514 | Selecta Biosciences Inc | Morgan Stanley | 986 | (14.207) | Seritage Growth Properties 'A' (REIT) | Morgan Stanley | (4.120) |
| 2.032 | Selective Insurance Group Inc | Bank of America | | (2.234) | Service Corp International | Barclays Bank | 156 |
| 24.241 | Selective Insurance Group Inc | Merrill Lynch | 2.307 | 9.967 | Service Corp International | Goldman Sachs | 11.562 |
| 15.984 | Selective Insurance Group Inc | Barclays Bank | 25.695 | (2.275) | Service Corp International | Goldman Sachs | (2.948) |
| 3.478 | Selective Insurance Group Inc | HSBC | (22.368) | 5.255 | Service Corp International | HSBC | (1.051) |
| (12.979) | Selectquote Inc | Morgan Stanley | 3.675 | (978) | Service Corp International | HSBC | 196 |
| (10.041) | Selectquote Inc | Bank of America | | 756 | ServiceNow Inc | Bank of America | |
| (16.610) | Selectquote Inc | Merrill Lynch | (1.557) | 5.500 | ServiceNow Inc | Merrill Lynch | 28.380 |
| 15.985 | Sema4 Holdings Corp | Barclays Bank | 2.238 | 3.504 | ServiceNow Inc | Barclays Bank | 221.925 |
| 9.758 | Sema4 Holdings Corp | Goldman Sachs | 1.049 | 813 | ServiceNow Inc | HSBC | 156.278 |
| 7.495 | Sema4 Holdings Corp | HSBC | 6.276 | 2.690 | ServisFirst Bancshares Inc | Morgan Stanley | 32.805 |
| 26.149 | Sema4 Holdings Corp | Morgan Stanley | 7.195 | 9.473 | ServisFirst Bancshares Inc | Bank of America | 6.000 |
| 23.984 | Sema4 Holdings Corp | Bank of America | | 5.709 | ServisFirst Bancshares Inc | Merrill Lynch | 24.217 |
| (1.441) | Semler Scientific Inc | Merrill Lynch | 2.003 | 6.348 | ServisFirst Bancshares Inc | Barclays Bank | 13.646 |
| (217) | Semler Scientific Inc | Barclays Bank | 141 | 956 | ServisFirst Bancshares Inc | HSBC | 15.155 |
| (491) | Semler Scientific Inc | Goldman Sachs | 682 | (149.481) | Sesen Bio Inc | Morgan Stanley | 2.428 |
| (3.581) | Sempra Energy | Bank of America | | 37.354 | SFL Corp Ltd | Barclays Bank | (3.827) |
| (13.831) | Sempra Energy | Merrill Lynch | (10.238) | 50.511 | SFL Corp Ltd | Goldman Sachs | 11.206 |
| (18.499) | Sempra Energy | Barclays Bank | (13.930) | 505 | Shake Shack Inc 'A' | Bank of America | (1.515) |
| (9.734) | Sempra Energy | Goldman Sachs | (55.455) | 21.278 | Shake Shack Inc 'A' | Merrill Lynch | 1.899 |
| (289) | Sempra Energy | HSBC | (21.318) | 7.720 | Shake Shack Inc 'A' | Barclays Bank | 106.177 |
| 18.747 | Semtech Corp | Morgan Stanley | (301) | 4.617 | Shake Shack Inc 'A' | Goldman Sachs | 29.027 |
| 42.472 | Semtech Corp | Bank of America | | 2.722 | Shake Shack Inc 'A' | HSBC | 10.076 |
| 24.402 | Semtech Corp | Merrill Lynch | 73.863 | 2.767 | Sharps Compliance Corp | Morgan Stanley | 13.583 |
| 46.182 | Semtech Corp | Barclays Bank | 126.999 | 22.844 | Sharps Compliance Corp | Bank of America | |
| 5.720 | Semtech Corp | Goldman Sachs | 96.144 | 16.121 | Sharps Compliance Corp | Merrill Lynch | 470 |
| 3.911 | Seneca Foods Corp 'A' | HSBC | 249.485 | 17.379 | Sharps Compliance Corp | Barclays Bank | 7.995 |
| 2.570 | Seneca Foods Corp 'A' | Morgan Stanley | 17.046 | 16.471 | Shattuck Labs Inc | Goldman Sachs | 2.741 |
| 1.062 | Seneca Foods Corp 'A' | Barclays Bank | 2.229 | 7.554 | Shattuck Labs Inc | Morgan Stanley | 6.083 |
| 2.802 | Seneca Foods Corp 'A' | Goldman Sachs | 694 | 13.167 | Shattuck Labs Inc | Barclays Bank | (4.447) |
| (1.054) | Sensata Technologies Holding Plc | HSBC | 5.140 | (15.093) | Shattuck Labs Inc | Goldman Sachs | (3.777) |
| 16.107 | Sensata Technologies Holding Plc | Morgan Stanley | 1.597 | (12.738) | Shenandoah Telecommunications Co | HSBC | (8.822) |
| (34.806) | Sensata Technologies Holding Plc | Barclays Bank | (736) | (6.752) | Shenandoah Telecommunications Co | Morgan Stanley | (602) |
| 6.136 | Sensata Technologies Holding Plc | Goldman Sachs | (92.142) | (303) | Sherwin-Williams Co | Bank of America | (12.289) |
| (18.938) | Sensata Technologies Holding Plc | HSBC | (43.095) | (4.485) | Sherwin-Williams Co | Merrill Lynch | 1.439 |
| (2.720) | Sensata Technologies Holding Plc | Morgan Stanley | (5.132) | (4.653) | Sherwin-Williams Co | Barclays Bank | (32.965) |
| 3.898 | Sensient Technologies Corp | Bank of America | | (7.484) | Sherwin-Williams Co | Goldman Sachs | 22.102 |
| 5.635 | Sensient Technologies Corp | Merrill Lynch | 12.240 | (595) | Sherwin-Williams Co | HSBC | 61.186 |
| 12.990 | Sensient Technologies Corp | Barclays Bank | 13.278 | (156) | Shift4 Payments Inc 'A' | Morgan Stanley | (4.373) |
| 516 | Sensient Technologies Corp | Goldman Sachs | 40.021 | (9.265) | Shift4 Payments Inc 'A' | Bank of America | |
| (1.193) | SentinelOne Inc 'A' | HSBC | 1.496 | (5.305) | Shift4 Payments Inc 'A' | Merrill Lynch | (345) |
| (10.497) | SentinelOne Inc 'A' | Bank of America | | (6.988) | Shift4 Payments Inc 'A' | Barclays Bank | (11.303) |
| (16.202) | SentinelOne Inc 'A' | Merrill Lynch | (16.480) | (5.525) | Shift4 Payments Inc 'A' | Goldman Sachs | (11.724) |
| (11.047) | SentinelOne Inc 'A' | Barclays Bank | (16.480) | (2.096) | Shoals Technologies Group Inc 'A' | HSBC | (48.636) |
| 6.264 | Seres Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (51.684) | (25.032) | Shoals Technologies Group Inc 'A' | Morgan Stanley | (6.740) |
| 34.952 | Seres Therapeutics Inc | HSBC | (44.272) | (605) | Shockwave Medical Inc | Bank of America | |
| | | Morgan Stanley | (5.132) | (526) | Shockwave Medical Inc | Merrill Lynch | (3.279) |
| | | Bank of America | | 1.758 | Shockwave Medical Inc | Barclays Bank | (1.794) |
| | | Merrill Lynch | (2.568) | (570) | Shockwave Medical Inc | Goldman Sachs | 5.995 |
| | | Barclays Bank | (1.143) | | | | (4.298) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 229 | Shockwave Medical Inc | HSBC | 679 | 6.829 | Silgan Holdings Inc | Bank of America | |
| 403 | Shockwave Medical Inc | Morgan Stanley | 1.374 | | | Merrill Lynch | (787) |
| (365) | Shockwave Medical Inc | Morgan Stanley | (1.245) | (4.357) | Silgan Holdings Inc | Bank of America | |
| 1.583 | Shoe Carnival Inc | Barclays Bank | 4.037 | | | Merrill Lynch | (5.059) |
| 15.407 | Shoe Carnival Inc | Goldman Sachs | (38.980) | 30.881 | Silgan Holdings Inc | Barclays Bank | 34.587 |
| 1.969 | Shoe Carnival Inc | HSBC | (4.883) | (13.477) | Silgan Holdings Inc | Barclays Bank | (15.094) |
| 7.781 | Shore Bancshares Inc | Barclays Bank | 3.035 | (19.044) | Silgan Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.135 |
| 15.580 | Shore Bancshares Inc | Goldman Sachs | 8.725 | (7.479) | Silgan Holdings Inc | HSBC | 1.331 |
| (2.719) | ShotSpotter Inc | Barclays Bank | (5.601) | 19.325 | Silgan Holdings Inc | Morgan Stanley | 21.644 |
| (868) | ShotSpotter Inc | Goldman Sachs | (1.680) | (2.828) | Silgan Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.857) |
| (9.482) | ShotSpotter Inc | HSBC | (59.263) | 665 | Silicon Laboratories Inc | Bank of America | |
| (1.948) | ShotSpotter Inc | Morgan Stanley | (4.013) | | | Merrill Lynch | 6.670 |
| 2.725 | Shutterstock Inc | Bank of America | | 28.983 | Silicon Laboratories Inc | Barclays Bank | 304.321 |
| | | Merrill Lynch | (8.529) | 18.776 | Silicon Laboratories Inc | Goldman Sachs | 188.323 |
| 4.835 | Shutterstock Inc | Barclays Bank | 5.989 | 3.417 | Silicon Laboratories Inc | HSBC | 48.214 |
| 6.674 | Shutterstock Inc | Goldman Sachs | (14.477) | (3.758) | Silk Road Medical Inc | Barclays Bank | (12.364) |
| 1.070 | Shutterstock Inc | HSBC | (4.090) | (9.140) | Silk Road Medical Inc | Goldman Sachs | (27.786) |
| 1.538 | Shutterstock Inc | Morgan Stanley | 892 | (4.107) | Silk Road Medical Inc | HSBC | (15.252) |
| (14.578) | Shyft Group Inc | Morgan Stanley | (4.665) | (356) | Silk Road Medical Inc | Morgan Stanley | (1.171) |
| 1.969 | SI-BONE Inc | Barclays Bank | 788 | 21.174 | Silverback Therapeutics Inc | Barclays Bank | 4.447 |
| 10.728 | SI-BONE Inc | Goldman Sachs | 18.345 | 17.888 | Silverback Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 6.976 |
| 5.320 | SI-BONE Inc | HSBC | (4.309) | 7.135 | Silverback Therapeutics Inc | HSBC | 3.425 |
| 5.461 | SI-BONE Inc | Morgan Stanley | 2.184 | (11.112) | SilverBow Resources Inc | Barclays Bank | (60.783) |
| (73.799) | Siebert Financial Corp | Barclays Bank | 18.450 | (719) | SilverBow Resources Inc | Goldman Sachs | (5.126) |
| (760) | Siebert Financial Corp | Goldman Sachs | — | (4.352) | SilverBow Resources Inc | HSBC | (36.731) |
| (1.050) | Siebert Financial Corp | HSBC | 168 | 9.429 | SilverCrest Asset Management Group Inc 'A' | Bank of America | |
| (659) | Siebert Financial Corp | Morgan Stanley | 165 | | | Merrill Lynch | 5.657 |
| 777 | Sienna | | | 11.782 | SilverCrest Asset Management Group Inc 'A' | Barclays Bank | 4.595 |
| | Biopharmaceuticals Inc ^{††} | Goldman Sachs | — | 11.133 | SilverCrest Asset Management Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 6.680 |
| 10.644 | Sientra Inc | Bank of America | | 9.561 | SilverCrest Asset Management Group Inc 'A' | HSBC | (1.530) |
| | | Merrill Lynch | (1.907) | 21.829 | SilverCrest Asset Management Group Inc 'A' | Morgan Stanley | 8.513 |
| 33.786 | Sientra Inc | Barclays Bank | (8.757) | (1.145) | Silvergate Capital Corp 'A' | Bank of America | |
| 7.226 | Sientra Inc | Goldman Sachs | (1.295) | | | Merrill Lynch | (13.763) |
| 9.134 | Sierra Bancorp | Bank of America | | (5.959) | Silvergate Capital Corp 'A' | Barclays Bank | (53.810) |
| | | Merrill Lynch | 3.014 | (1.544) | Silvergate Capital Corp 'A' | Goldman Sachs | (18.559) |
| 20.395 | Sierra Bancorp | Goldman Sachs | 6.730 | (3.741) | Silvergate Capital Corp 'A' | Morgan Stanley | (33.781) |
| 67.340 | Sierra Bancorp | Morgan Stanley | 30.303 | 4.955 | Simmons First National Corp 'A' | Barclays Bank | 2.527 |
| (10.718) | SIGA Technologies Inc | Goldman Sachs | (44.587) | 8.584 | Simmons First National Corp 'A' | Goldman Sachs | 12.447 |
| (62.709) | SIGA Technologies Inc | Morgan Stanley | (43.269) | 6.831 | Simmons First National Corp 'A' | HSBC | 6.011 |
| (5.366) | Sight Sciences Inc | Goldman Sachs | (2.898) | 7.606 | Simon Property Group Inc (REIT) | Bank of America | |
| (1.540) | Sight Sciences Inc | HSBC | (3.188) | 17.899 | Simon Property Group Inc (REIT) | Merrill Lynch | (23.198) |
| 9.226 | Sigilon Therapeutics Inc | Bank of America | | 6.504 | Simon Property Group Inc (REIT) | Barclays Bank | 108.289 |
| | | Merrill Lynch | 535 | 3.832 | Simon Property Group Inc (REIT) | Goldman Sachs | (19.837) |
| 2.606 | Sigilon Therapeutics Inc | Barclays Bank | 41 | 199 | Simon Property Group Inc (REIT) | HSBC | 2.941 |
| 14.076 | Sigilon Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 816 | | | Morgan Stanley | 1.204 |
| 6.922 | Sigilon Therapeutics Inc | HSBC | (1.007) | (6.274) | Simply Good Foods Co | Barclays Bank | (11.092) |
| 11.066 | Sigilon Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 174 | (9.247) | Simply Good Foods Co | Goldman Sachs | (17.152) |
| (7.463) | Signature Bank | Barclays Bank | (89.631) | (4.257) | Simply Good Foods Co | Morgan Stanley | (8.622) |
| 385 | Signature Bank | Barclays Bank | 7.522 | (6.516) | Simpson Manufacturing Co Inc | Bank of America | |
| (1.707) | Signature Bank | Goldman Sachs | (38.954) | | | Merrill Lynch | (28.279) |
| (1.027) | Signature Bank | HSBC | 10.558 | (14.416) | Simpson Manufacturing Co Inc | Barclays Bank | (44.977) |
| 1.172 | Signature Bank | Morgan Stanley | 14.076 | (11.149) | Simpson Manufacturing Co Inc | HSBC | (11.275) |
| (886) | Signet Jewelers Ltd | Bank of America | | (4.375) | Simpson Manufacturing Co Inc | Morgan Stanley | (13.650) |
| | | Merrill Lynch | 1.834 | (13.880) | Simulations Plus Inc | Barclays Bank | (46.359) |
| 731 | Signet Jewelers Ltd | Bank of America | | (1.132) | Simulations Plus Inc | Goldman Sachs | (3.588) |
| | | Merrill Lynch | (1.513) | (602) | Simulations Plus Inc | HSBC | (4.124) |
| (6.882) | Signet Jewelers Ltd | Barclays Bank | (20.370) | | | | |
| 4.590 | Signet Jewelers Ltd | Barclays Bank | 13.586 | | | | |
| (10.475) | Signet Jewelers Ltd | Goldman Sachs | 21.683 | | | | |
| 1.186 | Signet Jewelers Ltd | Goldman Sachs | (2.455) | | | | |
| (1.446) | Signet Jewelers Ltd | HSBC | 15.024 | | | | |
| 3.002 | Signet Jewelers Ltd | HSBC | (31.191) | | | | |
| 1.658 | Signet Jewelers Ltd | Morgan Stanley | 4.453 | | | | |
| (5.583) | Signify Health Inc 'A' | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (5.583) | | | | |
| (27.306) | Signify Health Inc 'A' | Barclays Bank | (16.384) | | | | |
| 3.510 | Signify Health Inc 'A' | Barclays Bank | 2.106 | | | | |
| (5.225) | Signify Health Inc 'A' | Goldman Sachs | (5.225) | | | | |
| (10.827) | Signify Health Inc 'A' | Morgan Stanley | (6.496) | | | | |
| 3.337 | Signify Health Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.002 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|-----------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 3.846 | Sinclair Broadcast Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (6.173) | (24.877) | Skillsoft Corp | Goldman Sachs | (22.389) |
| 19.798 | Sinclair Broadcast Group Inc 'A' | Barclays Bank | (22.570) | 93.903 | Skillz Inc | Bank of America Merrill Lynch | 17.269 |
| 9.391 | Sinclair Broadcast Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (6.855) | 78.082 | Skillz Inc | Barclays Bank | 10.541 |
| 3.966 | Sinclair Broadcast Group Inc 'A' | HSBC | 3.799 | 17.455 | Skillz Inc | Goldman Sachs | 2.706 |
| 7.846 | Sinclair Broadcast Group Inc 'A' | Morgan Stanley | (7.847) | 57.338 | Skillz Inc | HSBC | 11.124 |
| 10.668 | Singular Genomics Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | 424 | 17.608 | Skillz Inc | Morgan Stanley | 2.377 |
| 12.284 | Singular Genomics Systems Inc | Barclays Bank | 983 | 4.964 | Sky Harbour Group Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.822 |
| 20.273 | Singular Genomics Systems Inc | Goldman Sachs | 3.041 | 2.111 | Sky Harbour Group Corp | Barclays Bank | 464 |
| 2.717 | Singular Genomics Systems Inc | HSBC | (245) | 2.541 | Sky Harbour Group Corp | Goldman Sachs | 1.957 |
| 6.848 | Singular Genomics Systems Inc | Morgan Stanley | 548 | 2.326 | Sky Harbour Group Corp | Morgan Stanley | 512 |
| 61.086 | Sirius XM Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12.872 | (3.281) | Skyline Champion Corp | Barclays Bank | 197 |
| 99.417 | Sirius XM Holdings Inc | Goldman Sachs | 22.866 | (5.405) | Skyline Champion Corp | Goldman Sachs | 4.054 |
| 11.350 | Sirius XM Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.476 | (2.136) | Skyline Champion Corp | HSBC | (1.495) |
| (210.820) | SiriusPoint Ltd | Barclays Bank | 48.489 | (3.909) | Skyline Champion Corp | Morgan Stanley | 235 |
| (53.105) | SiriusPoint Ltd | Morgan Stanley | 12.214 | (4.377) | SkyWater Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.327) |
| 23.890 | SITE Centers Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 22.218 | (8.852) | SkyWater Technology Inc | Barclays Bank | (12.216) |
| 52.684 | SITE Centers Corp (REIT) | Barclays Bank | 77.445 | (8.810) | SkyWater Technology Inc | Goldman Sachs | (6.696) |
| 51.363 | SITE Centers Corp (REIT) | Goldman Sachs | 47.768 | (576) | SkyWater Technology Inc | Morgan Stanley | (795) |
| 29.027 | SITE Centers Corp (REIT) | HSBC | 32.801 | (10.632) | SkyWest Inc | Barclays Bank | (12.007) |
| 6.404 | SITE Centers Corp (REIT) | Morgan Stanley | 9.414 | (5.989) | SkyWest Inc | HSBC | (3.593) |
| 21.629 | SiteOne Landscape Supply Inc | Barclays Bank | 161.785 | (11.738) | SkyWest Inc | Morgan Stanley | (12.081) |
| 6.263 | SiteOne Landscape Supply Inc | Goldman Sachs | 17.599 | 2.583 | Skyworks Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.149 |
| 14.850 | SiteOne Landscape Supply Inc | HSBC | 120.434 | (12.839) | Skyworks Solutions Inc | Barclays Bank | (66.891) |
| 1.136 | SiteOne Landscape Supply Inc | Morgan Stanley | 8.497 | (5.381) | Skyworks Solutions Inc | HSBC | (28.573) |
| (6.412) | SiTime Corp | Goldman Sachs | (135.549) | 3.792 | Skyworks Solutions Inc | HSBC | 20.260 |
| (4.785) | SiTime Corp | HSBC | (200.848) | (6.474) | Skyworks Solutions Inc | Morgan Stanley | (33.730) |
| (307) | SiTime Corp | Morgan Stanley | (2.367) | 1.128 | Skyworks Solutions Inc | Morgan Stanley | 5.877 |
| (14.402) | SITO Mobile Ltd | Bank of America Merrill Lynch | — | (10.467) | SL Green Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | (11.514) |
| (66.470) | SITO Mobile Ltd | Goldman Sachs | — | 4.526 | SL Green Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | 4.979 |
| (7.365) | Six Flags Entertainment Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.336) | (25.075) | SL Green Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | 37.362 |
| 5.602 | Six Flags Entertainment Corp | Bank of America Merrill Lynch | 5.602 | 4.072 | SL Green Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | (3.533) |
| 3.412 | Six Flags Entertainment Corp | Goldman Sachs | 3.372 | (6.776) | SL Green Realty Corp (REIT) | HSBC | 25.274 |
| (11.429) | Six Flags Entertainment Corp | HSBC | 14.558 | 6.626 | SL Green Realty Corp (REIT) | HSBC | (18.086) |
| 1.556 | Six Flags Entertainment Corp | HSBC | 1.563 | 2.236 | SL Green Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | 2.460 |
| 4.571 | Six Flags Entertainment Corp | Morgan Stanley | 4.980 | (4.858) | Sleep Number Corp | Barclays Bank | (17.537) |
| 1.362 | SJW Group | Bank of America Merrill Lynch | (27) | (5.223) | Sleep Number Corp | Goldman Sachs | (30.032) |
| 10.445 | SJW Group | Barclays Bank | (2.716) | (2.446) | Sleep Number Corp | HSBC | (14.700) |
| 17.938 | SJW Group | Goldman Sachs | (150) | (1.795) | Sleep Number Corp | Morgan Stanley | (6.480) |
| 10.318 | SJW Group | HSBC | 16.332 | (43.538) | SLM Corp | Bank of America Merrill Lynch | (104.861) |
| 14.467 | SJW Group | Morgan Stanley | (3.761) | (11.120) | SLM Corp | Barclays Bank | (16.012) |
| (11.043) | Skechers USA Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (14.951) | (56.990) | SLM Corp | Goldman Sachs | (130.331) |
| 19.774 | Skechers USA Inc 'A' | Barclays Bank | 45.678 | (28.350) | SLM Corp | HSBC | (84.483) |
| (4.921) | Skechers USA Inc 'A' | Barclays Bank | (15.370) | (27.934) | SLM Corp | Morgan Stanley | (40.225) |
| (3.216) | Skechers USA Inc 'A' | Goldman Sachs | (5.853) | 1.156 | SM Energy Co | Bank of America Merrill Lynch | 17.223 |
| (7.222) | Skechers USA Inc 'A' | HSBC | (19.304) | 22.998 | SM Energy Co | Barclays Bank | 272.066 |
| | | | | 2.044 | SM Energy Co | Goldman Sachs | 32.459 |
| | | | | (2.201) | SM Energy Co | Goldman Sachs | (34.952) |
| | | | | 2.428 | SM Energy Co | HSBC | 42.374 |
| | | | | 1.876 | SM Energy Co | Morgan Stanley | 22.193 |
| | | | | (3.227) | SM Energy Co | Morgan Stanley | (38.175) |
| | | | | (5.788) | SMART Global Holdings Inc | Barclays Bank | (7.119) |
| | | | | (22.574) | SMART Global Holdings Inc | Goldman Sachs | (42.213) |
| | | | | 35.019 | SmartFinancial Inc | Barclays Bank | 34.669 |
| | | | | 54.127 | SmartFinancial Inc | Goldman Sachs | 76.319 |
| | | | | 11.601 | SmartFinancial Inc | HSBC | 7.077 |
| | | | | 25.568 | SmartFinancial Inc | Morgan Stanley | 25.312 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-----------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (1.359) | Smartsheet Inc 'A' | Bank of America | | 5.066 | Sonos Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.854 | | | Merrill Lynch | 4.063 |
| 1.799 | Smartsheet Inc 'A' | Barclays Bank | 594 | 25.767 | Sonos Inc | Barclays Bank | 19.841 |
| (1.239) | Smartsheet Inc 'A' | Barclays Bank | (409) | 3.342 | Sonos Inc | Goldman Sachs | — |
| 671 | Smartsheet Inc 'A' | Goldman Sachs | 227 | 14.124 | Sonos Inc | HSBC | 13.593 |
| (671) | Smartsheet Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.409 | 10.739 | Sonos Inc | Morgan Stanley | 8.269 |
| 3.860 | Smartsheet Inc 'A' | HSBC | (14.707) | 38.997 | Sorrento Therapeutics Inc | Bank of America | |
| (3.273) | Smartsheet Inc 'A' | HSBC | 10.290 | | | Merrill Lynch | 7.214 |
| 1.264 | Smartsheet Inc 'A' | Morgan Stanley | 417 | 126.639 | Sorrento Therapeutics Inc | Barclays Bank | 5.699 |
| (804) | Smartsheet Inc 'A' | Morgan Stanley | (265) | 14.450 | Sorrento Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 2.673 |
| (125.050) | Smith Micro Software Inc | Barclays Bank | (16.257) | 180.722 | Sorrento Therapeutics Inc | HSBC | 47.891 |
| (40.607) | Smith Micro Software Inc | Goldman Sachs | (6.903) | (21.955) | Sotera Health Co | Bank of America | |
| (41.062) | Smith Micro Software Inc | HSBC | (2.053) | | | Merrill Lynch | (26.127) |
| (870) | Smith-Midland Corp | Goldman Sachs | 339 | (8.982) | Sotera Health Co | Barclays Bank | (3.952) |
| (16.836) | Snap Inc 'A' | Bank of America | | (14.089) | Sotera Health Co | Goldman Sachs | (16.766) |
| | | Merrill Lynch | 152.197 | (12.566) | Sotera Health Co | Morgan Stanley | (5.529) |
| (5.443) | Snap Inc 'A' | Barclays Bank | 44.034 | 9.183 | South Jersey Industries Inc | Bank of America | |
| (4.919) | Snap Inc 'A' | Goldman Sachs | 44.468 | | | Merrill Lynch | 6.192 |
| (4.803) | Snap Inc 'A' | Morgan Stanley | 38.856 | (21.595) | South Jersey Industries Inc | Barclays Bank | (1.080) |
| (20.844) | Snap One Holdings Corp | Goldman Sachs | (14.174) | 3.551 | South Jersey Industries Inc | Barclays Bank | 178 |
| (1.044) | Snap One Holdings Corp | HSBC | (418) | (55.006) | South Jersey Industries Inc | Goldman Sachs | (61.057) |
| 1.758 | Snap-on Inc | Bank of America | | 4.393 | South Jersey Industries Inc | HSBC | 4.022 |
| | | Merrill Lynch | 13.843 | (61.835) | South Jersey Industries Inc | HSBC | (55.328) |
| 16.878 | Snap-on Inc | Barclays Bank | 137.342 | 53.277 | South Plains Financial Inc | Barclays Bank | 46.884 |
| 7.372 | Snap-on Inc | Goldman Sachs | 28.127 | 4.077 | South Plains Financial Inc | Goldman Sachs | 3.262 |
| 2.562 | Snap-on Inc | HSBC | 4.368 | 4.138 | South Plains Financial Inc | HSBC | 1.697 |
| 1.032 | Snap-on Inc | Morgan Stanley | 8.514 | 21.612 | South Plains Financial Inc | Morgan Stanley | 19.019 |
| (39) | Snowflake Inc 'A' | Bank of America | | 24.789 | South State Corp | Barclays Bank | 95.704 |
| | | Merrill Lynch | 840 | (3.475) | South State Corp | Barclays Bank | (13.622) |
| (8.238) | Snowflake Inc 'A' | Barclays Bank | 90.288 | 15.133 | South State Corp | Goldman Sachs | 82.056 |
| (2.800) | Snowflake Inc 'A' | Goldman Sachs | 45.071 | (4.156) | South State Corp | Goldman Sachs | (22.983) |
| (579) | Snowflake Inc 'A' | HSBC | 8.917 | 15.129 | South State Corp | HSBC | 34.855 |
| (1.305) | Snowflake Inc 'A' | Morgan Stanley | 8.920 | (2.451) | South State Corp | HSBC | (12.326) |
| (7.956) | SoFi Technologies Inc | Bank of America | | 2.489 | South State Corp | Morgan Stanley | 10.689 |
| | | Merrill Lynch | (5.012) | (61.501) | Southern Co | Barclays Bank | (84.257) |
| (30.925) | SoFi Technologies Inc | Barclays Bank | (8.350) | (51.459) | Southern Co | Goldman Sachs | (66.059) |
| (16.640) | SoFi Technologies Inc | Goldman Sachs | (10.483) | (9.800) | Southern Co | Morgan Stanley | (13.426) |
| (2.632) | SolarEdge Technologies Inc | Barclays Bank | (58.878) | 1.387 | Southern Copper Corp | Bank of America | |
| 388 | SolarEdge Technologies Inc | Goldman Sachs | 14.149 | | | Merrill Lynch | 3.445 |
| 709 | SolarEdge Technologies Inc | Morgan Stanley | 15.860 | 3.474 | Southern Copper Corp | Barclays Bank | 10.596 |
| (12.146) | Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A' | Morgan Stanley | (14.211) | (30.405) | Southern Copper Corp | Goldman Sachs | (291.280) |
| 21.007 | SolarWinds Corp | Bank of America | | 13.339 | Southern Copper Corp | HSBC | 74.943 |
| | | Merrill Lynch | 13.234 | 12.973 | Southern First | | |
| 12.706 | SolarWinds Corp | Barclays Bank | 5.254 | | Bancshares Inc | Barclays Bank | 27.632 |
| 16.839 | SolarWinds Corp | Goldman Sachs | 9.790 | 11.337 | Southern First | | |
| 2.347 | SolarWinds Corp | HSBC | 2.324 | | Bancshares Inc | Goldman Sachs | 29.249 |
| 7.795 | SolarWinds Corp | Morgan Stanley | 3.352 | 467 | Southern First | | |
| (31.398) | Soleno Therapeutics Inc | Bank of America | | | Bancshares Inc | HSBC | (89) |
| | | Merrill Lynch | 414 | 3.410 | Southern First | | |
| (113.435) | Soleno Therapeutics Inc | Barclays Bank | 4.106 | | Bancshares Inc | Morgan Stanley | 7.263 |
| 7.659 | Solid Biosciences Inc | Bank of America | | 160 | Southern Missouri Bancorp Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 370 | 10.488 | Southern Missouri Bancorp Inc | Merrill Lynch | 267 |
| 67.855 | Solid Biosciences Inc | Barclays Bank | 4.404 | | Southern Missouri Bancorp Inc | Barclays Bank | 7.027 |
| 92.554 | Solid Biosciences Inc | Goldman Sachs | 4.470 | 6.142 | Southern Missouri Bancorp Inc | | |
| 53.725 | Solid Biosciences Inc | HSBC | 3.992 | | Southern Missouri Bancorp Inc | Goldman Sachs | 10.257 |
| 57.188 | Solid Biosciences Inc | Morgan Stanley | 3.712 | 5.902 | Southern Missouri Bancorp Inc | | |
| 755 | Sonic Automotive Inc 'A' | Bank of America | | | Southern Missouri Bancorp Inc | HSBC | 12.512 |
| | | Merrill Lynch | 15 | 12.152 | Southern Missouri Bancorp Inc | | |
| 18.057 | Sonic Automotive Inc 'A' | Barclays Bank | 57.060 | | Southern Missouri Bancorp Inc | Morgan Stanley | 8.142 |
| 1.360 | Sonic Automotive Inc 'A' | Morgan Stanley | 4.298 | (9.643) | Southside Bancshares Inc | Barclays Bank | (11.379) |
| (7.903) | Sonida Senior Living Inc | Bank of America | | (32.647) | Southside Bancshares Inc | Goldman Sachs | (62.356) |
| | | Merrill Lynch | 11.143 | (682) | Southside Bancshares Inc | HSBC | (681) |
| 19.022 | Sonoco Products Co | Bank of America | | (32.529) | Southside Bancshares Inc | Morgan Stanley | (38.384) |
| | | Merrill Lynch | 9.321 | (3.409) | Southwest Airlines Co | Bank of America | |
| 18.761 | Sonoco Products Co | Barclays Bank | 25.890 | | | Merrill Lynch | (3.942) |
| 19.606 | Sonoco Products Co | Goldman Sachs | 5.424 | (2.947) | Southwest Airlines Co | Barclays Bank | (10.554) |
| 41.632 | Sonoco Products Co | HSBC | (21.365) | (69.149) | Southwest Airlines Co | Goldman Sachs | (146.573) |
| 4.424 | Sonoco Products Co | Morgan Stanley | 6.105 | (32.235) | Southwest Airlines Co | HSBC | (39.772) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|-------------------------------|---|---|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (11.468) | Southwest Airlines Co | Morgan Stanley | (22.363) | (34.221) | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | Morgan Stanley | (60.229) |
| (2.926) | Southwest Gas Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.985) | 1.793 | Splunk Inc | Bank of America Merrill Lynch | 19.084 |
| 2.160 | Southwest Gas Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (403) | 745 | Splunk Inc | Barclays Bank | 4.992 |
| (3.455) | Southwest Gas Holdings Inc | Barclays Bank | 69 | 10.951 | Splunk Inc | HSBC | 115.531 |
| (7.348) | Southwest Gas Holdings Inc | Goldman Sachs | (7.238) | 2.060 | Splunk Inc | Morgan Stanley | 16.566 |
| (2.075) | Southwest Gas Holdings Inc | HSBC | (4.311) | 23.144 | Spok Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (694) |
| (4.418) | Southwest Gas Holdings Inc | Morgan Stanley | 88 | 35.217 | Spok Holdings Inc | Barclays Bank | (14.791) |
| (9.705) | Southwestern Energy Co | Bank of America Merrill Lynch | (24.651) | 22.526 | Spok Holdings Inc | Goldman Sachs | (676) |
| (75.774) | Southwestern Energy Co | Barclays Bank | (121.238) | 3.541 | Spok Holdings Inc | HSBC | (865) |
| (117.861) | Southwestern Energy Co | Goldman Sachs | (299.367) | 9.756 | Sportsman's Warehouse Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 878 |
| (34.402) | Southwestern Energy Co | HSBC | (94.262) | 11.878 | Sportsman's Warehouse Holdings Inc | Barclays Bank | 1.069 |
| 23.358 | Sovos Brands Inc | Barclays Bank | 1.985 | 17.495 | Sportsman's Warehouse Holdings Inc | HSBC | 875 |
| 3.536 | Sovos Brands Inc | Goldman Sachs | (1.503) | 5.502 | Sportsman's Warehouse Holdings Inc | Morgan Stanley | 495 |
| 13.142 | Sovos Brands Inc | HSBC | (2.037) | 430 | Spotify Technology SA | Bank of America Merrill Lynch | 4.730 |
| 2.995 | SP Plus Corp | Barclays Bank | 1.145 | 5.976 | Spotify Technology SA | Barclays Bank | 17.808 |
| 1.789 | SP Plus Corp | Goldman Sachs | 1.766 | 4.136 | Spotify Technology SA | Goldman Sachs | 45.496 |
| 4.726 | SP Plus Corp | Morgan Stanley | 2.316 | (4.301) | SpringWorks Therapeutics Inc | Barclays Bank | 80.902 |
| 963 | SpartanNash Co | Bank of America Merrill Lynch | 39 | (7.102) | SpringWorks Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 129.683 |
| 11.694 | SpartanNash Co | Barclays Bank | 25.376 | (667) | SpringWorks Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 12.546 |
| 3.356 | SpartanNash Co | Goldman Sachs | (340) | (1.806) | Sprout Social Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (11.134) |
| 3.826 | SpartanNash Co | HSBC | 6.466 | (7.096) | Sprout Social Inc 'A' | Barclays Bank | (38.601) |
| 2.807 | SpartanNash Co | Morgan Stanley | 6.091 | (4.450) | Sprout Social Inc 'A' | Goldman Sachs | (42.587) |
| (1.314) | Spectrum Brands Holdings Inc | Barclays Bank | (4.625) | (18.945) | Sprout Social Inc 'A' | HSBC | (138.044) |
| (12.945) | Spectrum Brands Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.918) | (7.040) | Sprout Social Inc 'A' | Morgan Stanley | (61.676) |
| (19.638) | Spectrum Brands Holdings Inc | HSBC | (31.009) | (13.839) | Sprouts Farmers Market Inc | Bank of America Merrill Lynch | (26.156) |
| (781) | Spectrum Brands Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.749) | (491) | Sprouts Farmers Market Inc | HSBC | (746) |
| (11.106) | Spero Therapeutics Inc | Barclays Bank | 1.333 | 2.753 | Spruce Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | 385 |
| (8.996) | Spero Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.080 | 11.281 | Spruce Biosciences Inc | Barclays Bank | 1.805 |
| 10 | Spire Global Inc | Barclays Bank | 1 | 5.218 | Spruce Biosciences Inc | Goldman Sachs | 731 |
| (20.013) | Spire Inc | Bank of America Merrill Lynch | (48.431) | 2.344 | Spruce Biosciences Inc | Morgan Stanley | 375 |
| (9.438) | Spire Inc | Barclays Bank | (21.707) | 1.327 | SPS Commerce Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.238 |
| (13.117) | Spire Inc | Goldman Sachs | (31.743) | 935 | SPS Commerce Inc | Barclays Bank | 4.909 |
| (46.448) | Spire Inc | HSBC | (104.972) | 6.227 | SPS Commerce Inc | Goldman Sachs | 15.194 |
| (9.965) | Spire Inc | Morgan Stanley | (22.920) | 435 | SPS Commerce Inc | HSBC | (3.297) |
| 2.027 | Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 6.062 | 652 | SPS Commerce Inc | Morgan Stanley | 3.423 |
| (10.557) | Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (15.836) | 27.969 | SPX Corp | Barclays Bank | 58.455 |
| 7.373 | Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | 11.059 | 6.062 | SPX Corp | Goldman Sachs | 23.278 |
| (10.625) | Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (15.831) | 8.044 | SPX Corp | HSBC | 39.496 |
| (1.659) | Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A' | HSBC | (3.996) | 1.794 | SQZ Biotechnologies Co | Barclays Bank | 520 |
| (3.097) | Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | (4.646) | 14.396 | SQZ Biotechnologies Co | Goldman Sachs | 9.213 |
| 6.460 | Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 9.690 | (1.319) | SS&C Technologies Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.988) |
| (2.548) | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (4.031) | (20.147) | SS&C Technologies Holdings Inc | Barclays Bank | (40.899) |
| (66.823) | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | Barclays Bank | (117.608) | (21.343) | SS&C Technologies Holdings Inc | Goldman Sachs | (96.897) |
| 15.804 | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | Barclays Bank | 27.815 | (28.285) | SS&C Technologies Holdings Inc | HSBC | (112.825) |
| (14.192) | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | 5.436 | (16.810) | SS&C Technologies Holdings Inc | Morgan Stanley | (34.124) |
| 6.492 | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | (2.792) | 16.872 | SSR Mining Inc | Barclays Bank | (8.423) |
| (7.898) | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | HSBC | (12.154) | 68.042 | SSR Mining Inc | Goldman Sachs | 3.798 |
| 9.177 | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | HSBC | 18.813 | 7.624 | SSR Mining Inc | HSBC | (4.417) |
| | | | | (733) | St Joe Co | Bank of America Merrill Lynch | (1.312) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-------------------------------|---|---|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (6.763) | St Joe Co | Barclays Bank | (16.096) | (68.853) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (28.230) |
| (19.327) | St Joe Co | Goldman Sachs | (34.595) | (81.040) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | HSBC | (87.523) |
| (5.147) | St Joe Co | HSBC | (7.051) | (7.355) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (5.002) |
| (1.802) | STAAR Surgical Co | Bank of America Merrill Lynch | (19.642) | (420) | State Street Corp | Barclays Bank | (22) |
| 594 | STAAR Surgical Co | Bank of America Merrill Lynch | 6.475 | 6.481 | State Street Corp | Barclays Bank | 14.971 |
| (6.793) | STAAR Surgical Co | Barclays Bank | (33.693) | 13.584 | State Street Corp | Goldman Sachs | 56.207 |
| (1.018) | STAAR Surgical Co | Goldman Sachs | (11.096) | (2.188) | State Street Corp | HSBC | (6.105) |
| (4.899) | STAAR Surgical Co | HSBC | (55.758) | 3.357 | State Street Corp | HSBC | 9.366 |
| (2.079) | STAAR Surgical Co | Morgan Stanley | (10.312) | (261) | State Street Corp | Morgan Stanley | (603) |
| (6.737) | STAG Industrial Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 10.847 | 1.760 | Steel Dynamics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 17.882 |
| (53.748) | STAG Industrial Inc (REIT) | Barclays Bank | (25.262) | (8.345) | Steel Dynamics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (83.553) |
| 22.348 | STAG Industrial Inc (REIT) | Barclays Bank | 10.504 | (11.975) | Steel Dynamics Inc | Barclays Bank | (85.502) |
| (10.513) | STAG Industrial Inc (REIT) | Goldman Sachs | 16.926 | 6.116 | Steel Dynamics Inc | Goldman Sachs | 62.139 |
| 2.355 | STAG Industrial Inc (REIT) | Goldman Sachs | (3.792) | 14.518 | Steel Dynamics Inc | HSBC | 121.177 |
| (67.621) | STAG Industrial Inc (REIT) | HSBC | 87.085 | 14.204 | Steel Dynamics Inc | Morgan Stanley | 101.417 |
| 64.032 | STAG Industrial Inc (REIT) | HSBC | (73.413) | 72.807 | Steelcase Inc 'A' | Barclays Bank | 33.127 |
| (25.494) | STAG Industrial Inc (REIT) | Morgan Stanley | (11.982) | 58.134 | Steelcase Inc 'A' | Goldman Sachs | 30.520 |
| 21.348 | STAG Industrial Inc (REIT) | Morgan Stanley | 7.419 | 21.895 | Steelcase Inc 'A' | HSBC | 16.312 |
| 7.607 | Stagwell Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.336 | 2.484 | Steelcase Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.130 |
| 6.533 | Stagwell Inc | Barclays Bank | (131) | (2.151) | Stem Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.377) |
| 6.029 | Stagwell Inc | HSBC | 8.561 | (48.072) | Stem Inc | Goldman Sachs | (75.473) |
| (16.332) | Standard BioTools Inc | Goldman Sachs | 2.123 | (20.982) | Stem Inc | HSBC | (30.004) |
| 2.846 | Standard Motor Products Inc | Bank of America Merrill Lynch | 989 | 18.373 | Stepan Co | Barclays Bank | 59.345 |
| 4.997 | Standard Motor Products Inc | Barclays Bank | 2.898 | 14.119 | Stepan Co | Goldman Sachs | 62.406 |
| 12.909 | Standard Motor Products Inc | Goldman Sachs | 1.133 | 14.124 | Stepan Co | HSBC | 78.812 |
| 8.229 | Standard Motor Products Inc | HSBC | (11.676) | (5.906) | StepStone Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (18.072) |
| (1.522) | Standex International Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3.390) | (8.833) | StepStone Group Inc 'A' | Barclays Bank | (4.505) |
| (9.185) | Standex International Corp | Barclays Bank | (15.949) | (9.337) | StepStone Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (28.571) |
| (1.892) | Standex International Corp | Goldman Sachs | (1.823) | (5.931) | StepStone Group Inc 'A' | HSBC | (20.401) |
| (3.514) | Standex International Corp | HSBC | (4.489) | (1.980) | StepStone Group Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.010) |
| 2.619 | Stanley Black & Decker Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.619) | (7.056) | Stereotaxis Inc | Goldman Sachs | (2.328) |
| 3.158 | Stanley Black & Decker Inc | Barclays Bank | (884) | (6.942) | Stereotaxis Inc | HSBC | (764) |
| 5.522 | Stanley Black & Decker Inc | Goldman Sachs | (5.522) | (4.796) | Stericycle Inc | Bank of America Merrill Lynch | (237) |
| 9.281 | Stanley Black & Decker Inc | HSBC | (43.356) | (47.663) | Stericycle Inc | Barclays Bank | (17.159) |
| 1.500 | Stanley Black & Decker Inc | Morgan Stanley | (420) | (16.549) | Stericycle Inc | Goldman Sachs | (49.668) |
| (14.118) | Starbucks Corp | Barclays Bank | (51.390) | (2.468) | Stericycle Inc | HSBC | (3.982) |
| (45.662) | Starbucks Corp | Goldman Sachs | (212.742) | (5.472) | Stericycle Inc | Morgan Stanley | (1.253) |
| (16.691) | Starbucks Corp | HSBC | (59.587) | (2.389) | STERIS Plc | Barclays Bank | (4.300) |
| (1.384) | Starbucks Corp | Morgan Stanley | (5.038) | 1.092 | STERIS Plc | Barclays Bank | 1.966 |
| 4.388 | Starry Group Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 4.651 | (2.689) | STERIS Plc | Goldman Sachs | (25.064) |
| 28.403 | Starry Group Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | 28.687 | (5.356) | STERIS Plc | HSBC | (29.636) |
| 10.964 | Starry Group Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 11.622 | 1.564 | STERIS Plc | HSBC | 18.714 |
| 4.669 | Starry Group Holdings Inc 'A' | HSBC | 5.883 | (3.714) | STERIS Plc | Morgan Stanley | (3.370) |
| 4.603 | Starry Group Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 4.649 | (18.459) | Sterling Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.846 |
| 14.771 | StarTek Inc | Bank of America Merrill Lynch | 8.567 | (23.473) | Sterling Bancorp Inc | Barclays Bank | (3.521) |
| 13.568 | StarTek Inc | Barclays Bank | 2.578 | (31.754) | Sterling Bancorp Inc | Goldman Sachs | 3.175 |
| 10.982 | StarTek Inc | Goldman Sachs | 6.370 | (10.178) | Sterling Bancorp Inc | HSBC | 1.018 |
| 2.281 | StarTek Inc | HSBC | (867) | (38.554) | Sterling Bancorp Inc | Morgan Stanley | (5.783) |
| 4.338 | StarTek Inc | Morgan Stanley | 824 | 3.738 | Sterling Check Corp | Barclays Bank | (1.832) |
| (29.534) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (12.109) | 2.470 | Sterling Check Corp | HSBC | (14.079) |
| (117.293) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | (79.760) | (1.163) | Sterling Construction Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (670) |
| | | | | (8.928) | Sterling Construction Co Inc | Barclays Bank | (5.625) |
| | | | | (14.170) | Sterling Construction Co Inc | Goldman Sachs | (20.830) |
| | | | | (11.159) | Sterling Construction Co Inc | HSBC | (22.318) |
| | | | | (1.027) | Sterling Construction Co Inc | Morgan Stanley | (647) |
| | | | | 11.161 | Steven Madden Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 3.567 |
| | | | | 21.787 | Steven Madden Ltd | Barclays Bank | 73.858 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 12.093 | Steven Madden Ltd | Goldman Sachs | (4.084) | (1.976) | Stronghold Digital Mining Inc 'A' | HSBC | (1.186) |
| 13.667 | Steven Madden Ltd | HSBC | (17.381) | | | | |
| 8.925 | Steven Madden Ltd | Morgan Stanley | 30.256 | (1.382) | Stryker Corp | Bank of America | |
| (1.615) | Stewart Information Services Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.285 |
| (686) | Stewart Information Services Corp | Merrill Lynch | 1.393 | 13.646 | Stryker Corp | Barclays Bank | (1.774) |
| (843) | Stewart Information Services Corp | Barclays Bank | 664 | (10.682) | Stryker Corp | Barclays Bank | 1.389 |
| (944) | Stewart Information Services Corp | HSBC | 327 | (1.190) | Stryker Corp | Goldman Sachs | 1.107 |
| 3.494 | Stifel Financial Corp | | | (5.160) | Stryker Corp | HSBC | (20.176) |
| | | | | (381) | Stryker Corp | Morgan Stanley | 50 |
| | | Morgan Stanley | 1.021 | 1.260 | Summit Financial Group Inc | Bank of America | |
| | | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.128 |
| | | Merrill Lynch | 7.442 | 13.050 | Summit Financial Group Inc | Barclays Bank | 3.589 |
| 66.285 | Stifel Financial Corp | Barclays Bank | 116.662 | 10.825 | Summit Financial Group Inc | Goldman Sachs | 9.688 |
| 13.646 | Stifel Financial Corp | Goldman Sachs | 29.066 | 4.439 | Summit Financial Group Inc | HSBC | 2.064 |
| 38.851 | Stifel Financial Corp | HSBC | 151.908 | 6.775 | Summit Financial Group Inc | Morgan Stanley | 1.863 |
| 13.605 | Stifel Financial Corp | Morgan Stanley | 23.945 | (56.873) | Summit Hotel Properties Inc (REIT) | Bank of America | |
| 25.047 | Stitch Fix Inc 'A' | Barclays Bank | 5.214 | | | Merrill Lynch | (4.145) |
| 19.248 | Stitch Fix Inc 'A' | Goldman Sachs | 12.512 | (2.959) | Summit Hotel Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (1.302) |
| 16.085 | Stitch Fix Inc 'A' | HSBC | (2.972) | (111.415) | Summit Hotel Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 6.329 |
| (883) | Stock Yards Bancorp Inc | Bank of America | | (22.269) | Summit Hotel Properties Inc (REIT) | HSBC | 1.404 |
| (11.519) | Stock Yards Bancorp Inc | Merrill Lynch | (5.510) | (44.250) | Summit Hotel Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (19.494) |
| (10.133) | Stock Yards Bancorp Inc | Barclays Bank | (26.724) | 4.204 | Summit Materials Inc 'A' | Bank of America | |
| (8.249) | Stock Yards Bancorp Inc | Goldman Sachs | (63.230) | | | Merrill Lynch | 6.684 |
| (15.124) | Stock Yards Bancorp Inc | HSBC | (29.531) | 24.091 | Summit Materials Inc 'A' | Barclays Bank | 24.152 |
| 2.779 | Stoke Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (35.088) | 12.484 | Summit Materials Inc 'A' | Goldman Sachs | 19.850 |
| | | Bank of America | | 24.507 | Summit Materials Inc 'A' | HSBC | 20.096 |
| | | Merrill Lynch | (10.477) | 11.278 | Summit Materials Inc 'A' | Morgan Stanley | 11.504 |
| 1.926 | Stoke Therapeutics Inc | Barclays Bank | (2.215) | (7.228) | Summit Therapeutics Inc | HSBC | (289) |
| 6.297 | Stoke Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (23.740) | (3.818) | Summit Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (590) |
| 3.531 | Stoke Therapeutics Inc | HSBC | (1.977) | 7.881 | Sumo Logic Inc | Bank of America | |
| 1.392 | Stoke Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.601) | | | Merrill Lynch | 5.359 |
| 38.139 | StoneCo Ltd 'A' | Barclays Bank | 17.544 | 31.339 | Sumo Logic Inc | Barclays Bank | 23.818 |
| 33.106 | StoneCo Ltd 'A' | Goldman Sachs | 56.280 | 19.366 | Sumo Logic Inc | Goldman Sachs | 13.169 |
| 11.075 | StoneCo Ltd 'A' | HSBC | 21.509 | 34.878 | Sumo Logic Inc | HSBC | 27.233 |
| 7.747 | StoneCo Ltd 'A' | Morgan Stanley | 3.564 | 12.335 | Sumo Logic Inc | Morgan Stanley | 9.375 |
| (6.536) | StoneMor Inc | Barclays Bank | (7.255) | 10.200 | Sun Communities Inc (REIT) | Barclays Bank | 58.242 |
| (8.109) | StoneMor Inc | Goldman Sachs | (8.352) | 17.298 | Sun Communities Inc (REIT) | Goldman Sachs | 63.656 |
| (4.274) | StoneMor Inc | Morgan Stanley | (4.744) | 12.437 | Sun Communities Inc (REIT) | HSBC | 75.550 |
| (1.963) | Stoneridge Inc | Barclays Bank | (1.139) | 5.805 | Sun Communities Inc (REIT) | Morgan Stanley | 33.146 |
| (1.252) | StoneX Group Inc | Bank of America | | (7.627) | Sun Country Airlines Holdings Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (4.382) | (4.565) | Sun Country Airlines Holdings Inc | Merrill Lynch | 5.644 |
| (1.298) | StoneX Group Inc | Barclays Bank | (3.076) | (9.440) | Sun Country Airlines Holdings Inc | Barclays Bank | 5.295 |
| (6.362) | StoneX Group Inc | Goldman Sachs | (22.267) | (11.053) | Sun Country Airlines Holdings Inc | Goldman Sachs | 6.986 |
| (4.259) | StoneX Group Inc | HSBC | (5.111) | (5.829) | Sun Country Airlines Holdings Inc | HSBC | 13.330 |
| (8.084) | StoneX Group Inc | Morgan Stanley | (19.159) | 4.629 | SunCoke Energy Inc | Morgan Stanley | 6.762 |
| 1.501 | STORE Capital Corp (REIT) | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.493 | 26.988 | SunCoke Energy Inc | Merrill Lynch | 1.662 |
| 44.017 | STORE Capital Corp (REIT) | Barclays Bank | 46.218 | 32.179 | SunCoke Energy Inc | Barclays Bank | 5.128 |
| 94.512 | STORE Capital Corp (REIT) | Goldman Sachs | (15.290) | 43.860 | SunCoke Energy Inc | Goldman Sachs | 15.213 |
| 63.814 | STORE Capital Corp (REIT) | HSBC | 38.927 | 13.388 | SunCoke Energy Inc | HSBC | 24.123 |
| 17.942 | STORE Capital Corp (REIT) | Morgan Stanley | 11.221 | (6.443) | Sunlight Financial Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.544 |
| 1.487 | Strategic Education Inc | Bank of America | | (15.595) | Sunlight Financial Holdings Inc | Barclays Bank | (1.868) |
| | | Merrill Lynch | 3.788 | (16.260) | Sunlight Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | (21.989) |
| 1.270 | Strategic Education Inc | Barclays Bank | 3.823 | | | HSBC | (13.496) |
| 2.295 | Strategic Education Inc | Goldman Sachs | 6.013 | | | | |
| 2.003 | Strategic Education Inc | HSBC | 5.097 | | | | |
| 1.186 | Strategic Education Inc | Morgan Stanley | 3.570 | | | | |
| 841 | Strattec Security Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 463 | | | | |
| 1.531 | Strattec Security Corp | Barclays Bank | 1.608 | | | | |
| 2.386 | Strattec Security Corp | HSBC | (2.386) | | | | |
| (22.193) | Stratus Properties Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 26.632 | | | | |
| (6.172) | Stratus Properties Inc | Goldman Sachs | 7.406 | | | | |
| (5.636) | Stratus Properties Inc | Morgan Stanley | (3.382) | | | | |
| (7.293) | Stride Inc | Barclays Bank | (16.045) | | | | |
| (17.632) | Stronghold Digital Mining Inc 'A' | Barclays Bank | (2.292) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 10.694 | Sunnova Energy International Inc | Goldman Sachs | 49.085 | 344 | SVB Financial Group | Morgan Stanley | 12.728 |
| 44.306 | Sunnova Energy International Inc | HSBC | 188.140 | 2.076 | Sweetgreen Inc 'A' | Bank of America | (6.892) |
| 11.411 | SunOpta Inc | Bank of America | | 1.092 | Sweetgreen Inc 'A' | Barclays Bank | (1.421) |
| | | Merrill Lynch | 6.276 | (3.748) | SWK Holdings Corp | Bank of America | |
| 7.455 | SunOpta Inc | Barclays Bank | 9.021 | (5.829) | SWK Holdings Corp | Merrill Lynch | 1.274 |
| 6.717 | SunOpta Inc | Goldman Sachs | 3.694 | (6.033) | Sylvamo Corp | Goldman Sachs | 1.982 |
| 5.788 | SunOpta Inc | HSBC | 11.686 | | | Bank of America | |
| 1.600 | SunPower Corp | Bank of America | | (2.349) | Sylvamo Corp | Merrill Lynch | (17.254) |
| | | Merrill Lynch | 4.544 | (796) | Synaptics Inc | Goldman Sachs | (2.519) |
| 19.579 | SunPower Corp | Barclays Bank | 28.585 | | | Bank of America | |
| (6.540) | SunPower Corp | Goldman Sachs | (18.574) | 327 | Synaptics Inc | Merrill Lynch | (3.216) |
| 3.330 | SunPower Corp | Goldman Sachs | 9.457 | | | Bank of America | |
| 2.697 | Sunrun Inc | Barclays Bank | 8.037 | (1.480) | Synaptics Inc | Merrill Lynch | 1.321 |
| (16.458) | Sunrun Inc | Barclays Bank | (49.045) | 2.087 | Synaptics Inc | Barclays Bank | (12.520) |
| 2.206 | Sunrun Inc | Goldman Sachs | 12.508 | (632) | Synaptics Inc | Goldman Sachs | 8.431 |
| (14.183) | Sunrun Inc | Goldman Sachs | (80.418) | (4.108) | Synaptics Inc | Goldman Sachs | (2.553) |
| (1.371) | Sunrun Inc | HSBC | (8.202) | 2.544 | Synaptics Inc | HSBC | 16.286 |
| 3.911 | Sunrun Inc | HSBC | 20.337 | (1.309) | Synaptics Inc | HSBC | 5.969 |
| (7.646) | Sunstone Hotel Investors Inc (REIT) | Bank of America | | 737 | Synaptics Inc | Morgan Stanley | (11.074) |
| | | Merrill Lynch | (2.408) | 598 | Synchronoss Technologies Inc | Morgan Stanley | 6.235 |
| (31.139) | Sunstone Hotel Investors Inc (REIT) | Barclays Bank | (21.642) | | | Bank of America | |
| (19.141) | Sunstone Hotel Investors Inc (REIT) | Goldman Sachs | (6.029) | 23.494 | Synchronoss Technologies Inc | Merrill Lynch | 99 |
| (42.340) | Sunstone Hotel Investors Inc (REIT) | HSBC | (28.143) | 10.048 | Synchronoss Technologies Inc | Barclays Bank | 1.762 |
| (19.321) | Sunworks Inc | Barclays Bank | (1.546) | 8.154 | Synchrony Financial | Goldman Sachs | 1.658 |
| 6.540 | Super Micro Computer Inc | Barclays Bank | (2.943) | 16.577 | Synchrony Financial | Bank of America | 26.012 |
| 2.171 | Super Micro Computer Inc | Goldman Sachs | (8.054) | 33.029 | Synchrony Financial | Merrill Lynch | 37.299 |
| 1.319 | Super Micro Computer Inc | HSBC | 13 | 22.114 | Synchrony Financial | Barclays Bank | 106.759 |
| (6.506) | Superior Group of Cos Inc | Barclays Bank | (2.798) | 5.735 | Synchrony Financial | Goldman Sachs | 13.938 |
| (5.689) | Superior Group of Cos Inc | Goldman Sachs | (8.249) | (1.810) | Syndax Pharmaceuticals Inc | HSBC | 12.904 |
| (3.069) | Superior Group of Cos Inc | HSBC | (8.348) | (13.782) | Syndax Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| (3.498) | Superior Group of Cos Inc | Morgan Stanley | (1.504) | (10.091) | Syndax Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | (3.774) |
| (22.177) | Superior Industries International Inc | Barclays Bank | (2.439) | (1.549) | Syndax Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (24.808) |
| (21.793) | Superior Industries International Inc | Morgan Stanley | (2.397) | 7.358 | Syneos Health Inc | Goldman Sachs | (22.199) |
| 3.527 | Supernus Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | | | HSBC | (4.020) |
| | | Merrill Lynch | 2.434 | 846 | Syneos Health Inc | Bank of America | 30.340 |
| 18.379 | Supernus Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 18.011 | 43.390 | Syneos Health Inc | Merrill Lynch | 2.377 |
| 10.719 | Supernus Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 7.396 | 2.559 | Syneos Health Inc | Barclays Bank | 187.445 |
| 7.276 | Supernus Pharmaceuticals Inc | HSBC | 14.264 | 1.061 | Syneos Health Inc | Goldman Sachs | 12.258 |
| 30.473 | Surface Oncology Inc | Barclays Bank | (762) | (10.234) | Synlogic Inc | HSBC | 2.981 |
| 21.123 | Surface Oncology Inc | Goldman Sachs | (739) | (31.575) | Synlogic Inc | Goldman Sachs | (205) |
| 4.563 | Surface Oncology Inc | HSBC | (707) | (2.493) | Synopsys Inc | HSBC | 4.736 |
| 7.799 | Surface Oncology Inc | Morgan Stanley | (195) | 3.472 | Synopsys Inc | Barclays Bank | (27.573) |
| (2.542) | Surgery Partners Inc | Bank of America | | 456 | Synopsys Inc | Goldman Sachs | 153.844 |
| | | Merrill Lynch | 11.159 | (699) | Synopsys Inc | HSBC | 21.221 |
| (1.107) | Surgery Partners Inc | Goldman Sachs | 4.860 | 485 | Synopsys Inc | HSBC | (38.885) |
| (8.311) | Surgery Partners Inc | HSBC | 64.493 | (12.088) | Synovus Financial Corp | Morgan Stanley | 5.364 |
| (5.556) | Surgery Partners Inc | Morgan Stanley | 1.111 | (6.875) | Synovus Financial Corp | Bank of America | |
| 3.971 | Surmodics Inc | Barclays Bank | 6.790 | (11.166) | Synovus Financial Corp | Merrill Lynch | (30.045) |
| 1.153 | Surmodics Inc | Goldman Sachs | 3.782 | (18.198) | Synovus Financial Corp | Barclays Bank | (5.167) |
| 911 | Surmodics Inc | HSBC | 4.509 | (13.326) | Synovus Financial Corp | Goldman Sachs | (26.582) |
| 3.656 | Sutro Biopharma Inc | Bank of America | | (1.237) | Syros Pharmaceuticals Inc | HSBC | (22.465) |
| | | Merrill Lynch | (1.024) | (18.387) | Syros Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (14.525) |
| 10.634 | Sutro Biopharma Inc | Barclays Bank | (1.701) | (4.362) | Syros Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| 13.657 | Sutro Biopharma Inc | Goldman Sachs | (3.824) | (6.104) | Syros Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | 41 |
| 12.557 | Sutro Biopharma Inc | HSBC | (8.598) | 14.383 | Sysco Corp | Barclays Bank | (395) |
| 8.852 | Sutro Biopharma Inc | Morgan Stanley | (1.416) | (22.981) | Sysco Corp | HSBC | 620 |
| (2.777) | SVB Financial Group | Barclays Bank | (102.749) | (6.113) | Sysco Corp | Morgan Stanley | (131) |
| (1.369) | SVB Financial Group | Goldman Sachs | (72.352) | 3.266 | System1 Inc | Barclays Bank | (992) |
| (1.204) | SVB Financial Group | HSBC | (47.724) | 2.794 | System1 Inc | Goldman Sachs | 22.062 |
| (1.644) | SVB Financial Group | Morgan Stanley | (60.828) | | | HSBC | (15.283) |
| | | | | | | HSBC | (2.580) |
| | | | | | | Morgan Stanley | 168 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|----------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (9.441) | T Rowe Price Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (47.796) | (59) | Target Corp | Morgan Stanley | (573) |
| (13.154) | T Rowe Price Group Inc | Barclays Bank | (72.610) | 29.971 | Target Hospitality Corp | Morgan Stanley | 8.692 |
| (8.945) | T Rowe Price Group Inc | Goldman Sachs | (51.344) | 1.501 | Tarsus Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.246 |
| (6.205) | T Rowe Price Group Inc | Morgan Stanley | (34.251) | 1.224 | Tarsus Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (147) |
| 16.443 | Tabula Rasa HealthCare Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12.401 | 548 | Tarsus Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 455 |
| 5.927 | Tabula Rasa HealthCare Inc | Goldman Sachs | 3.556 | 1.149 | Tarsus Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (138) |
| 9.836 | Tactile Systems Technology Inc | Barclays Bank | 11.168 | (1.488) | Taylor Morrison Home Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.751) |
| 14.506 | Tactile Systems Technology Inc | Goldman Sachs | 993 | (41.034) | Taylor Morrison Home Corp | Barclays Bank | (95.199) |
| (702) | Take-Two Interactive Software Inc | Bank of America Merrill Lynch | (11.057) | (6.750) | Taylor Morrison Home Corp | Goldman Sachs | (10.594) |
| 2.657 | Take-Two Interactive Software Inc | Barclays Bank | 5.952 | (2.794) | Taylor Morrison Home Corp | HSBC | (7.621) |
| (253) | Take-Two Interactive Software Inc | Goldman Sachs | (3.985) | (927) | Taylor Morrison Home Corp | Morgan Stanley | (2.151) |
| 211 | Take-Two Interactive Software Inc | Goldman Sachs | 3.323 | 11.697 | Taysha Gene Therapies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.837) |
| (2.676) | Take-Two Interactive Software Inc | HSBC | (52.744) | 47.879 | Taysha Gene Therapies Inc | Barclays Bank | (2.394) |
| (2.157) | Take-Two Interactive Software Inc | Morgan Stanley | (4.832) | 11.955 | Taysha Gene Therapies Inc | Goldman Sachs | (8.010) |
| 4.049 | Talaris Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.077 | 16.570 | Taysha Gene Therapies Inc | HSBC | (15.576) |
| 7.045 | Talaris Therapeutics Inc | Barclays Bank | 2.395 | 5.447 | Taysha Gene Therapies Inc | Morgan Stanley | (272) |
| 8.574 | Talaris Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 6.516 | 14.639 | TCR2 Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (146) |
| 4.562 | Talaris Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.551 | 35.525 | TCR2 Therapeutics Inc | Barclays Bank | 2.842 |
| (2.170) | Talis Biomedical Corp | Barclays Bank | (119) | 9.957 | TCR2 Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (100) |
| 18.695 | Talos Energy Inc | Barclays Bank | 44.120 | 19.094 | TCR2 Therapeutics Inc | HSBC | 2.673 |
| 9.918 | Talos Energy Inc | Goldman Sachs | 37.788 | 18.458 | TCR2 Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.477 |
| (1.816) | Tandem Diabetes Care Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.887) | 2.862 | TD SYNEX Corp | Bank of America Merrill Lynch | 9.903 |
| (1.765) | Tandem Diabetes Care Inc | Barclays Bank | (4.165) | 552 | TD SYNEX Corp | Barclays Bank | 2.064 |
| 3.597 | Tandem Diabetes Care Inc | Barclays Bank | 8.489 | (2.189) | TD SYNEX Corp | Barclays Bank | (8.187) |
| (3.547) | Tandem Diabetes Care Inc | Goldman Sachs | (5.462) | 1.647 | TD SYNEX Corp | Goldman Sachs | 3.506 |
| (2.430) | Tandem Diabetes Care Inc | HSBC | (7.527) | 6.833 | TD SYNEX Corp | HSBC | 38.698 |
| 1.262 | Tandem Diabetes Care Inc | HSBC | 1.690 | 1.460 | TD SYNEX Corp | Morgan Stanley | 5.460 |
| 708 | Tandem Diabetes Care Inc | Morgan Stanley | 1.671 | 2.624 | TE Connectivity Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 8.378 |
| (3.540) | Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.805 | 10.088 | TE Connectivity Ltd | Barclays Bank | 51.549 |
| (4.888) | Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT) | Barclays Bank | (6.697) | 25.145 | TE Connectivity Ltd | Goldman Sachs | 126.086 |
| (2.484) | Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.267 | 12.375 | TE Connectivity Ltd | HSBC | 67.261 |
| (21.355) | Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT) | HSBC | 3.706 | (23.518) | Team Inc | Barclays Bank | (2.822) |
| (2.643) | Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT) | Morgan Stanley | (3.621) | (28.862) | Team Inc | Goldman Sachs | (3.463) |
| 3.758 | Tango Therapeutics Inc | Barclays Bank | 3.044 | (7.848) | Team Inc | HSBC | (392) |
| 2.321 | Tango Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 3.041 | (23.427) | Team Inc | Morgan Stanley | (2.811) |
| 1.934 | Tango Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.567 | 1 | Technip Energies NV ADR" | Morgan Stanley | — |
| 15.821 | Tapestry Inc | Barclays Bank | 44.141 | (3.312) | TechTarget Inc | Barclays Bank | (9.207) |
| 8.772 | Tapestry Inc | Goldman Sachs | 18.071 | (7.259) | TechTarget Inc | Goldman Sachs | (25.697) |
| 32.079 | Tapestry Inc | HSBC | 172.793 | (2.519) | TechTarget Inc | HSBC | (31.916) |
| 5.826 | Tapestry Inc | Morgan Stanley | 16.255 | (404) | TechTarget Inc | Morgan Stanley | (1.123) |
| 9.582 | Targa Resources Corp | Bank of America Merrill Lynch | 5.078 | 6.302 | Teekay Corp | Bank of America Merrill Lynch | 378 |
| 10.809 | Targa Resources Corp | Barclays Bank | 36.859 | 39.762 | Teekay Corp | Morgan Stanley | 1.988 |
| 26.427 | Targa Resources Corp | Goldman Sachs | 14.006 | 2.410 | Teekay Tankers Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 7.519 |
| 15.077 | Targa Resources Corp | HSBC | 70.004 | 3.599 | Teekay Tankers Ltd 'A' | Barclays Bank | 3.059 |
| 7.789 | Targa Resources Corp | Morgan Stanley | 26.560 | 9.621 | Teekay Tankers Ltd 'A' | Goldman Sachs | 30.018 |
| 4.943 | Target Corp | Barclays Bank | 47.997 | 2.203 | Teekay Tankers Ltd 'A' | HSBC | 15.024 |
| (1.976) | Target Corp | Barclays Bank | (19.187) | 2.756 | TEGNA Inc | Goldman Sachs | 1.819 |
| 4.629 | Target Corp | Goldman Sachs | (257.558) | (3.318) | Tejon Ranch Co | Barclays Bank | (1.360) |
| (2.715) | Target Corp | Goldman Sachs | 150.046 | (41.454) | Tejon Ranch Co | Goldman Sachs | 3.731 |
| 1.404 | Target Corp | HSBC | (85.068) | (13.005) | Tejon Ranch Co | HSBC | 520 |
| (3.625) | Target Corp | HSBC | 151.208 | (58.391) | Tejon Ranch Co | Morgan Stanley | (23.940) |
| 3.232 | Target Corp | Morgan Stanley | 31.383 | (13.890) | Tela Bio Inc | Bank of America Merrill Lynch | 16.668 |
| | | | | (6.207) | Tela Bio Inc | Barclays Bank | 5.462 |
| | | | | 27.437 | Teladoc Health Inc | Barclays Bank | 31.004 |
| | | | | 14.360 | Teladoc Health Inc | HSBC | 51.696 |
| | | | | 2.967 | Teladoc Health Inc | Morgan Stanley | 3.353 |
| | | | | (5.980) | Teledyne Technologies Inc | Barclays Bank | (4.904) |
| | | | | 812 | Teledyne Technologies Inc | Barclays Bank | 666 |
| | | | | (2.274) | Teledyne Technologies Inc | Goldman Sachs | 4.230 |
| | | | | 1.477 | Teledyne Technologies Inc | Goldman Sachs | (2.747) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3.114) | Teledyne Technologies Inc | HSBC | 14.823 | 291 | Teradyne Inc | Morgan Stanley | 1.413 |
| 113 | Teledyne Technologies Inc | HSBC | 1.440 | 18.758 | Terex Corp | Bank of America | |
| (243) | Teledyne Technologies Inc | Morgan Stanley | (199) | | | Merrill Lynch | 53.835 |
| 1.528 | Teleflex Inc | Barclays Bank | (5.241) | 12.752 | Terex Corp | Barclays Bank | 31.242 |
| 3.416 | Teleflex Inc | Goldman Sachs | 15.679 | 17.209 | Terex Corp | Goldman Sachs | 49.390 |
| 2.071 | Teleflex Inc | HSBC | 54.322 | 38.299 | Terex Corp | HSBC | 75.490 |
| 3.988 | Teleflex Inc | Morgan Stanley | (13.679) | 2.709 | Terns Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| (6.441) | Telephone and Data Systems Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 488 |
| | | Merrill Lynch | (1.803) | 13.125 | Terns Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 1.444 |
| (17.327) | Telephone and Data Systems Inc | Barclays Bank | (347) | 1.346 | Terns Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 148 |
| (23.395) | Telephone and Data Systems Inc | Goldman Sachs | (6.551) | 17.488 | Terran Orbital Corp | Bank of America | |
| (4.213) | Telephone and Data Systems Inc | HSBC | 2.865 | | | Merrill Lynch | 13.317 |
| 3.049 | Telephone and Data Systems Inc | Morgan Stanley | 61 | 47.809 | Terran Orbital Corp | Barclays Bank | (32.032) |
| (1.701) | Telephone and Data Systems Inc | Morgan Stanley | 715 | 15.436 | Terran Orbital Corp | Goldman Sachs | 18.369 |
| (4.692) | Telesat Corp | Barclays Bank | (12.152) | 30.637 | Terran Orbital Corp | HSBC | 19.118 |
| (11.465) | Telesat Corp | Goldman Sachs | (43.796) | 17.151 | Terran Orbital Corp | Morgan Stanley | (11.491) |
| (4.232) | Telesat Corp | Morgan Stanley | (10.961) | 6.681 | Terreno Realty Corp (REIT) | Bank of America | |
| (66.144) | Tellurian Inc | Barclays Bank | (21.166) | | | Merrill Lynch | 474 |
| (6.309) | Tellurian Inc | Goldman Sachs | (4.290) | 29.897 | Terreno Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | 16.071 |
| (6.369) | Tellurian Inc | Morgan Stanley | (2.038) | (3.758) | Terreno Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | (2.819) |
| (15.408) | Telos Corp | Barclays Bank | (31.278) | 45.415 | Terreno Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | (84.665) |
| (3.369) | Telos Corp | Goldman Sachs | (7.985) | (14.346) | Terreno Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | 32.955 |
| (11.634) | Tempur Sealy International Inc | Bank of America | | 26.987 | Terreno Realty Corp (REIT) | HSBC | (82.936) |
| | | Merrill Lynch | (4.932) | (5.206) | Terreno Realty Corp (REIT) | HSBC | 16.531 |
| (45.716) | Tempur Sealy International Inc | Barclays Bank | (52.574) | 18.783 | Terreno Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | 15.155 |
| (27.199) | Tempur Sealy International Inc | Goldman Sachs | (2.368) | 13.435 | Territorial Bancorp Inc | Barclays Bank | 8.598 |
| (47.868) | Tempur Sealy International Inc | HSBC | 28.176 | 1.714 | Territorial Bancorp Inc | Goldman Sachs | 977 |
| (10.702) | Tempur Sealy International Inc | Morgan Stanley | (12.307) | 2.890 | Territorial Bancorp Inc | HSBC | (462) |
| (2.341) | Tenable Holdings Inc | Bank of America | | 13.136 | Territorial Bancorp Inc | Morgan Stanley | 8.407 |
| | | Merrill Lynch | (10.675) | (366) | Tesla Inc | Bank of America | |
| (10.256) | Tenable Holdings Inc | Barclays Bank | (17.025) | | | Merrill Lynch | (13.307) |
| 5.935 | Tenable Holdings Inc | Barclays Bank | 9.852 | (1.998) | Tesla Inc | Barclays Bank | (152.308) |
| (7.054) | Tenable Holdings Inc | Goldman Sachs | (31.082) | (1.011) | Tesla Inc | Goldman Sachs | (109.524) |
| (14.510) | Tenable Holdings Inc | HSBC | (117.241) | (211) | Tesla Inc | HSBC | (6.731) |
| (3.912) | Tenable Holdings Inc | Morgan Stanley | (6.494) | (1.086) | Tesla Inc | Morgan Stanley | (85.984) |
| (3.970) | Tenaya Therapeutics Inc | HSBC | 596 | 18.695 | TESSCO Technologies Inc | Morgan Stanley | (3.365) |
| 6.707 | Tenet Healthcare Corp | Bank of America | | 6.813 | Tetra Tech Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 19.188 | | | Merrill Lynch | 67.858 |
| (2.711) | Tenet Healthcare Corp | Bank of America | | 11.603 | Tetra Tech Inc | Barclays Bank | 105.820 |
| | | Merrill Lynch | (2.908) | 11.937 | Tetra Tech Inc | Goldman Sachs | 119.190 |
| (8.545) | Tenet Healthcare Corp | Barclays Bank | (5.640) | 17.058 | Tetra Tech Inc | HSBC | 148.360 |
| (6.356) | Tenet Healthcare Corp | Goldman Sachs | 36.420 | 10.583 | Tetra Tech Inc | Morgan Stanley | 96.517 |
| (3.937) | Tenet Healthcare Corp | HSBC | 22.441 | (73.988) | TETRA Technologies Inc | Barclays Bank | (42.173) |
| 2.358 | Tenet Healthcare Corp | HSBC | (1.707) | 1.693 | Texas Capital Bancshares Inc | Bank of America | |
| (16.479) | Tennant Co | Barclays Bank | (33.617) | | | Merrill Lynch | 6.344 |
| (4.953) | Tennant Co | Goldman Sachs | (10.550) | 15.513 | Texas Capital Bancshares Inc | Barclays Bank | 57.088 |
| (10.576) | Tenneco Inc 'A' | Barclays Bank | (6.874) | 2.550 | Texas Capital Bancshares Inc | Goldman Sachs | 9.843 |
| (4.014) | Tenneco Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.609) | 8.304 | Texas Capital Bancshares Inc | HSBC | 16.889 |
| 1.549 | Tenon Medical Inc | Barclays Bank | (1.363) | 6.213 | Texas Capital Bancshares Inc | Morgan Stanley | 22.864 |
| 4.517 | Tenon Medical Inc | Goldman Sachs | (12.377) | (4.751) | Texas Instruments Inc | Bank of America | |
| (7.956) | Teradata Corp | Barclays Bank | (15.912) | | | Merrill Lynch | (27.936) |
| (744) | Teradata Corp | Goldman Sachs | (1.013) | (12.037) | Texas Instruments Inc | Barclays Bank | (53.565) |
| (4.886) | Teradata Corp | HSBC | (3.931) | 4.417 | Texas Instruments Inc | Barclays Bank | 19.637 |
| 1.522 | Teradyne Inc | Bank of America | | (2.497) | Texas Instruments Inc | Goldman Sachs | (14.682) |
| | | Merrill Lynch | 6.430 | 3.154 | Texas Instruments Inc | Goldman Sachs | 20.088 |
| 1.440 | Teradyne Inc | Barclays Bank | 6.991 | (4.006) | Texas Instruments Inc | HSBC | (35.384) |
| (3.787) | Teradyne Inc | Barclays Bank | (18.386) | (2.183) | Texas Instruments Inc | Morgan Stanley | (10.358) |
| 3.471 | Teradyne Inc | Goldman Sachs | 14.665 | (172) | Texas Pacific Land Corp | Bank of America | |
| (4.693) | Teradyne Inc | Goldman Sachs | (17.846) | | | Merrill Lynch | (37.785) |
| 4.513 | Teradyne Inc | HSBC | 31.857 | (322) | Texas Pacific Land Corp | Barclays Bank | (58.759) |
| (1.797) | Teradyne Inc | HSBC | (11.665) | (59) | Texas Pacific Land Corp | Goldman Sachs | (12.961) |
| | | | | (85) | Texas Pacific Land Corp | HSBC | (24.821) |
| | | | | (44) | Texas Pacific Land Corp | Morgan Stanley | (8.030) |
| | | | | 22.966 | Texas Roadhouse Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 63.154 |
| | | | | 12.929 | Texas Roadhouse Inc | Barclays Bank | 98.389 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 28.658 | Texas Roadhouse Inc | Goldman Sachs | 81.113 | (13.760) | ThredUp Inc 'A' | HSBC | 17.062 |
| 19.589 | Texas Roadhouse Inc | HSBC | 39.264 | (10.165) | ThredUp Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.931 |
| 7.381 | Texas Roadhouse Inc | Morgan Stanley | 56.169 | 4.688 | Thryv Holdings Inc | Barclays Bank | 6.938 |
| (5.410) | Textainer Group Holdings Ltd | Bank of America | | 5.728 | Thryv Holdings Inc | Goldman Sachs | 13.690 |
| (18.231) | Textainer Group Holdings Ltd | Merrill Lynch | (8.955) | 4.013 | Thryv Holdings Inc | HSBC | 8.016 |
| (22.776) | Textainer Group Holdings Ltd | Barclays Bank | (20.419) | (22.407) | Tidewater Inc | Morgan Stanley | (42.125) |
| (9.565) | Textainer Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | (42.136) | 5.026 | Tile Shop Holdings Inc | Barclays Bank | 1.357 |
| (1.488) | TFF Pharmaceuticals Inc | HSBC | (13.582) | 8.210 | Tile Shop Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.067) |
| (14.472) | TFF Pharmaceuticals Inc | Bank of America | (1.711) | 19.739 | Tilly's Inc 'A' | Barclays Bank | 3.356 |
| (16.206) | TFS Financial Corp | Merrill Lynch | (579) | 5.644 | Timberland Bancorp Inc | Goldman Sachs | 734 |
| (99.989) | TFS Financial Corp | Barclays Bank | (14.747) | 4.932 | Timken Co | Bank of America | |
| (144.379) | TFS Financial Corp | Goldman Sachs | (54.994) | 16.353 | Timken Co | Merrill Lynch | 11.320 |
| (148.045) | TFS Financial Corp | HSBC | (130.138) | 16.327 | Timken Co | Barclays Bank | 24.693 |
| (42.510) | TFS Financial Corp | Morgan Stanley | (123.452) | 23.803 | Timken Co | Goldman Sachs | 38.789 |
| 1.600 | TFS Financial Corp | Morgan Stanley | (23.381) | 18.428 | Timken Co | HSBC | 6.243 |
| (8.093) | TG Therapeutics Inc | Barclays Bank | 880 | 5.665 | TimkenSteel Corp | Morgan Stanley | 28.032 |
| (28.620) | TG Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 5.544 | 11.930 | TimkenSteel Corp | Barclays Bank | 6.571 |
| (4.490) | TG Therapeutics Inc | HSBC | 49.084 | 1.173 | TimkenSteel Corp | Goldman Sachs | 39.011 |
| 2.902 | TherapeuticsMD Inc | Morgan Stanley | 7.431 | (1.409) | Titan International Inc | HSBC | 7.402 |
| (2.497) | Theravance Biopharma Inc | Barclays Bank | 20.865 | (2.689) | Titan International Inc | Bank of America | |
| (8.533) | Theravance Biopharma Inc | Goldman Sachs | 19 | (18.715) | Titan International Inc | Merrill Lynch | (21) |
| 173 | Thermo Fisher Scientific Inc | Bank of America | 1.280 | 4.814 | Titan Machinery Inc | Goldman Sachs | (2.151) |
| (451) | Thermo Fisher Scientific Inc | Merrill Lynch | 506 | 13.759 | Titan Machinery Inc | HSBC | (55.771) |
| 261 | Thermo Fisher Scientific Inc | Bank of America | (14.459) | 3.585 | Titan Machinery Inc | Barclays Bank | 12.131 |
| 1.549 | Thermo Fisher Scientific Inc | Merrill Lynch | 4.236 | 2.588 | Titan Machinery Inc | Goldman Sachs | 39.488 |
| (353) | Thermo Fisher Scientific Inc | Barclays Bank | 46.434 | (14.323) | Tivity Health Inc | HSBC | 11.866 |
| 1.004 | Thermo Fisher Scientific Inc | Goldman Sachs | (11.317) | (19.397) | Tivity Health Inc | Bank of America | 6.522 |
| (1.598) | Thermo Fisher Scientific Inc | HSBC | (63.216) | (696) | Tivity Health Inc | Merrill Lynch | (5.300) |
| (553) | Thermo Fisher Scientific Inc | Morgan Stanley | (8.975) | (10.771) | Tivity Health Inc | Barclays Bank | (2.328) |
| (24.378) | Thermon Group Holdings Inc | Barclays Bank | (13.164) | (1.049) | Tivity Health Inc | Goldman Sachs | (258) |
| (37.454) | Thermon Group Holdings Inc | Goldman Sachs | (23.971) | (24.860) | TJX Cos Inc | HSBC | (3.702) |
| (8.164) | Thermon Group Holdings Inc | HSBC | (5.143) | 10.077 | TJX Cos Inc | Bank of America | (7.270) |
| (9.241) | Thermon Group Holdings Inc | Morgan Stanley | (4.990) | 10.077 | TJX Cos Inc | Merrill Lynch | (68.116) |
| 4.340 | Theseus Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (911) | 10.077 | TJX Cos Inc | Barclays Bank | 27.611 |
| 8.356 | Theseus Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (1.755) | (3.717) | TJX Cos Inc | Goldman Sachs | (14.180) |
| 3.800 | Third Coast Bancshares Inc | Bank of America | 1.973 | 6.125 | TJX Cos Inc | Goldman Sachs | 42.908 |
| 12.017 | Third Coast Bancshares Inc | Merrill Lynch | 1.202 | (3.764) | TJX Cos Inc | Morgan Stanley | (10.313) |
| 7.851 | Third Coast Bancshares Inc | Barclays Bank | 4.452 | (774) | T-Mobile US Inc | Bank of America | |
| 12.112 | Third Coast Bancshares Inc | Goldman Sachs | 848 | (1.500) | T-Mobile US Inc | Merrill Lynch | (3.197) |
| 2.565 | Third Coast Bancshares Inc | HSBC | 257 | (1.772) | T-Mobile US Inc | Barclays Bank | (3.691) |
| (4.429) | Thor Industries Inc | Morgan Stanley | (18.070) | (4.186) | T-Mobile US Inc | Goldman Sachs | (4.706) |
| (6.980) | Thor Industries Inc | Barclays Bank | 12.704 | (14.537) | T-Mobile US Inc | HSBC | (28.743) |
| (6.071) | Thor Industries Inc | Goldman Sachs | 54.518 | (16.341) | T-Mobile US Inc | Morgan Stanley | (42.627) |
| 6.592 | Thorne HealthTech Inc | HSBC | 1.648 | (28.600) | Toast Inc 'A' | Goldman Sachs | (45.755) |
| 9.605 | Thorne HealthTech Inc | Barclays Bank | (2.978) | 19.055 | Toast Inc 'A' | Morgan Stanley | (39.468) |
| 8.728 | Thorne HealthTech Inc | Goldman Sachs | (3.491) | 12.760 | Toll Brothers Inc | Bank of America | 56.540 |
| 6.558 | Thorne HealthTech Inc | HSBC | 1.640 | 8.461 | Toll Brothers Inc | Merrill Lynch | 44.277 |
| (5.403) | Thoughtworks Holding Inc | Morgan Stanley | (7.240) | 23.544 | Toll Brothers Inc | Barclays Bank | 24.537 |
| (18.754) | Thoughtworks Holding Inc | Bank of America | (11.252) | 15.490 | Toll Brothers Inc | Goldman Sachs | 70.520 |
| (4.208) | Thoughtworks Holding Inc | Merrill Lynch | (2.693) | (1.372) | Tompkins Financial Corp | HSBC | 51.441 |
| (12.379) | Thoughtworks Holding Inc | Barclays Bank | (7.428) | (4.391) | Tompkins Financial Corp | Bank of America | |
| (11.886) | ThredUp Inc 'A' | HSBC | (7.428) | (3.106) | Tompkins Financial Corp | Merrill Lynch | (2.765) |
| (21.211) | ThredUp Inc 'A' | Goldman Sachs | 13.999 | (3.836) | Tompkins Financial Corp | Barclays Bank | (13.656) |
| | | | | (8.745) | Tompkins Financial Corp | Goldman Sachs | (8.359) |
| | | | | (26.623) | Tompkins Financial Corp | HSBC | (5.505) |
| | | | | (2.625) | Tonix Pharmaceuticals Holding Corp | Morgan Stanley | (27.047) |
| | | | | (51.065) | Tootsie Roll Industries Inc | HSBC | 3.436 |
| | | | | (3.510) | Tootsie Roll Industries Inc | Bank of America | |
| | | | | (4.662) | Tootsie Roll Industries Inc | Merrill Lynch | 4.305 |
| | | | | (848) | TopBuild Corp | Barclays Bank | (34.214) |
| | | | | (1.953) | TopBuild Corp | Goldman Sachs | 5.756 |
| | | | | | | HSBC | (746) |
| | | | | | | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 3.536 |
| | | | | | | Barclays Bank | (9.511) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 2.838 | TopBuild Corp | HSBC | (3.377) | (6.134) | TransMedics Group Inc | Barclays Bank | (7.790) |
| 587 | TopBuild Corp | Morgan Stanley | 1.180 | (6.550) | TransMedics Group Inc | Goldman Sachs | (11.332) |
| (425) | TopBuild Corp | Morgan Stanley | 2.596 | (1.893) | TransMedics Group Inc | HSBC | (4.221) |
| (2.871) | Torchmark Corp | Bank of America | | (12.862) | TransUnion | Barclays Bank | (53.851) |
| | | Merrill Lynch | (3.330) | (26.946) | TransUnion | Goldman Sachs | (128.532) |
| 2.721 | Torchmark Corp | Bank of America | | (16.434) | TransUnion | HSBC | (70.009) |
| | | Merrill Lynch | 11.974 | (6.162) | TransUnion | Morgan Stanley | (26.447) |
| (2.408) | Torchmark Corp | Barclays Bank | (4.262) | 13.655 | TransWorld Holdings Inc | Bank of America | |
| 7.991 | Torchmark Corp | Barclays Bank | 14.144 | | | Merrill Lynch | 11.699 |
| (3.749) | Torchmark Corp | Goldman Sachs | (4.349) | 22.780 | TransWorld Holdings Inc | Barclays Bank | 29.614 |
| 3.427 | Torchmark Corp | Goldman Sachs | (2.270) | 21.284 | TransWorld Holdings Inc | HSBC | (1.924) |
| (5.176) | Torchmark Corp | HSBC | 4.056 | 47.312 | TransWorld Holdings Inc | Morgan Stanley | 61.506 |
| (3.537) | Torchmark Corp | Morgan Stanley | (6.260) | 40.759 | Travel + Leisure Co | Bank of America | |
| 1.391 | Torchmark Corp | Morgan Stanley | 2.462 | | | Merrill Lynch | 48.503 |
| (21.720) | Toro Co | Barclays Bank | (125.976) | 82.744 | Travel + Leisure Co | Barclays Bank | 213.480 |
| (43.091) | Toro Co | Goldman Sachs | (146.510) | 9.455 | Travel + Leisure Co | Goldman Sachs | 11.251 |
| (988) | Toro Co | HSBC | (2.016) | 32.649 | Travel + Leisure Co | HSBC | 56.483 |
| (1.306) | Torrid Holdings Inc | Bank of America | | 3.564 | Travel + Leisure Co | Morgan Stanley | 9.195 |
| | | Merrill Lynch | (535) | (672) | TravelCenters | Bank of America | |
| (47.169) | Torrid Holdings Inc | HSBC | 15.094 | | of America Inc | Merrill Lynch | (3.232) |
| 13.461 | Towne Bank | Bank of America | | (7.471) | TravelCenters | Barclays Bank | (30.108) |
| | | Merrill Lynch | 20.326 | (4.067) | TravelCenters | HSBC | (9.711) |
| 65.052 | Towne Bank | Barclays Bank | 45.536 | (3.088) | TravelCenters | Morgan Stanley | (11.118) |
| 98.687 | Towne Bank | Goldman Sachs | 149.017 | 1.045 | Travelers Cos Inc | Bank of America | |
| 58.899 | Towne Bank | HSBC | 39.057 | | | Merrill Lynch | 2.163 |
| 7.577 | Towne Bank | Morgan Stanley | 5.304 | 4.034 | Travelers Cos Inc | Barclays Bank | 18.032 |
| 21.283 | Townsquare Media Inc 'A' | Bank of America | | 23.502 | Travelers Cos Inc | Goldman Sachs | 49.337 |
| | | Merrill Lynch | (14.685) | 8.297 | Travelers Cos Inc | HSBC | 36.438 |
| 10.577 | Townsquare Media Inc 'A' | Barclays Bank | (740) | 13.051 | Travelers Cos Inc | Morgan Stanley | 58.338 |
| 31.746 | Townsquare Media Inc 'A' | Goldman Sachs | (21.905) | (4.241) | Travere Therapeutics Inc | Barclays Bank | (2.799) |
| 5.325 | Townsquare Media Inc 'A' | HSBC | (1.757) | (5.411) | Travere Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.028) |
| 1.849 | Townsquare Media Inc 'A' | Morgan Stanley | (129) | (4.403) | Travere Therapeutics Inc | HSBC | (11.171) |
| (10.372) | TPG RE Finance Trust Inc (REIT) | Bank of America | | (1.815) | Travere Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.847) |
| | | Merrill Lynch | (2.013) | 3.394 | Treace Medical | | |
| (31.073) | TPG RE Finance Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | (7.768) | | Concepts Inc | Barclays Bank | 2.002 |
| (4.313) | TPG RE Finance Trust Inc (REIT) | HSBC | (2.588) | 2.194 | Treace Medical | Goldman Sachs | 3.774 |
| (7.235) | TPG RE Finance Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (1.809) | 9.348 | Treace Medical | HSBC | 31.222 |
| (4.200) | TPI Composites Inc | Goldman Sachs | (11.277) | | Concepts Inc | Goldman Sachs | 22.307 |
| (741) | TPI Composites Inc | HSBC | (2.901) | 30.558 | Trean Insurance Group Inc | Morgan Stanley | 6.076 |
| 6.931 | Tractor Supply Co | Bank of America | | 11.047 | Trean Insurance Group Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (114.015) | (776) | Trecora Resources | Merrill Lynch | (54) |
| 3.428 | Tractor Supply Co | Barclays Bank | 42.233 | (34.128) | Trecora Resources | Barclays Bank | (2.730) |
| 1.989 | Tractor Supply Co | Goldman Sachs | (21.486) | (238) | Trecora Resources | Goldman Sachs | (17) |
| 409 | Tractor Supply Co | HSBC | (3.714) | (5.153) | Trecora Resources | Morgan Stanley | (412) |
| 509 | Tractor Supply Co | Morgan Stanley | 6.345 | (24.143) | Tredegar Corp | Barclays Bank | (6.760) |
| (19.441) | Trade Desk Inc 'A' | Goldman Sachs | (5.297) | (14.860) | Tredegar Corp | Goldman Sachs | (17.238) |
| (3.625) | Trade Desk Inc 'A' | HSBC | (22.946) | (34.417) | Tredegar Corp | HSBC | (28.566) |
| (8.706) | Trade Desk Inc 'A' | Morgan Stanley | 10.273 | (24.094) | Tredegar Corp | Morgan Stanley | (6.746) |
| (2.460) | Tradeweb Markets Inc 'A' | Bank of America | | (5.528) | TreeHouse Foods Inc | Barclays Bank | 2.211 |
| | | Merrill Lynch | (4.312) | (8.043) | TreeHouse Foods Inc | Goldman Sachs | (25.094) |
| (13.523) | Tradeweb Markets Inc 'A' | Barclays Bank | (23.389) | 573 | Trex Co Inc | Bank of America | |
| 4.154 | Tradeweb Markets Inc 'A' | Barclays Bank | 6.937 | | | Merrill Lynch | 2.126 |
| (441) | Tradeweb Markets Inc 'A' | HSBC | (447) | 2.840 | Trex Co Inc | Barclays Bank | 1.606 |
| 444 | Tradeweb Markets Inc 'A' | HSBC | 3.206 | 10.297 | Trex Co Inc | Goldman Sachs | 37.092 |
| (785) | Tradeweb Markets Inc 'A' | Morgan Stanley | (352) | 6.114 | Trex Co Inc | Morgan Stanley | 10.272 |
| (37.545) | Traeger Inc | Barclays Bank | 7.134 | 9.627 | Tri Pointe Homes Inc | Bank of America | |
| (17.106) | Traeger Inc | HSBC | 9.237 | | | Merrill Lynch | 5.776 |
| (6.960) | Trane Technologies Plc | Bank of America | | 50.375 | Tri Pointe Homes Inc | Barclays Bank | 34.759 |
| | | Merrill Lynch | (36.269) | 43.238 | Tri Pointe Homes Inc | Goldman Sachs | 25.943 |
| 12.738 | Trane Technologies Plc | Barclays Bank | 74.263 | 20.783 | Tri Pointe Homes Inc | HSBC | 6.027 |
| (712) | Trane Technologies Plc | Barclays Bank | (4.151) | 9.313 | Tri Pointe Homes Inc | Morgan Stanley | 6.426 |
| (2.044) | Trane Technologies Plc | Goldman Sachs | (9.069) | 16.277 | Tricida Inc | Barclays Bank | (23.113) |
| 2.387 | Trane Technologies Plc | Morgan Stanley | 13.916 | 9.961 | Tricida Inc | Goldman Sachs | (10.758) |
| (6.482) | Trane Technologies Plc | Morgan Stanley | (37.790) | 5.111 | Tricida Inc | HSBC | 4.804 |
| 3.060 | Transcat Inc | Barclays Bank | (11.261) | 16.820 | TriCo Bancshares | Barclays Bank | 21.866 |
| 1.060 | Transcat Inc | Goldman Sachs | (4.834) | | | | |
| 1.123 | Transcat Inc | HSBC | (11.095) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 14.132 | TriCo Bancshares | Goldman Sachs | 55.397 | 429 | Trupanion Inc | Bank of America | |
| 22.897 | TriCo Bancshares | HSBC | 97.312 | | | Merrill Lynch | 1.151 |
| 6.136 | TriCo Bancshares | Morgan Stanley | 7.977 | (13.229) | Trupanion Inc | Barclays Bank | (45.375) |
| (1.969) | TriMas Corp | Bank of America | | 396 | Trupanion Inc | Barclays Bank | 1.462 |
| | | Merrill Lynch | (98) | 1.310 | Trupanion Inc | Goldman Sachs | 3.341 |
| (19.734) | TriMas Corp | Barclays Bank | (20.918) | (1.104) | Trupanion Inc | HSBC | (6.148) |
| (28.615) | TriMas Corp | Goldman Sachs | (1.039) | 417 | Trupanion Inc | HSBC | 2.572 |
| (21.646) | TriMas Corp | HSBC | (12.543) | (3.716) | Trupanion Inc | Morgan Stanley | (12.746) |
| (10.466) | TriMas Corp | Morgan Stanley | (11.094) | 535 | Trupanion Inc | Morgan Stanley | 1.835 |
| (1.687) | Trimble Inc | Bank of America | | (7.544) | TrustCo Bank Corp NY | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (4.873) | | | Merrill Lynch | (9.958) |
| (34.387) | Trimble Inc | Barclays Bank | (36.451) | (7.500) | TrustCo Bank Corp NY | Barclays Bank | (3.900) |
| (31.177) | Trimble Inc | Goldman Sachs | (86.048) | (8.699) | TrustCo Bank Corp NY | Goldman Sachs | (11.483) |
| (33.032) | Trimble Inc | HSBC | (201.496) | (2.687) | TrustCo Bank Corp NY | HSBC | (349) |
| 1.831 | TriNet Group Inc | Bank of America | | (2.109) | TrustCo Bank Corp NY | Morgan Stanley | (1.097) |
| | | Merrill Lynch | (4.486) | (8.080) | Trustmark Corp | Bank of America | |
| 9.172 | TriNet Group Inc | Barclays Bank | 10.823 | | | Merrill Lynch | (9.145) |
| 10.598 | TriNet Group Inc | Goldman Sachs | (16.498) | (7.820) | Trustmark Corp | Barclays Bank | (2.276) |
| 5.440 | TriNet Group Inc | HSBC | (22.253) | (30.168) | Trustmark Corp | Goldman Sachs | (50.490) |
| 2.984 | TriNet Group Inc | Morgan Stanley | 3.031 | (48.039) | Trustmark Corp | HSBC | (39.769) |
| (2.397) | Trinity Industries Inc | Bank of America | | (3.352) | Trustmark Corp | Morgan Stanley | (1.240) |
| | | Merrill Lynch | (1.086) | 9.421 | TTEC Holdings Inc | Barclays Bank | 38.532 |
| 11.837 | Trinity Industries Inc | Barclays Bank | 4.143 | 7.309 | TTEC Holdings Inc | Goldman Sachs | 25.947 |
| (13.487) | Trinity Industries Inc | Barclays Bank | (4.827) | 4.381 | TTEC Holdings Inc | HSBC | 13.274 |
| 12.308 | Trinity Industries Inc | Goldman Sachs | 985 | 533 | TTEC Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.180 |
| (9.732) | Trinity Industries Inc | Morgan Stanley | (4.425) | (3.440) | TTM Technologies Inc | Bank of America | |
| (55.596) | Trinity Place Holdings Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 3 |
| | | Merrill Lynch | (7.227) | (83.241) | TTM Technologies Inc | Barclays Bank | (33.296) |
| (2.631) | Trinity Place Holdings Inc | Barclays Bank | (368) | (97.473) | TTM Technologies Inc | Goldman Sachs | (27.292) |
| (16.263) | Trinity Place Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.114) | (6.173) | TTM Technologies Inc | HSBC | (4.018) |
| 7.740 | Trinseo Plc | Bank of America | | (36.939) | Tucows Inc 'A' | Barclays Bank | (194.299) |
| | | Merrill Lynch | 20.679 | (1.968) | Tupperware Brands Corp | Bank of America | |
| 3.291 | Trinseo Plc | Barclays Bank | 7.931 | | | Merrill Lynch | 394 |
| 8.506 | Trinseo Plc | Goldman Sachs | 23.987 | (14.626) | Tupperware Brands Corp | Barclays Bank | (9.653) |
| 2.364 | Trinseo Plc | HSBC | 7.021 | (13.600) | Tupperware Brands Corp | Goldman Sachs | 2.720 |
| 1.819 | Trinseo Plc | Morgan Stanley | 4.384 | (10.983) | Tupperware Brands Corp | HSBC | 19.769 |
| (5.667) | TripAdvisor Inc | Bank of America | | 3.520 | Turning Point Brands Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (3.740) | | | Merrill Lynch | (1.549) |
| (6.475) | TripAdvisor Inc | Barclays Bank | (8.677) | 3.177 | Turning Point Brands Inc | Barclays Bank | 2.033 |
| (7.511) | TripAdvisor Inc | Goldman Sachs | (4.957) | 15.927 | Turning Point Brands Inc | Goldman Sachs | (6.967) |
| (4.491) | TripAdvisor Inc | HSBC | (8.313) | 3.941 | Turning Point Brands Inc | HSBC | 5.320 |
| 1.887 | TriState Capital Holdings Inc | Bank of America | | 3.085 | Turning Point Brands Inc | Morgan Stanley | 1.974 |
| | | Merrill Lynch | 3.000 | (6.848) | Turning Point | | |
| 15.320 | TriState Capital Holdings Inc | Barclays Bank | 22.214 | | Therapeutics Inc | Barclays Bank | 11.847 |
| (14.094) | Triton International Ltd | Barclays Bank | (34.248) | (9.993) | Turning Point | | |
| (1.033) | Triton International Ltd | Goldman Sachs | (3.326) | | Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (24.783) |
| (6.704) | Triton International Ltd | HSBC | (28.224) | (4.668) | Turtle Beach Corp | Bank of America | |
| (2.066) | Triton International Ltd | Morgan Stanley | (5.020) | | | Merrill Lynch | (560) |
| (5.425) | Triumph Bancorp Inc | Barclays Bank | (10.470) | (9.543) | Turtle Beach Corp | Barclays Bank | 8.589 |
| (5.737) | Triumph Bancorp Inc | Goldman Sachs | (15.605) | (2.282) | Turtle Beach Corp | Goldman Sachs | (274) |
| (41.920) | Triumph Group Inc | Barclays Bank | (19.283) | (14.596) | Turtle Beach Corp | HSBC | (14.888) |
| (6.236) | Triumph Group Inc | HSBC | 30.145 | (1.226) | Turtle Beach Corp | Morgan Stanley | 1.103 |
| (15.019) | Tronox Holdings Plc 'A' | Barclays Bank | (9.612) | 23.823 | TuSimple Holdings Inc 'A' | Bank of America | |
| (4.546) | Tronox Holdings Plc 'A' | Goldman Sachs | (4.728) | | | Merrill Lynch | (6.280) |
| (4.937) | Tronox Holdings Plc 'A' | HSBC | (9.138) | 6.372 | TuSimple Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | 510 |
| (28.674) | Tronox Holdings Plc 'A' | Morgan Stanley | (18.351) | 3.336 | TuSimple Holdings Inc 'A' | HSBC | (1.497) |
| (9.775) | TrueBlue Inc | Barclays Bank | 11.437 | 8.159 | TuSimple Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 653 |
| (4.846) | TrueBlue Inc | Goldman Sachs | 7.027 | 15.256 | Tutor Perini Corp | Bank of America | |
| (7.909) | TrueBlue Inc | HSBC | 28.472 | | | Merrill Lynch | 10.222 |
| (931) | TrueBlue Inc | Morgan Stanley | 1.089 | 11.225 | Tutor Perini Corp | Barclays Bank | 7.184 |
| 29.106 | TrueCar Inc | Bank of America | | 46.835 | Tutor Perini Corp | Goldman Sachs | 31.379 |
| | | Merrill Lynch | 7.277 | 12.354 | Tutor Perini Corp | HSBC | 10.748 |
| 30.338 | TrueCar Inc | Goldman Sachs | 7.585 | 5.185 | Tutor Perini Corp | Morgan Stanley | 3.318 |
| 17.228 | Truist Financial Corp | Bank of America | | 1.561 | Twilio Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 48.066 | | | Merrill Lynch | 9.694 |
| 60.636 | Truist Financial Corp | Barclays Bank | 99.443 | (3.233) | Twilio Inc 'A' | Bank of America | |
| 86.265 | Truist Financial Corp | Goldman Sachs | 240.679 | | | Merrill Lynch | (17.211) |
| 76.685 | Truist Financial Corp | HSBC | 51.974 | 2.001 | Twilio Inc 'A' | Barclays Bank | 11.466 |
| 11.876 | Truist Financial Corp | Morgan Stanley | 19.477 | (1.832) | Twilio Inc 'A' | Barclays Bank | (20.574) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-----------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 392 | Twilio Inc 'A' | Goldman Sachs | (226) | (6.472) | UGI Corp | HSBC | (29.901) |
| 749 | Twilio Inc 'A' | Morgan Stanley | 7.286 | (17.622) | UiPath Inc 'A' | Barclays Bank | (5.463) |
| (5.921) | Twin Disc Inc | Goldman Sachs | 16.283 | 1.378 | UiPath Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.268 |
| (19.107) | Twin Disc Inc | HSBC | 56.939 | (5.747) | UiPath Inc 'A' | Goldman Sachs | (5.287) |
| (9.208) | Twin Disc Inc | Morgan Stanley | 1.473 | 19.527 | UiPath Inc 'A' | HSBC | 33.196 |
| 843 | Twist Bioscience Corp | Bank of America | | 31 | Ultra Beauty Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.065 | | | Merrill Lynch | 731 |
| 1.899 | Twist Bioscience Corp | Barclays Bank | (5.070) | 2.656 | Ultra Beauty Inc | Barclays Bank | 186.186 |
| 4.895 | Twist Bioscience Corp | Goldman Sachs | 10.725 | 2.021 | Ultra Beauty Inc | Goldman Sachs | 47.675 |
| 3.947 | Twist Bioscience Corp | HSBC | 17.396 | (700) | Ultra Clean Holdings Inc | Bank of America | |
| 2.034 | Twist Bioscience Corp | Morgan Stanley | (5.431) | | | Merrill Lynch | (1.153) |
| (4.152) | Twitter Inc | Barclays Bank | (8.387) | (9.179) | Ultra Clean Holdings Inc | Barclays Bank | (15.971) |
| (4.789) | Two Harbors Investment Corp (REIT) | Bank of America | | (5.305) | Ultra Clean Holdings Inc | Goldman Sachs | (11.141) |
| | | Merrill Lynch | (1.006) | (4.806) | Ultra Clean Holdings Inc | HSBC | (13.173) |
| (194.304) | Two Harbors Investment Corp (REIT) | Barclays Bank | (50.519) | 9.928 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Bank of America | |
| (164.213) | Two Harbors Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (34.485) | 4.403 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Merrill Lynch | (71.710) |
| (95.539) | Two Harbors Investment Corp (REIT) | HSBC | (10.509) | 5.760 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Barclays Bank | (1.365) |
| (47.401) | Two Harbors Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (12.324) | 4.658 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs | (42.733) |
| (2.693) | Tyler Technologies Inc | Bank of America | | 1.677 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | HSBC | (23.291) |
| | | Merrill Lynch | (26.365) | | | Morgan Stanley | (520) |
| (4.171) | Tyler Technologies Inc | Barclays Bank | (49.384) | (21.699) | Ultralife Corp | Morgan Stanley | 7.378 |
| (5.300) | Tyler Technologies Inc | Goldman Sachs | (52.140) | 5.742 | UMB Financial Corp | Bank of America | |
| (913) | Tyler Technologies Inc | HSBC | (922) | | | Merrill Lynch | 14.377 |
| (5.441) | Tyler Technologies Inc | Morgan Stanley | (64.422) | 20.598 | UMB Financial Corp | Barclays Bank | 46.445 |
| 395 | Tyme Technologies Inc | Morgan Stanley | (6) | 20.075 | UMB Financial Corp | Goldman Sachs | 47.777 |
| 9.040 | Tyson Foods Inc 'A' | Barclays Bank | 17.899 | 7.715 | UMB Financial Corp | HSBC | 1.312 |
| (4.409) | Tyson Foods Inc 'A' | Barclays Bank | (8.730) | 1.262 | UMB Financial Corp | Morgan Stanley | 2.814 |
| 13.652 | Tyson Foods Inc 'A' | Goldman Sachs | (20.068) | (19.434) | UMH Properties Inc (REIT) | Bank of America | |
| (9.524) | Tyson Foods Inc 'A' | Goldman Sachs | 12.429 | | | Merrill Lynch | (8.173) |
| 15.026 | Tyson Foods Inc 'A' | HSBC | (44.905) | (25.261) | UMH Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (4.547) |
| (353) | Tyson Foods Inc 'A' | HSBC | (1.531) | (23.618) | UMH Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (13.020) |
| 8.914 | Tyson Foods Inc 'A' | Morgan Stanley | 17.650 | (26.402) | UMH Properties Inc (REIT) | HSBC | (6.369) |
| (2.366) | Tyson Foods Inc 'A' | Morgan Stanley | (4.685) | (14.579) | UMH Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (1.365) |
| (13.430) | Uber Technologies Inc | Bank of America | | 14.576 | Umpqua Holdings Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.992) | | | Merrill Lynch | 12.214 |
| (8.879) | Uber Technologies Inc | Barclays Bank | 2.308 | 55.211 | Umpqua Holdings Corp | Barclays Bank | 22.637 |
| (24.137) | Uber Technologies Inc | Goldman Sachs | 1.689 | 47.469 | Umpqua Holdings Corp | Goldman Sachs | 44.598 |
| (14.171) | Uber Technologies Inc | HSBC | (6.660) | 49.658 | Umpqua Holdings Corp | HSBC | 18.157 |
| (13.064) | Uber Technologies Inc | Morgan Stanley | 3.397 | 1.221 | Under Armour Inc 'A' | Bank of America | |
| (2.432) | Ubiquiti Inc | Barclays Bank | (28.843) | | | Merrill Lynch | (733) |
| (711) | Ubiquiti Inc | Goldman Sachs | (18.528) | 35.077 | Under Armour Inc 'A' | Barclays Bank | 22.098 |
| (5.561) | Udemy Inc | Barclays Bank | (15.849) | 19.400 | Under Armour Inc 'A' | Goldman Sachs | (11.640) |
| (4.279) | Udemy Inc | HSBC | (14.078) | 42.040 | Under Armour Inc 'A' | HSBC | (420) |
| (2.348) | Udemy Inc | Morgan Stanley | (6.692) | 23.189 | Under Armour Inc 'A' | Morgan Stanley | 14.609 |
| 8.643 | UDR Inc (REIT) | Bank of America | | 1.180 | Unifi Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.895) | | | Merrill Lynch | 1.581 |
| 68.922 | UDR Inc (REIT) | Barclays Bank | 6.736 | 10.960 | Unifi Inc | Barclays Bank | 14.686 |
| 33.449 | UDR Inc (REIT) | Goldman Sachs | (10.035) | 618 | Unifi Inc | Goldman Sachs | 828 |
| 20.208 | UDR Inc (REIT) | HSBC | 10.032 | 9.926 | Unifi Inc | HSBC | 20.348 |
| 19.293 | UDR Inc (REIT) | Morgan Stanley | 2.508 | (4.638) | UniFirst Corp | Barclays Bank | (11.549) |
| (721) | UFP Industries Inc | Bank of America | | (2.143) | UniFirst Corp | Goldman Sachs | 2.743 |
| | | Merrill Lynch | (1.601) | (3.477) | UniFirst Corp | HSBC | 15.786 |
| 1.014 | UFP Industries Inc | Bank of America | | (1.529) | UniFirst Corp | Morgan Stanley | (3.807) |
| | | Merrill Lynch | (984) | (2.465) | Union Bankshares Inc | Bank of America | |
| (1.636) | UFP Industries Inc | Barclays Bank | (2.814) | | | Merrill Lynch | (1.602) |
| 11.858 | UFP Industries Inc | Barclays Bank | 20.396 | 938 | Union Pacific Corp | Bank of America | |
| (3.734) | UFP Industries Inc | Goldman Sachs | 3.142 | | | Merrill Lynch | (6.472) |
| 16.838 | UFP Industries Inc | Goldman Sachs | (17.900) | (2.020) | Union Pacific Corp | Barclays Bank | (7.503) |
| 12.642 | UFP Industries Inc | HSBC | (29.278) | (15.840) | Union Pacific Corp | Goldman Sachs | 109.296 |
| 1.720 | UFP Technologies Inc | Barclays Bank | 6.966 | 1.599 | Union Pacific Corp | Goldman Sachs | (11.033) |
| 718 | UFP Technologies Inc | Goldman Sachs | (122) | 5.418 | Union Pacific Corp | HSBC | (23.081) |
| 2.606 | UFP Technologies Inc | HSBC | 12.326 | (2.642) | Union Pacific Corp | Morgan Stanley | (3.543) |
| (20.901) | UGI Corp | Bank of America | | 430 | Union Pacific Corp | Morgan Stanley | 1.763 |
| | | Merrill Lynch | (54.343) | (15.748) | Unisys Corp | Goldman Sachs | (630) |
| (11.268) | UGI Corp | Barclays Bank | (14.986) | (22.044) | United Airlines Holdings Inc | Barclays Bank | (50.040) |
| (39.822) | UGI Corp | Goldman Sachs | (103.537) | (4.855) | United Airlines Holdings Inc | Goldman Sachs | (13.715) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (25.124) | United Airlines Holdings Inc | HSBC | (89.829) | (1.233) | Unitil Corp | Barclays Bank | (382) |
| (62.346) | United Bankshares Inc | Barclays Bank | (44.890) | (2.567) | Unitil Corp | Goldman Sachs | (5.391) |
| (63.714) | United Bankshares Inc | Goldman Sachs | (155.462) | (5.376) | Unitil Corp | HSBC | (9.414) |
| (46.388) | United Bankshares Inc | HSBC | (99.270) | (1.749) | Unitil Corp | Morgan Stanley | (542) |
| (2.311) | United Bankshares Inc | Morgan Stanley | (1.664) | 6.399 | Unity Bancorp Inc | Bank of America | |
| (69.628) | United Community Banks Inc | Barclays Bank | (58.488) | 4.869 | Unity Bancorp Inc | Merrill Lynch | 2.944 |
| (33.940) | United Community Banks Inc | Barclays Bank | (58.488) | 12.010 | Unity Bancorp Inc | Barclays Bank | 2.873 |
| 1.689 | United Fire Group Inc | HSBC | (39.710) | 9.580 | Unity Bancorp Inc | Goldman Sachs | 5.525 |
| 10.131 | United Fire Group Inc | Barclays Bank | 2.179 | (3.620) | Unity Bancorp Inc | Morgan Stanley | 5.652 |
| 4.755 | United Fire Group Inc | Goldman Sachs | 14.183 | | Unity Software Inc | Bank of America | |
| 5.903 | United Fire Group Inc | HSBC | 4.470 | (11.644) | Unity Software Inc | Merrill Lynch | (14.951) |
| 63.768 | United Insurance Holdings Corp | Morgan Stanley | 7.615 | (5.552) | Unity Software Inc | Barclays Bank | 8.849 |
| 7.565 | United Insurance Holdings Corp | Barclays Bank | 2.551 | (1.215) | Univar Solutions Inc | HSBC | (34.192) |
| 39.051 | United Insurance Holdings Corp | Barclays Bank | 2.551 | 8.396 | Univar Solutions Inc | Bank of America | |
| 34.844 | United Insurance Holdings Corp | Goldman Sachs | 151 | (12.463) | Univar Solutions Inc | Merrill Lynch | (3.256) |
| (2.897) | United Natural Foods Inc | HSBC | (21.478) | 21.754 | Univar Solutions Inc | Barclays Bank | 16.288 |
| (7.145) | United Natural Foods Inc | HSBC | (21.478) | (16.636) | Univar Solutions Inc | Goldman Sachs | (24.178) |
| (3.247) | United Natural Foods Inc | Morgan Stanley | 1.394 | 17.960 | Univar Solutions Inc | Goldman Sachs | 58.301 |
| (550) | United Natural Foods Inc | Bank of America | (3.911) | 14.520 | Univar Solutions Inc | HSBC | (44.584) |
| (651) | United Natural Foods Inc | Merrill Lynch | (3.911) | (4.843) | Univar Solutions Inc | Morgan Stanley | 43.822 |
| (1.427) | United Parcel Service Inc 'B' | Barclays Bank | (33.939) | (2.165) | Universal Corp | Morgan Stanley | 28.169 |
| 6.303 | United Parcel Service Inc 'B' | Barclays Bank | (33.939) | (5.224) | Universal Corp | Morgan Stanley | (9.395) |
| (1.057) | United Parcel Service Inc 'B' | Goldman Sachs | (5.488) | (1.436) | Universal Corp | Bank of America | |
| 503 | United Parcel Service Inc 'B' | HSBC | (235) | (3.464) | Universal Corp | Merrill Lynch | (2.338) |
| (1.164) | United Parcel Service Inc 'B' | Morgan Stanley | (3.092) | (38.350) | Universal Corp | Barclays Bank | (11.806) |
| 4.841 | United Parcel Service Inc 'B' | Bank of America | (2.291) | (207) | Universal Display Corp | Goldman Sachs | (1.551) |
| 5.824 | United Parcel Service Inc 'B' | Merrill Lynch | (2.291) | (1.952) | Universal Display Corp | HSBC | (15.242) |
| (2.089) | United Parcel Service Inc 'B' | Barclays Bank | 32.713 | 1.892 | Universal Display Corp | Morgan Stanley | (86.671) |
| 3.208 | United Rentals Inc | Barclays Bank | (5.486) | (2.045) | Universal Display Corp | Bank of America | |
| 1.283 | United Rentals Inc | Goldman Sachs | 5.204 | 645 | Universal Display Corp | Merrill Lynch | (683) |
| 6.456 | United Rentals Inc | HSBC | 221 | (275) | Universal Display Corp | Barclays Bank | (8.960) |
| 2.110 | United Rentals Inc | Morgan Stanley | (3.829) | 1.281 | Universal Display Corp | Barclays Bank | 8.684 |
| 4.443 | United Rentals Inc | Morgan Stanley | 30.227 | (434) | Universal Display Corp | Goldman Sachs | (6.524) |
| 26.606 | United Security Bancshares | Bank of America | (10.842) | 3.320 | Universal Display Corp | Goldman Sachs | 2.559 |
| 15.122 | United Security Bancshares | Merrill Lynch | (10.842) | (457) | Universal Electronics Inc | HSBC | (1.144) |
| 16.729 | United Security Bancshares | Barclays Bank | 50.510 | (11.493) | Universal Health Realty Income Trust (REIT) | HSBC | 5.329 |
| 16.116 | United Security Bancshares | Barclays Bank | 25.134 | (20.727) | Universal Health Realty Income Trust (REIT) | Morgan Stanley | 688 |
| 64.731 | United States Cellular Corp | Goldman Sachs | 78.702 | (19.295) | Universal Health Realty Income Trust (REIT) | Barclays Bank | (764) |
| 33.140 | United States Cellular Corp | HSBC | 12.193 | (2.056) | Universal Health Services Inc 'B' | Bank of America | |
| 21.061 | United States Cellular Corp | Morgan Stanley | 85.393 | 345 | Universal Health Services Inc 'B' | Merrill Lynch | (1.120) |
| 25.467 | United States Cellular Corp | Barclays Bank | 6.918 | (8.532) | Universal Health Services Inc 'B' | Barclays Bank | (20.343) |
| (978) | United States Lime & Minerals Inc | Goldman Sachs | 4.083 | 1.135 | Universal Health Services Inc 'B' | Goldman Sachs | (50.781) |
| (791) | United States Lime & Minerals Inc | HSBC | 3.179 | (9.298) | Universal Health Services Inc 'B' | HSBC | (53.254) |
| (5.422) | United States Steel Corp | Morgan Stanley | (2.792) | 600 | Universal Health Services Inc 'B' | Morgan Stanley | (3.639) |
| (13.807) | United States Steel Corp | Bank of America | (8.128) | 1.716 | Universal Health Services Inc 'B' | Bank of America | |
| (10.045) | United States Steel Corp | Merrill Lynch | (8.128) | 13.054 | Universal Insurance Holdings Inc | Merrill Lynch | 1.565 |
| (22.094) | United States Steel Corp | Barclays Bank | (4.833) | 5.045 | Universal Insurance Holdings Inc | Barclays Bank | (18.258) |
| (12.387) | United States Steel Corp | Goldman Sachs | (4.833) | (1.247) | Universal Insurance Holdings Inc | Barclays Bank | 2.429 |
| 790 | United Therapeutics Corp | HSBC | 4.364 | (10.938) | Universal Logistics Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.440 |
| 3.463 | United Therapeutics Corp | Morgan Stanley | (4.335) | | Universal Logistics Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.962) |
| (830) | UnitedHealth Group Inc | Barclays Bank | (8.466) | | Universal Logistics Holdings Inc | HSBC | 4.378 |
| (5.320) | UnitedHealth Group Inc | Barclays Bank | (8.466) | | Universal Logistics Holdings Inc | HSBC | 5.744 |
| (7.477) | UnitedHealth Group Inc | Goldman Sachs | (69.479) | | Universal Logistics Holdings Inc | HSBC | 303 |
| (58.257) | Uniti Group Inc (REIT) | HSBC | (107.153) | | Universal Logistics Holdings Inc | Barclays Bank | (3.965) |
| (62.213) | Uniti Group Inc (REIT) | Goldman Sachs | (44.275) | | Universal Logistics Holdings Inc | Barclays Bank | (3.965) |
| (532) | Unitil Corp | HSBC | (49.770) | | Universal Logistics Holdings Inc | Goldman Sachs | (26.470) |
| | | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (1.117) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (14.919) | Universal Logistics Holdings Inc | HSBC | (71.014) | 19.100 | US Bancorp | HSBC | 63.215 |
| 3.266 | Universal Technical Institute Inc | Bank of America | 2.090 | 5.909 | US Bancorp | Morgan Stanley | 6.867 |
| 12.201 | Universal Technical Institute Inc | Merrill Lynch | 10.615 | (2.545) | US Foods Holding Corp | Bank of America | 2.392 |
| 30.115 | Universal Technical Institute Inc | Barclays Bank | 19.274 | (31.433) | US Foods Holding Corp | Merrill Lynch | (64.752) |
| 7.929 | Universal Technical Institute Inc | Goldman Sachs | 3.647 | (9.676) | US Foods Holding Corp | Barclays Bank | 9.095 |
| 17.679 | Universal Technical Institute Inc | HSBC | 15.381 | (15.404) | US Foods Holding Corp | Goldman Sachs | 27.589 |
| 24.733 | Univest Financial Corp | Morgan Stanley | 22.754 | 59.520 | US Oncology Inc | HSBC | (59) |
| 29.477 | Univest Financial Corp | Bank of America | 9.138 | 7.474 | US Oncology Inc | Merrill Lynch | — |
| 72.273 | Univest Financial Corp | Merrill Lynch | 66.491 | 41.718 | US Oncology Inc | Barclays Bank | (42) |
| 5.692 | Univest Financial Corp | Barclays Bank | 1.708 | 8.296 | US Oncology Inc | Goldman Sachs | — |
| 2.256 | Unum Group | HSBC | 3.709 | (283) | US Physical Therapy Inc | Morgan Stanley | (698) |
| 9.346 | Unum Group | Merrill Lynch | 10.280 | (6.423) | US Physical Therapy Inc | Bank of America | (32.500) |
| 23.189 | Unum Group | Barclays Bank | 36.556 | (457) | US Physical Therapy Inc | Barclays Bank | (4.949) |
| 9.065 | Unum Group | Goldman Sachs | 14.321 | (3.124) | US Silica Holdings Inc | Goldman Sachs | (6.404) |
| (5.591) | Upland Software Inc | HSBC | (1.000) | (16.604) | US Silica Holdings Inc | HSBC | (27.729) |
| (7.054) | Upland Software Inc | Bank of America | 564 | (4.085) | US Silica Holdings Inc | Morgan Stanley | (7.026) |
| (4.705) | Upland Software Inc | Merrill Lynch | (518) | (8.746) | US Xpress Enterprises Inc 'A' | Bank of America | 1.924 |
| 945 | Upstart Holdings Inc | Barclays Bank | (765) | (17.283) | US Xpress Enterprises Inc 'A' | Merrill Lynch | (691) |
| 784 | Upstart Holdings Inc | HSBC | 8.291 | (3.643) | USA Truck Inc | Barclays Bank | (3.461) |
| (10.356) | Upwork Inc | Barclays Bank | (6.939) | (1.034) | USA Truck Inc | Bank of America | (196) |
| (22.302) | Upwork Inc | Goldman Sachs | (43.712) | (3.909) | USA Truck Inc | Merrill Lynch | 3.714 |
| (18.808) | Upwork Inc | HSBC | (4.650) | (866) | USANA Health Sciences Inc | Bank of America | (1.282) |
| (69.845) | Uranium Energy Corp | Goldman Sachs | (30.732) | (437) | USANA Health Sciences Inc | Merrill Lynch | (1.363) |
| (40.578) | Uranium Energy Corp | HSBC | (16.231) | (2.606) | USANA Health Sciences Inc | Barclays Bank | (3.857) |
| (6.304) | Uranium Energy Corp | Morgan Stanley | (1.702) | (291) | USANA Health Sciences Inc | Goldman Sachs | 327 |
| (145.578) | Urban Edge Properties (REIT) | Barclays Bank | (132.476) | (2.296) | Utah Medical Products Inc | HSBC | (3.547) |
| (87.466) | Urban Edge Properties (REIT) | Goldman Sachs | 18.368 | (3.750) | Utah Medical Products Inc | Morgan Stanley | (2.681) |
| (7.539) | Urban Edge Properties (REIT) | HSBC | (4.825) | (7.924) | Utz Brands Inc | Bank of America | (3.559) |
| (6.764) | Urban Edge Properties (REIT) | Morgan Stanley | (6.155) | (12.392) | Utz Brands Inc | Merrill Lynch | (13.879) |
| (3.461) | Urban One Inc | Goldman Sachs | (2.423) | (17.399) | Utz Brands Inc | Barclays Bank | (5.337) |
| 20.841 | Urban Outfitters Inc | Bank of America | (35.847) | (19.706) | UWM Holdings Corp | Goldman Sachs | (1.478) |
| 21.543 | Urban Outfitters Inc | Merrill Lynch | 30.591 | (6.567) | UWM Holdings Corp | Barclays Bank | (493) |
| 19.924 | Urban Outfitters Inc | Barclays Bank | (34.269) | (39.294) | VAALCO Energy Inc | Morgan Stanley | (46.367) |
| 12.943 | Urban Outfitters Inc | HSBC | (28.709) | (21.548) | VAALCO Energy Inc | Barclays Bank | (24.996) |
| 6.733 | Urban Outfitters Inc | Morgan Stanley | 9.561 | (5.845) | VAALCO Energy Inc | Goldman Sachs | (6.897) |
| 13.775 | Ur-Energy Inc | Bank of America | 1.515 | (6.576) | VAALCO Energy Inc | Morgan Stanley | (7.628) |
| 21.782 | Ur-Energy Inc | Merrill Lynch | 1.307 | 1.153 | Vacasa Inc 'A' | Bank of America | (104) |
| 105.254 | Ur-Energy Inc | Barclays Bank | 11.578 | 11.118 | Vacasa Inc 'A' | Merrill Lynch | 1.445 |
| 25.000 | Ur-Energy Inc | Goldman Sachs | 2.500 | 5.069 | Vacasa Inc 'A' | Barclays Bank | (456) |
| 3.782 | UroGen Pharma Ltd | HSBC | (189) | 17.751 | Vacasa Inc 'A' | Goldman Sachs | (22.011) |
| 11.300 | UroGen Pharma Ltd | Barclays Bank | (1.469) | 1.660 | Vacasa Inc 'A' | HSBC | 216 |
| 12.971 | UroGen Pharma Ltd | Goldman Sachs | (649) | (11.224) | Vail Resorts Inc | Morgan Stanley | (112.913) |
| (49.310) | Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT) | Merrill Lynch | 1.515 | (8.337) | Vail Resorts Inc | Goldman Sachs | (155.318) |
| (66.832) | Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT) | Barclays Bank | (45.858) | (2.318) | Vail Resorts Inc | HSBC | (33.055) |
| (15.577) | Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (42.772) | 2.043 | Valaris Ltd | Bank of America | 4.134 |
| (17.205) | Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT) | HSBC | (10.125) | 5.929 | Valaris Ltd | Merrill Lynch | 16.572 |
| 12.822 | US Bancorp | Morgan Stanley | (16.001) | 2.289 | Valaris Ltd | Goldman Sachs | 4.859 |
| 27.852 | US Bancorp | Barclays Bank | 52.058 | 8.479 | Valaris Ltd | HSBC | 53.010 |
| 66.172 | US Bancorp | Merrill Lynch | 256.748 | 2.985 | Valaris Ltd | Morgan Stanley | 8.567 |
| | | Bank of America | | 635 | Valero Energy Corp | Barclays Bank | 6.610 |
| | | Merrill Lynch | | 1.695 | Valero Energy Corp | Goldman Sachs | 11.170 |
| | | Barclays Bank | | 751 | Valero Energy Corp | HSBC | 11.956 |
| | | Goldman Sachs | | 9.112 | Valero Energy Corp | Morgan Stanley | 94.856 |
| | | HSBC | | (4.085) | Valhi Inc | Bank of America | (39.257) |
| | | | | (962) | Valhi Inc | Merrill Lynch | (3.608) |
| | | | | (5.835) | Valhi Inc | Barclays Bank | (56.074) |
| | | | | (2.293) | Valhi Inc | Goldman Sachs | (28.777) |
| | | | | | | HSBC | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------|----------------------------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (786) | Valhi Inc | Morgan Stanley | (2.948) | (19.221) | Veeco Instruments Inc | Barclays Bank | (1.922) |
| (106.982) | Valley National Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (91.206) | (5.629) | Veeco Instruments Inc | Goldman Sachs | (1.226) |
| (138.758) | Valley National Bancorp | Barclays Bank | (42.939) | (3.315) | Veeco Instruments Inc | HSBC | (4.966) |
| (262.049) | Valley National Bancorp | Goldman Sachs | (237.839) | (6.230) | Veeco Instruments Inc | Morgan Stanley | (623) |
| (256.566) | Valley National Bancorp | HSBC | (193.233) | 1.004 | Veeva Systems Inc 'A' | Bank of America | |
| (50.903) | Valley National Bancorp | Morgan Stanley | (15.525) | (3.034) | Veeva Systems Inc 'A' | Merrill Lynch | 1.172 |
| (276) | Valmont Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.179) | 434 | Veeva Systems Inc 'A' | Barclays Bank | (16.080) |
| 2.067 | Valmont Industries Inc | Barclays Bank | 18.107 | (932) | Veeva Systems Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.855 |
| (2.601) | Valmont Industries Inc | Barclays Bank | (22.785) | 2.423 | Veeva Systems Inc 'A' | HSBC | (4.400) |
| 3.527 | Valmont Industries Inc | Goldman Sachs | 53.399 | 41.407 | Velo3D Inc | Morgan Stanley | 12.842 |
| (2.652) | Valmont Industries Inc | Goldman Sachs | (40.085) | 7.726 | Velo3D Inc | HSBC | (3.866) |
| 406 | Valmont Industries Inc | HSBC | 6.892 | 573 | Velocity Financial Inc | Morgan Stanley | 77 |
| (571) | Value Line Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.267 | 13.880 | Velocity Financial Inc | Bank of America | |
| (1.145) | Value Line Inc | HSBC | 1.924 | 15.185 | Velocity Financial Inc | Merrill Lynch | 17 |
| 11.081 | Valvoline Inc | Bank of America Merrill Lynch | 37.733 | (29.472) | Ventas Inc (REIT) | HSBC | 694 |
| (42.507) | Valvoline Inc | Barclays Bank | (143.249) | (30.729) | Ventas Inc (REIT) | Morgan Stanley | 7.744 |
| 8.370 | Valvoline Inc | Barclays Bank | 28.207 | (28.186) | Ventas Inc (REIT) | Barclays Bank | (27.706) |
| 1.071 | Valvoline Inc | Goldman Sachs | 3.600 | 4.134 | Ventyx Biosciences Inc | Goldman Sachs | (40.562) |
| 9.076 | Valvoline Inc | HSBC | 40.350 | 3.816 | Ventyx Biosciences Inc | HSBC | (35.514) |
| 2.974 | Valvoline Inc | Morgan Stanley | 10.022 | 2.816 | Ventyx Biosciences Inc | Barclays Bank | 3.803 |
| (2.183) | Vanda Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (633) | (67.959) | Venus Concept Inc | Goldman Sachs | 16.409 |
| (3.613) | Vanda Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (1.373) | (19.015) | Venus Concept Inc | Morgan Stanley | 2.591 |
| (28.481) | Vanda Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (8.259) | (30.542) | Vera Bradley Inc | Barclays Bank | (5.437) |
| (5.923) | Vanda Pharmaceuticals Inc | HSBC | (1.960) | (11.831) | Vera Bradley Inc | Goldman Sachs | 570 |
| (2.239) | Vanda Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 44 | (3.001) | Vera Bradley Inc | Barclays Bank | (12.217) |
| (6.885) | Vapotherm Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.102 | (2.144) | Vera Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.775) |
| (10.440) | Vapotherm Inc | Barclays Bank | (1.044) | (1.122) | Vera Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.200) |
| (17.068) | Vapotherm Inc | Goldman Sachs | 1.264 | 6.496 | Veracyte Inc | Barclays Bank | (1.822) |
| (4.954) | Vapotherm Inc | HSBC | (1.754) | 10.382 | Veracyte Inc | HSBC | 1.032 |
| 5.506 | Varex Imaging Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.273 | 4.480 | Veracyte Inc | Bank of America | |
| 12.575 | Varex Imaging Corp | Barclays Bank | 4.276 | 4.266 | Veracyte Inc | Merrill Lynch | 10.459 |
| 3.508 | Varex Imaging Corp | Goldman Sachs | 2.350 | 1.303 | Veracyte Inc | Barclays Bank | 2.596 |
| 9.186 | Varex Imaging Corp | HSBC | 12.753 | 14.088 | Verastem Inc | Goldman Sachs | 2.913 |
| 13.377 | Varex Imaging Corp | Morgan Stanley | 4.548 | 14.170 | Verastem Inc | HSBC | 7.213 |
| (2.415) | Varonis Systems Inc | Barclays Bank | (74) | 45.976 | Verastem Inc | HSBC | 5.077 |
| 17.904 | Varonis Systems Inc | Barclays Bank | (17.188) | 10.074 | Verastem Inc | Morgan Stanley | — |
| 7.735 | Varonis Systems Inc | Goldman Sachs | 20.575 | (3.394) | Vericel Corp | Barclays Bank | (713) |
| (1.846) | Varonis Systems Inc | Goldman Sachs | (4.910) | (6.943) | Vericel Corp | Goldman Sachs | 1.389 |
| 9.322 | Varonis Systems Inc | HSBC | 27.686 | (1.128) | Vericel Corp | HSBC | (1.561) |
| (7.183) | Varonis Systems Inc | HSBC | (20.495) | (1.155) | Vericel Corp | Morgan Stanley | (243) |
| (1.254) | Varonis Systems Inc | Morgan Stanley | 1.204 | 12.976 | Verint Systems Inc | Barclays Bank | 260 |
| (41.725) | Vaxart Inc | Barclays Bank | (12.935) | 28.242 | Verint Systems Inc | Goldman Sachs | (22.876) |
| (6.056) | Vaxart Inc | Goldman Sachs | (3.331) | 13.181 | Verint Systems Inc | HSBC | 4.747 |
| (14.997) | Vaxart Inc | HSBC | (7.798) | (13.425) | Veris Residential Inc (REIT) | Bank of America | |
| (1.461) | Vaxcyte Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.461) | (31.611) | Veris Residential Inc (REIT) | Merrill Lynch | (10.354) |
| (18.643) | Vaxcyte Inc | Barclays Bank | 19.016 | (3.638) | Veris Residential Inc (REIT) | Barclays Bank | (37.301) |
| (3.071) | Vaxcyte Inc | Goldman Sachs | (3.071) | (11.150) | Veris Residential Inc (REIT) | HSBC | (5.419) |
| (2.413) | Vaxcyte Inc | HSBC | (9.966) | (5.807) | VeriSign Inc | Morgan Stanley | (10.577) |
| (943) | Vaxcyte Inc | Morgan Stanley | 962 | (5.007) | VeriSign Inc | Bank of America | |
| (78.934) | VBI Vaccines Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9.883 | (1.235) | VeriSign Inc | Merrill Lynch | (51.973) |
| (107.240) | VBI Vaccines Inc | Barclays Bank | 1.812 | 2.442 | VeriSign Inc | Barclays Bank | (8.386) |
| (24.635) | VBI Vaccines Inc | Goldman Sachs | 3.084 | (4.665) | VeriSign Inc | Barclays Bank | 16.581 |
| (29.974) | VBI Vaccines Inc | HSBC | 4.352 | 2.677 | VeriSign Inc | Goldman Sachs | (41.752) |
| (26.947) | Vector Group Ltd | Barclays Bank | (10.509) | 2.677 | VeriSign Inc | Goldman Sachs | 24.711 |
| (43.755) | Vector Group Ltd | Goldman Sachs | 7.876 | 1.188 | VeriSign Inc | HSBC | 6.347 |
| 3.260 | Vectrus Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.141) | 1.250 | VeriSign Inc | Morgan Stanley | 8.488 |
| 7.890 | Vectrus Inc | Barclays Bank | (1.026) | (9.453) | Verisk Analytics Inc | Bank of America | |
| 20.781 | Vectrus Inc | Goldman Sachs | (7.273) | (4.500) | Verisk Analytics Inc | Merrill Lynch | (37.150) |
| (1.159) | Veeco Instruments Inc | Bank of America Merrill Lynch | (197) | (5.594) | Verisk Analytics Inc | Barclays Bank | (22.500) |
| | | | | (7.054) | Verisk Analytics Inc | Goldman Sachs | (21.984) |
| | | | | (4.400) | Verisk Analytics Inc | HSBC | 5.171 |
| | | | | (3.934) | Veritex Holdings Inc | Morgan Stanley | (22.000) |
| | | | | (1.996) | Veritex Holdings Inc | Bank of America | |
| | | | | (2.378) | Veritex Holdings Inc | Merrill Lynch | (6.406) |
| | | | | | Veritex Holdings Inc | Barclays Bank | (2.398) |
| | | | | | | Goldman Sachs | (4.875) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (9.324) | Veritex Holdings Inc | HSBC | (14.457) | 1.454 | Viant Technology Inc 'A' | Barclays Bank | 349 |
| (3.902) | Veritex Holdings Inc | Morgan Stanley | (5.541) | 14.621 | Viant Technology Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.070 |
| (199) | Veritiv Corp | Bank of America | | 3.526 | Viant Technology Inc 'A' | HSBC | 1.975 |
| | | Merrill Lynch | (1.223) | 1.895 | Viant Technology Inc 'A' | Morgan Stanley | 455 |
| (1.675) | Veritiv Corp | Barclays Bank | (15.326) | 2.015 | Viasat Inc | Bank of America | |
| (1.033) | Veritiv Corp | Goldman Sachs | 3.264 | | | Merrill Lynch | 659 |
| (14.271) | Veritone Inc | Barclays Bank | (3.425) | (8.086) | Viasat Inc | Goldman Sachs | (22.964) |
| (14.195) | Veritone Inc | Goldman Sachs | (3.957) | 1.129 | Viasat Inc | Goldman Sachs | 3.206 |
| (35.524) | Verizon | | | (1.506) | Viasat Inc | HSBC | (5.226) |
| | Communications Inc | Barclays Bank | (49.911) | 1.123 | Viasat Inc | HSBC | 824 |
| 37.706 | Verizon | | | 3.243 | Viasat Inc | Morgan Stanley | 162 |
| | Communications Inc | Barclays Bank | 52.977 | 35.383 | Viatris Inc | Bank of America | |
| (63.482) | Verizon | | | | | Merrill Lynch | 32.906 |
| | Communications Inc | Goldman Sachs | (129.186) | 68.051 | Viatris Inc | Barclays Bank | 29.942 |
| (17.956) | Verra Mobility Corp | Bank of America | | 45.202 | Viatris Inc | Goldman Sachs | 42.038 |
| | | Merrill Lynch | (17.597) | 41.971 | Viatris Inc | Morgan Stanley | 18.467 |
| (17.171) | Verra Mobility Corp | Barclays Bank | (8.586) | 9.849 | Viavi Solutions Inc | Bank of America | |
| (33.857) | Verra Mobility Corp | Goldman Sachs | (33.180) | | | Merrill Lynch | 1.862 |
| (15.525) | Verra Mobility Corp | HSBC | (49.680) | 69.163 | Viavi Solutions Inc | Barclays Bank | 19.020 |
| (5.868) | Verra Mobility Corp | Morgan Stanley | (2.934) | 50.340 | Viavi Solutions Inc | Goldman Sachs | 16.841 |
| (4.709) | Verrica Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | 3.585 | Viavi Solutions Inc | HSBC | 684 |
| | | Merrill Lynch | 19.166 | 10.342 | Viavi Solutions Inc | Morgan Stanley | 2.535 |
| (3.298) | Verrica Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 14.247 | (199.363) | VICI Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (303.032) |
| (10.174) | Verrica Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 41.408 | (101.061) | VICI Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (168.772) |
| (2.085) | Verrica Pharmaceuticals Inc | HSBC | 8.549 | (22.309) | VICI Properties Inc (REIT) | HSBC | (76.520) |
| (2.050) | Verrica Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 8.856 | (2.631) | VICI Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (3.999) |
| 9.512 | Vertex Energy Inc | Barclays Bank | 3.995 | (695) | Vicor Corp | Bank of America | |
| 1.532 | Vertex Inc 'A' | Barclays Bank | (1.210) | (2.930) | Vicor Corp | Merrill Lynch | (7.506) |
| 1.517 | Vertex Inc 'A' | HSBC | (2.063) | (8.823) | Vicor Corp | Barclays Bank | (17.170) |
| (3.394) | Vertex Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | (2.992) | Victoria's Secret & Co | Goldman Sachs | (95.288) |
| | | Merrill Lynch | (47.855) | | | Bank of America | |
| (845) | Vertex Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (11.915) | (7.374) | Victoria's Secret & Co | Merrill Lynch | 18.461 |
| (2.853) | Vertex Pharmaceuticals Inc | HSBC | (94.862) | (4.029) | Victoria's Secret & Co | Barclays Bank | 12.093 |
| (184) | Vertex Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 15 | (4.873) | Victoria's Secret & Co | Goldman Sachs | 24.859 |
| (86.572) | Vertiv Holdings Co | Barclays Bank | (38.958) | (3.838) | Victoria's Secret & Co | HSBC | 25.974 |
| (30.450) | Vertiv Holdings Co | Goldman Sachs | (13.702) | (24.716) | Viemed Healthcare Inc | Morgan Stanley | 6.294 |
| (4.449) | Vertiv Holdings Co | HSBC | (356) | (40.677) | View Inc | Barclays Bank | (5.190) |
| (5.179) | Vertiv Holdings Co | Morgan Stanley | (2.331) | (22.812) | View Inc | Barclays Bank | (10.718) |
| (5.198) | Verve Therapeutics Inc | Barclays Bank | (7.641) | 27.678 | ViewRay Inc | Goldman Sachs | (14.465) |
| (1.605) | Verve Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (2.584) | 44.101 | ViewRay Inc | Barclays Bank | 2.214 |
| (6.312) | VF Corp | Bank of America | | 38.590 | ViewRay Inc | Goldman Sachs | (3.087) |
| | | Merrill Lynch | (20.813) | (41.907) | Viking Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 3.087 |
| (5.592) | VF Corp | Barclays Bank | (17.524) | (8.982) | Village Super Market Inc 'A' | Barclays Bank | (1.886) |
| 37.449 | VF Corp | Barclays Bank | 144.553 | | | Bank of America | |
| (3.278) | VF Corp | Goldman Sachs | (1.653) | (28.740) | Village Super Market Inc 'A' | Merrill Lynch | (898) |
| 9.261 | VF Corp | Goldman Sachs | 31.117 | (19.625) | Village Super Market Inc 'A' | Barclays Bank | (36.500) |
| (929) | VF Corp | HSBC | (2.620) | (5.390) | Village Super Market Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.963) |
| (2.417) | VF Corp | Morgan Stanley | (9.330) | (8.139) | Village Super Market Inc 'A' | HSBC | (3.504) |
| (5.501) | Via Renewables Inc | Bank of America | | 4.291 | Vimeo Inc | Morgan Stanley | (10.337) |
| | | Merrill Lynch | (2.695) | 6.714 | Vimeo Inc | Bank of America | |
| (21.138) | Via Renewables Inc | Barclays Bank | (3.805) | 7.965 | Vimeo Inc | Merrill Lynch | (2.043) |
| (17.716) | Via Renewables Inc | HSBC | (14.704) | 11.149 | Vimeo Inc | Barclays Bank | (269) |
| (909) | Via Renewables Inc | Morgan Stanley | (164) | 16.314 | Vimeo Inc | Goldman Sachs | (1.513) |
| 8.201 | ViacomCBS Inc 'A' | Bank of America | | (11.185) | Vince Holding Corp | HSBC | 1.535 |
| | | Merrill Lynch | 50.682 | (13.891) | Vince Holding Corp | Morgan Stanley | (268) |
| 5.548 | ViacomCBS Inc 'A' | Barclays Bank | 4.106 | 8.005 | Vincerx Pharma Inc | Barclays Bank | 4.635 |
| 3.020 | ViacomCBS Inc 'A' | Goldman Sachs | 18.664 | | | Morgan Stanley | 5.756 |
| 9.326 | ViacomCBS Inc 'A' | HSBC | 61.645 | 7.347 | Vincerx Pharma Inc | Bank of America | (3.202) |
| 3.394 | ViacomCBS Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.512 | 1.242 | Vincerx Pharma Inc | Merrill Lynch | (367) |
| (2.031) | ViacomCBS Inc 'B' | Bank of America | | 1.398 | Vincerx Pharma Inc | Barclays Bank | (497) |
| | | Merrill Lynch | (2.897) | 12.191 | Vincerx Pharma Inc | HSBC | (769) |
| 1.917 | ViacomCBS Inc 'B' | Goldman Sachs | 4.509 | 21.645 | Vintage Wine Estates Inc | Morgan Stanley | (610) |
| (5.522) | ViacomCBS Inc 'B' | HSBC | (35.893) | 4.999 | Vintage Wine Estates Inc | Barclays Bank | 17.532 |
| 4.029 | ViacomCBS Inc 'B' | HSBC | 19.459 | 10.166 | Vintage Wine Estates Inc | Goldman Sachs | 500 |
| (2.047) | Viad Corp | Bank of America | | 3.634 | Vir Biotechnology Inc | HSBC | (610) |
| | | Merrill Lynch | (1.872) | (1.252) | Vir Biotechnology Inc | Barclays Bank | 7.813 |
| (4.174) | Viad Corp | Barclays Bank | 914 | (5.913) | Vir Biotechnology Inc | Barclays Bank | (2.692) |
| (5.311) | Viad Corp | Goldman Sachs | 212 | | | Goldman Sachs | (23.711) |
| (9.807) | Viad Corp | HSBC | (7.483) | | | | |
| (1.162) | Viad Corp | Morgan Stanley | 198 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 3.651 | Vir Biotechnology Inc | HSBC | 20.701 | (12.107) | Vontier Corp | Barclays Bank | 11.381 |
| (1.248) | Vir Biotechnology Inc | HSBC | (7.076) | (68.454) | Vontier Corp | Goldman Sachs | (10.399) |
| 2.668 | Viracta Therapeutics Inc | Barclays Bank | — | (31.875) | Vontier Corp | HSBC | (5.925) |
| 300 | Viracta Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (9) | (4.815) | Vontier Corp | Morgan Stanley | 4.526 |
| 14.411 | Virgin Galactic Holdings Inc | Bank of America | | 2.356 | Vor BioPharma Inc | Goldman Sachs | 565 |
| | | Merrill Lynch | 11.961 | (5.201) | Vornado Realty Trust (REIT) | Bank of America | |
| 9.185 | Virgin Galactic Holdings Inc | Barclays Bank | 4.317 | | | Merrill Lynch | (613) |
| (44.048) | Virgin Galactic Holdings Inc | Goldman Sachs | (36.560) | (30.257) | Vornado Realty Trust (REIT) | Barclays Bank | (29.955) |
| 16.075 | Virgin Galactic Holdings Inc | HSBC | 15.432 | (13.427) | Vornado Realty Trust (REIT) | Goldman Sachs | (4.834) |
| 2.091 | Viridian Therapeutics Inc | Bank of America | | (69.917) | Vornado Realty Trust (REIT) | HSBC | 35.658 |
| | | Merrill Lynch | (2.300) | (3.706) | VOXX International Corp | Bank of America | |
| 1.190 | Viridian Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.309) | | | Merrill Lynch | (7.041) |
| 4.495 | Viridian Therapeutics Inc | HSBC | 7.952 | (14.575) | VOXX International Corp | Barclays Bank | (10.494) |
| (159.679) | VirnetX Holding Corp | Goldman Sachs | (22.355) | (2.100) | VOXX International Corp | Goldman Sachs | (3.990) |
| 4.597 | Virtu Financial Inc 'A' | Bank of America | | (3.911) | VOXX International Corp | HSBC | (6.531) |
| | | Merrill Lynch | (1.057) | 47.030 | Voya Financial Inc | Barclays Bank | 157.080 |
| (19.898) | Virtu Financial Inc 'A' | Barclays Bank | 5.173 | 39.475 | Voya Financial Inc | Goldman Sachs | 235.271 |
| (12.745) | Virtu Financial Inc 'A' | HSBC | 9.431 | 39.744 | Voya Financial Inc | HSBC | 200.310 |
| 7.979 | Virtu Financial Inc 'A' | HSBC | (5.904) | 6.882 | Voyager Therapeutics Inc | Bank of America | |
| 655 | Virtus Investment Partners Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (3.303) |
| | | Merrill Lynch | 12.157 | 7.466 | Voyager Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (3.584) |
| 3.064 | Virtus Investment Partners Inc | Barclays Bank | 31.192 | 3.649 | Voyager Therapeutics Inc | HSBC | 2.846 |
| 935 | Virtus Investment Partners Inc | Goldman Sachs | 19.934 | 76.843 | Vroom Inc | Bank of America | |
| 982 | Virtus Investment Partners Inc | HSBC | 22.790 | 51.480 | Vroom Inc | Merrill Lynch | (5.763) |
| 221 | Virtus Investment Partners Inc | Morgan Stanley | 2.250 | 182.281 | Vroom Inc | Barclays Bank | 257 |
| 2.502 | Visa Inc 'A' | Barclays Bank | 11.584 | 91.159 | Vroom Inc | Goldman Sachs | (13.671) |
| 3.986 | Visa Inc 'A' | Goldman Sachs | 55.520 | 54.941 | Vroom Inc | HSBC | 28.715 |
| 12.841 | Visa Inc 'A' | Morgan Stanley | 59.454 | (2.766) | VSE Corp | Morgan Stanley | 274 |
| 19.125 | Vishay Intertechnology Inc | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 15.682 | 2.455 | Vulcan Materials Co | Bank of America | |
| 49.092 | Vishay Intertechnology Inc | Barclays Bank | 22.582 | | | Merrill Lynch | 10.540 |
| 82.326 | Vishay Intertechnology Inc | Goldman Sachs | 67.507 | (1.490) | Vulcan Materials Co | Bank of America | |
| 69.178 | Vishay Intertechnology Inc | HSBC | 98.925 | | | Merrill Lynch | (6.198) |
| 2.531 | Vishay Intertechnology Inc | Morgan Stanley | 1.164 | 17.592 | Vulcan Materials Co | Barclays Bank | 9.852 |
| (723) | Vishay Precision Group Inc | Bank of America | | (11.809) | Vulcan Materials Co | Barclays Bank | (2.547) |
| | | Merrill Lynch | 586 | (3.179) | Vulcan Materials Co | Goldman Sachs | (13.319) |
| (14.744) | Vishay Precision Group Inc | Barclays Bank | (7.962) | 1.503 | Vulcan Materials Co | HSBC | 2.285 |
| (18.491) | Vishay Precision Group Inc | Goldman Sachs | 14.978 | (3.862) | Vulcan Materials Co | HSBC | (5.870) |
| (6.640) | Vishay Precision Group Inc | HSBC | (2.656) | 23.960 | Vulcan Materials Co | Morgan Stanley | 13.418 |
| (25.256) | VistaGen Therapeutics Inc | Bank of America | | (2.762) | Vulcan Materials Co | Morgan Stanley | (4.347) |
| | | Merrill Lynch | 2.652 | (8.953) | VYNE Therapeutics Inc | Barclays Bank | 123 |
| (80.551) | VistaGen Therapeutics Inc | Barclays Bank | (3.625) | (49.252) | VYNE Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 527 |
| (19.547) | VistaGen Therapeutics Inc | HSBC | 1.857 | 16.085 | W R Berkley Corp | Barclays Bank | 41.499 |
| 1.721 | Visteon Corp | Bank of America | | 66.277 | W R Berkley Corp | Goldman Sachs | 180.284 |
| | | Merrill Lynch | 10.670 | 14.454 | W R Berkley Corp | HSBC | 46.108 |
| 2.618 | Visteon Corp | Goldman Sachs | 16.232 | 92.752 | W&T Offshore Inc | Goldman Sachs | 117.795 |
| 575 | Visteon Corp | HSBC | 4.560 | 5.955 | Wabash National Corp | Bank of America | |
| 1.493 | Visteon Corp | Morgan Stanley | 5.479 | | | Merrill Lynch | 4.347 |
| 84.083 | Vistra Corp | Goldman Sachs | 97.536 | 2.853 | Wabash National Corp | Barclays Bank | 1.084 |
| (9.217) | Vistra Corp | Goldman Sachs | (10.692) | 25.030 | Wabash National Corp | Goldman Sachs | 18.272 |
| 7.320 | Vistra Corp | HSBC | 21.503 | 34.632 | Wabash National Corp | HSBC | 24.738 |
| 18.510 | Vita Coco Co Inc | Barclays Bank | 20.731 | 4.516 | Wabash National Corp | Morgan Stanley | 1.716 |
| 32.067 | Vital Farms Inc | Barclays Bank | (10.582) | (26.281) | Waitr Holdings Inc | Goldman Sachs | 618 |
| 6.515 | Vital Farms Inc | Goldman Sachs | 3.779 | (7.617) | Walgreens Boots Alliance Inc | Bank of America | |
| 13.677 | Vital Farms Inc | HSBC | (26.123) | | | Merrill Lynch | 3.462 |
| 165 | Vital Farms Inc | Morgan Stanley | (54) | (32.916) | Walgreens Boots Alliance Inc | Barclays Bank | (37.312) |
| (7.171) | Vivid Seats Inc 'A' | Barclays Bank | (10.039) | (17.135) | Walgreens Boots Alliance Inc | Goldman Sachs | 13.833 |
| (8.753) | Vivid Seats Inc 'A' | HSBC | (4.464) | (20.415) | Walgreens Boots Alliance Inc | HSBC | 7.962 |
| (15.289) | Vivint Smart Home Inc | Barclays Bank | (612) | (19.688) | Walgreens Boots Alliance Inc | Morgan Stanley | (19.139) |
| (11.912) | Vivint Smart Home Inc | Goldman Sachs | (2.740) | | | Goldman Sachs | 34.241 |
| (1.868) | VMware Inc 'A' | Barclays Bank | (18.157) | 5.924 | Walker & Dunlop Inc | Goldman Sachs | |
| (5.325) | VMware Inc 'A' | Goldman Sachs | (152.029) | 834 | Walker & Dunlop Inc | HSBC | 4.846 |
| (45.340) | Volta Inc | Barclays Bank | (9.068) | | | | |
| (13) | Volta Inc | HSBC | (7) | | | | |
| (8.664) | Vontier Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (1.473) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (41) | Walmart Inc | Bank of America | | 2.581 | Watsco Inc | Barclays Bank | 11.847 |
| | | Merrill Lynch | 825 | 6.733 | Watsco Inc | Goldman Sachs | (41.542) |
| 1.039 | Walmart Inc | Barclays Bank | 5.704 | 4.449 | Watsco Inc | HSBC | (10.677) |
| 14.782 | Walmart Inc | Goldman Sachs | (192.178) | 729 | Watsco Inc | Morgan Stanley | 3.346 |
| (12.326) | Walmart Inc | Goldman Sachs | 190.488 | 1.403 | Watts Water Technologies Inc 'A' | Bank of America | |
| (3.635) | Walmart Inc | HSBC | 55.170 | 8.872 | Watts Water Technologies Inc 'A' | Merrill Lynch | 1.038 |
| 3.627 | Walmart Inc | Morgan Stanley | 19.912 | | | | |
| (1.431) | Walmart Inc | Morgan Stanley | (7.856) | 5.409 | Watts Water Technologies Inc 'A' | Barclays Bank | 41.081 |
| 10.796 | Walt Disney Co | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 6.594 | 1.426 | Watts Water Technologies Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.203 |
| 4.210 | Walt Disney Co | Barclays Bank | 12.251 | | | | |
| (9.481) | Walt Disney Co | Goldman Sachs | (33.752) | 371 | Watts Water Technologies Inc 'A' | HSBC | 111 |
| (9.035) | Walt Disney Co | HSBC | (15.902) | | | | |
| (11.404) | Walt Disney Co | Morgan Stanley | (33.186) | (12.530) | WaVe Life Sciences Ltd | Morgan Stanley | 1.710 |
| 2.324 | Walt Disney Co | Morgan Stanley | 6.763 | (3.055) | WaVe Life Sciences Ltd | Barclays Bank | (2.506) |
| (34.459) | Warby Parker Inc 'A' | Bank of America | | (2.953) | WaVe Life Sciences Ltd | Goldman Sachs | (672) |
| | | Merrill Lynch | (24.122) | (2.691) | Wayfair Inc 'A' | Morgan Stanley | (591) |
| (2.479) | Warner Music Group Corp 'A' | Barclays Bank | (99) | | | Bank of America | |
| (9.599) | Warner Music Group Corp 'A' | Goldman Sachs | (4.128) | (1.848) | Wayfair Inc 'A' | Merrill Lynch | (14.989) |
| 4.405 | Warner Music Group Corp 'A' | Goldman Sachs | 1.894 | (1.509) | Wayfair Inc 'A' | Goldman Sachs | (10.293) |
| (9.540) | Warner Music Group Corp 'A' | HSBC | (24.506) | 3.547 | Wayfair Inc 'A' | HSBC | 9.009 |
| (6.004) | Warner Music Group Corp 'A' | Morgan Stanley | (240) | (294) | WD-40 Co | Morgan Stanley | 21.850 |
| (4.642) | Warrior Met Coal Inc | Barclays Bank | (3.296) | (3.774) | WD-40 Co | Bank of America | |
| (6.008) | Warrior Met Coal Inc | Goldman Sachs | (9.312) | (1.989) | WD-40 Co | Merrill Lynch | (544) |
| (72.558) | Washington (REIT) | Goldman Sachs | (91.423) | (1.677) | WD-40 Co | Barclays Bank | (18.455) |
| 2.738 | Washington Federal Inc | Bank of America | | (3.569) | Weave Communications Inc | Goldman Sachs | (3.679) |
| | | Merrill Lynch | 4.819 | (6.584) | Webster Financial Corp | HSBC | 20.263 |
| 29.030 | Washington Federal Inc | Barclays Bank | 28.159 | | | Morgan Stanley | (8.200) |
| 54.027 | Washington Federal Inc | Goldman Sachs | 95.088 | (24.766) | Webster Financial Corp | Barclays Bank | (39.378) |
| 44.724 | Washington Federal Inc | HSBC | 67.980 | (47.034) | Webster Financial Corp | Goldman Sachs | (97.361) |
| 6.094 | Washington Federal Inc | Morgan Stanley | 5.911 | (13.249) | Webster Financial Corp | HSBC | (16.164) |
| 1.555 | Washington Trust Bancorp Inc | Bank of America | | (17.784) | Webster Financial Corp | Morgan Stanley | (28.276) |
| | | Merrill Lynch | 4.223 | (1.439) | WEC Energy Group Inc | Bank of America | |
| 13.609 | Washington Trust Bancorp Inc | Barclays Bank | 23.238 | (25.837) | WEC Energy Group Inc | Merrill Lynch | (3.151) |
| 452 | Washington Trust Bancorp Inc | Goldman Sachs | 1.067 | 8.838 | WEC Energy Group Inc | Barclays Bank | 1.550 |
| 1.198 | Washington Trust Bancorp Inc | HSBC | 3.882 | (23.863) | WEC Energy Group Inc | Barclays Bank | (530) |
| 28.431 | Washington Trust Bancorp Inc | Morgan Stanley | 50.303 | 4.693 | WEC Energy Group Inc | Goldman Sachs | (52.260) |
| 40.788 | Waste Connections Inc | Barclays Bank | 75.866 | (21.293) | WEC Energy Group Inc | Goldman Sachs | 7.957 |
| 7.027 | Waste Connections Inc | Goldman Sachs | 6.043 | 2.642 | WEC Energy Group Inc | HSBC | (64.305) |
| 16.734 | Waste Connections Inc | HSBC | 80.323 | (16.207) | WEC Energy Group Inc | HSBC | (2.075) |
| 4.173 | Waste Connections Inc | Morgan Stanley | 7.762 | (4.100) | WEC Energy Group Inc | Morgan Stanley | 972 |
| (386) | Waste Management Inc | Bank of America | | (7.434) | Weis Markets Inc | Barclays Bank | 3.444 |
| | | Merrill Lynch | (455) | (1.540) | Weis Markets Inc | Goldman Sachs | 53.079 |
| (8.918) | Waste Management Inc | Barclays Bank | (19.838) | (346) | Weis Markets Inc | HSBC | 17.094 |
| (20.408) | Waste Management Inc | Goldman Sachs | (24.831) | 2.127 | Wells Fargo & Co | Morgan Stanley | 563 |
| (1.535) | Waste Management Inc | HSBC | (3.735) | (9.048) | Wells Fargo & Co | Bank of America | |
| (7.951) | Waste Management Inc | Morgan Stanley | (17.717) | 7.748 | Wells Fargo & Co | Merrill Lynch | 7.700 |
| 1.218 | Waters Corp | Bank of America | | (21.975) | Wells Fargo & Co | Barclays Bank | (18.186) |
| | | Merrill Lynch | 6.550 | 14.960 | Wells Fargo & Co | Barclays Bank | 15.573 |
| 1.086 | Waters Corp | Barclays Bank | 7.743 | 4.915 | Wells Fargo & Co | Goldman Sachs | (79.550) |
| 1.044 | Waters Corp | Goldman Sachs | 7.402 | (2.826) | Welltower Inc (REIT) | Goldman Sachs | 51.864 |
| 2.099 | Waters Corp | HSBC | 23.097 | (16.596) | Welltower Inc (REIT) | HSBC | 18.325 |
| 57 | Waters Corp | Morgan Stanley | 406 | (18.988) | Welltower Inc (REIT) | Bank of America | |
| (3.243) | Waterstone Financial Inc | Bank of America | | (22.216) | Welltower Inc (REIT) | Merrill Lynch | (1.159) |
| | | Merrill Lynch | (2.984) | (901) | Welltower Inc (REIT) | Barclays Bank | (25.643) |
| (18.280) | Waterstone Financial Inc | Barclays Bank | (9.140) | 136.629 | Wendy's Co | Goldman Sachs | (7.940) |
| (24.205) | Waterstone Financial Inc | Goldman Sachs | (20.022) | 22.898 | Wendy's Co | HSBC | (48.875) |
| (12.915) | Waterstone Financial Inc | HSBC | (6.458) | 93.875 | Wendy's Co | Morgan Stanley | (1.397) |
| (6.388) | Waterstone Financial Inc | Morgan Stanley | (3.194) | 35.982 | Wendy's Co | Barclays Bank | 255.496 |
| 3.186 | Watsco Inc | Bank of America | | 57.943 | Werner Enterprises Inc | Goldman Sachs | 25.131 |
| | | Merrill Lynch | (19.658) | 5.456 | Werner Enterprises Inc | HSBC | 100.181 |
| | | | | 9.478 | Werner Enterprises Inc | Barclays Bank | 67.286 |
| | | | | | | Goldman Sachs | 15.645 |
| | | | | | | HSBC | (2.073) |
| | | | | | | | (25.591) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|-------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.602 | WesBanco Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.588 | 681 | Westrock Co | Bank of America Merrill Lynch | 2.119 |
| 42.243 | WesBanco Inc | Barclays Bank | 48.579 | 54.968 | Westrock Co | Barclays Bank | 150.919 |
| 68.860 | WesBanco Inc | Goldman Sachs | 153.089 | 19.526 | Westrock Co | Goldman Sachs | 14.393 |
| 25.068 | WesBanco Inc | HSBC | 29.145 | 8.236 | Westrock Co | HSBC | 22.984 |
| 2.005 | WesBanco Inc | Morgan Stanley | 2.306 | 3.915 | Westrock Co | Morgan Stanley | 13.236 |
| 286 | WESCO International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 509 | 2.444 | Westwood Holdings Group Inc | Goldman Sachs | (147) |
| (678) | WESCO International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.759 | (9.072) | WeWork Inc 'A' | Barclays Bank | (3.266) |
| 8.749 | WESCO International Inc | Barclays Bank | 45.233 | (25.716) | WeWork Inc 'A' | Morgan Stanley | (9.258) |
| (333) | WESCO International Inc | Barclays Bank | (1.722) | (312) | WEX Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.129) |
| 3.730 | WESCO International Inc | Goldman Sachs | 6.639 | (1.235) | WEX Inc | Goldman Sachs | (11.555) |
| (3.239) | WESCO International Inc | Goldman Sachs | (5.765) | (2.147) | WEX Inc | HSBC | (20.923) |
| 9.457 | WESCO International Inc | HSBC | (66.483) | (750) | WEX Inc | Morgan Stanley | (6.113) |
| (512) | WESCO International Inc | HSBC | (819) | (3.097) | Weyco Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.146 |
| 2.147 | WESCO International Inc | Morgan Stanley | 11.100 | (5.501) | Weyco Group Inc | Barclays Bank | (9.242) |
| (350) | WESCO International Inc | Morgan Stanley | (1.810) | (9.204) | Weyco Group Inc | Goldman Sachs | 3.405 |
| (10.472) | West BanCorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (10.263) | (37.948) | Weyerhaeuser Co (REIT) | Barclays Bank | (55.404) |
| (10.384) | West BanCorp Inc | Barclays Bank | (5.607) | (63.610) | Weyerhaeuser Co (REIT) | Goldman Sachs | (96.051) |
| (7.626) | West BanCorp Inc | Goldman Sachs | (7.473) | 55.604 | Wheels Up Experience Inc | Barclays Bank | 1.668 |
| (1.689) | West BanCorp Inc | HSBC | 456 | (298) | Whirlpool Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.097) |
| (1.564) | West BanCorp Inc | Morgan Stanley | (845) | 8.968 | Whirlpool Corp | Barclays Bank | 63.493 |
| 964 | West Pharmaceutical Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | 11.028 | (3.821) | Whirlpool Corp | Barclays Bank | (27.053) |
| 2.205 | West Pharmaceutical Services Inc | Barclays Bank | 25.621 | 9.013 | Whirlpool Corp | Goldman Sachs | 270 |
| 1.306 | West Pharmaceutical Services Inc | Goldman Sachs | 15.127 | (910) | Whirlpool Corp | Goldman Sachs | (1.348) |
| 2.812 | West Pharmaceutical Services Inc | HSBC | 50.588 | (949) | Whirlpool Corp | Morgan Stanley | (12.614) |
| 1.393 | West Pharmaceutical Services Inc | Morgan Stanley | 15.978 | (265) | White Mountains Insurance Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (23.781) |
| (11.836) | Westamerica BanCorp | Barclays Bank | (14.558) | (678) | White Mountains Insurance Group Ltd | Barclays Bank | (51.202) |
| (25.880) | Westamerica BanCorp | Goldman Sachs | (68.582) | (721) | White Mountains Insurance Group Ltd | Goldman Sachs | (64.703) |
| (4.178) | Western Alliance Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (28.954) | (283) | White Mountains Insurance Group Ltd | HSBC | (34.367) |
| (8.094) | Western Alliance Bancorp | Barclays Bank | (33.267) | (1.479) | White Mountains Insurance Group Ltd | Morgan Stanley | (111.695) |
| (6.513) | Western Alliance Bancorp | Goldman Sachs | (40.443) | (9.137) | Whitestone (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (2.118) |
| (8.741) | Western Alliance Bancorp | HSBC | (42.105) | (23.317) | Whitestone (REIT) | Barclays Bank | (10.493) |
| (13.273) | Western Alliance Bancorp | Morgan Stanley | (54.552) | (48.723) | Whitestone (REIT) | Goldman Sachs | 4.233 |
| (19.391) | Western Asset Mortgage Capital Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 970 | (48.878) | Whitestone (REIT) | HSBC | (33.726) |
| (24.823) | Western Asset Mortgage Capital Corp (REIT) | Goldman Sachs | 1.241 | (7.212) | Whitestone (REIT) | Morgan Stanley | (3.245) |
| 5.338 | Western Digital Corp | Barclays Bank | 13.879 | (4.462) | Whiting Petroleum Corp | Barclays Bank | (45.423) |
| (4.148) | Western Digital Corp | Barclays Bank | (10.785) | (8.875) | Whiting Petroleum Corp | Goldman Sachs | (133.036) |
| (4.591) | Western Digital Corp | HSBC | (15.655) | 9.643 | Whole Earth Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.507 |
| (26.386) | Western New England Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (8.180) | 2.882 | Whole Earth Brands Inc | Barclays Bank | 461 |
| (5.658) | Western New England Bancorp Inc | Barclays Bank | (2.207) | 10.228 | Whole Earth Brands Inc | Goldman Sachs | 2.659 |
| (3.080) | Western New England Bancorp Inc | Goldman Sachs | (955) | 19.370 | Whole Earth Brands Inc | HSBC | 10.653 |
| 113.444 | Western Union Co | Barclays Bank | 53.318 | 39.422 | Whole Earth Brands Inc | Morgan Stanley | 6.308 |
| 37.117 | Western Union Co | Goldman Sachs | 29.694 | 5.248 | WideOpenWest Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.886 |
| 18.978 | Western Union Co | HSBC | 13.095 | 14.412 | WideOpenWest Inc | Barclays Bank | 4.612 |
| (21.590) | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Barclays Bank | (148.594) | 5.985 | WideOpenWest Inc | Goldman Sachs | 3.292 |
| (9.916) | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Goldman Sachs | (83.576) | 5.685 | WideOpenWest Inc | HSBC | 23.780 |
| (14.083) | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Morgan Stanley | (92.270) | (1.650) | Willdan Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.040) |
| 6.762 | Westlake Corp | Bank of America Merrill Lynch | 10.280 | (8.474) | Willdan Group Inc | Barclays Bank | 1.356 |
| 5.532 | Westlake Corp | Barclays Bank | 46.391 | (655) | Willdan Group Inc | Goldman Sachs | (413) |
| 13.447 | Westlake Corp | Goldman Sachs | 32.542 | (1.757) | Willdan Group Inc | HSBC | (1.318) |
| 7.362 | Westlake Corp | HSBC | 26.215 | (4.045) | Willdan Group Inc | Morgan Stanley | 647 |
| 783 | Westlake Corp | Morgan Stanley | 6.593 | (8.780) | Williams Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | (16.735) |
| | | | | 67.564 | Williams Cos Inc | Barclays Bank | 108.102 |
| | | | | (11.829) | Williams Cos Inc | Barclays Bank | (18.926) |
| | | | | 19.979 | Williams Cos Inc | Goldman Sachs | 43.554 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (12.983) | Williams Cos Inc | Goldman Sachs | (28.303) | (11.481) | Woodward Inc | Goldman Sachs | (20.056) |
| (17.082) | Williams Cos Inc | HSBC | (51.540) | (8.719) | Woodward Inc | HSBC | (18.543) |
| 15.758 | Williams Cos Inc | Morgan Stanley | 25.213 | (1.168) | Woodward Inc | Morgan Stanley | (3.808) |
| 1.086 | Williams-Sonoma Inc | Bank of America | | 2.184 | Workday Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 6.803 | | | Merrill Lynch | (45.493) |
| 795 | Williams-Sonoma Inc | Barclays Bank | 14.747 | 4.482 | Workday Inc 'A' | Barclays Bank | (47.330) |
| 447 | Williams-Sonoma Inc | Goldman Sachs | 1.243 | 2.801 | Workday Inc 'A' | Goldman Sachs | (54.610) |
| (344) | Williams-Sonoma Inc | Goldman Sachs | (956) | 11.222 | Workday Inc 'A' | HSBC | (235.438) |
| 4.230 | Williams-Sonoma Inc | HSBC | 26.063 | 11.373 | Workday Inc 'A' | Morgan Stanley | (120.099) |
| (1.234) | Williams-Sonoma Inc | HSBC | (3.196) | (76.057) | Workhorse Group Inc | Barclays Bank | (14.451) |
| 1.593 | Williams-Sonoma Inc | Morgan Stanley | 29.550 | (1.116) | Workiva Inc | Bank of America | |
| (2.598) | Willis Lease Finance Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (3.638) |
| | | Merrill Lynch | (15.874) | 11.089 | Workiva Inc | Barclays Bank | 15.636 |
| (2.791) | Willis Lease Finance Corp | Barclays Bank | (14.764) | (3.648) | Workiva Inc | Barclays Bank | (5.144) |
| (1.905) | Willis Lease Finance Corp | Goldman Sachs | (11.640) | (3.144) | Workiva Inc | Goldman Sachs | (10.223) |
| (2.548) | Willis Lease Finance Corp | HSBC | (15.339) | (5.675) | Workiva Inc | HSBC | (13.593) |
| 2.932 | Willis Towers Watson Plc | Bank of America | | (988) | Workiva Inc | Morgan Stanley | (1.393) |
| | | Merrill Lynch | 23.485 | (3.127) | World Acceptance Corp | Barclays Bank | (40.682) |
| (530) | Willis Towers Watson Plc | Bank of America | | (237) | World Acceptance Corp | Goldman Sachs | (377) |
| | | Merrill Lynch | (5.639) | (529) | World Acceptance Corp | HSBC | 3.817 |
| 5.869 | Willis Towers Watson Plc | Barclays Bank | 48.302 | 9.847 | World Fuel Services Corp | Barclays Bank | 2.757 |
| (525) | Willis Towers Watson Plc | Barclays Bank | (4.321) | 19.897 | World Fuel Services Corp | Goldman Sachs | 14.724 |
| 335 | Willis Towers Watson Plc | Goldman Sachs | 2.683 | 7.491 | World Fuel Services Corp | HSBC | 14.083 |
| (1.701) | Willis Towers Watson Plc | Goldman Sachs | (11.022) | (575) | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Bank of America | |
| 1.374 | Willis Towers Watson Plc | HSBC | 11.204 | | | Merrill Lynch | (4.704) |
| (565) | Willis Towers Watson Plc | HSBC | (2.537) | 1.509 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Bank of America | |
| 679 | Willis Towers Watson Plc | Morgan Stanley | 5.588 | | | Merrill Lynch | 12.344 |
| (988) | Willis Towers Watson Plc | Morgan Stanley | (8.131) | (3.674) | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Barclays Bank | (16.680) |
| (81.570) | WillScot Mobile Mini Holdings Corp | Barclays Bank | (116.645) | 1.246 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Barclays Bank | 5.657 |
| (26.889) | WillScot Mobile Mini Holdings Corp | Goldman Sachs | (46.787) | (3.933) | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Goldman Sachs | (32.172) |
| (52.860) | WillScot Mobile Mini Holdings Corp | HSBC | (218.312) | 2.420 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Goldman Sachs | 19.796 |
| 3.358 | Wingstop Inc | Bank of America | | (15.384) | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | HSBC | (164.763) |
| | | Merrill Lynch | (9.974) | 2.724 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | HSBC | 17.257 |
| 8.345 | Wingstop Inc | Barclays Bank | 40.754 | (3.866) | Worthington Industries Inc | Bank of America | |
| 7.088 | Wingstop Inc | Goldman Sachs | (21.051) | | | Merrill Lynch | (7.171) |
| 7.925 | Wingstop Inc | HSBC | (32.810) | (18.888) | Worthington Industries Inc | Barclays Bank | (44.953) |
| 327 | Wingstop Inc | Morgan Stanley | 1.625 | (6.655) | Worthington Industries Inc | Goldman Sachs | (13.044) |
| (389) | Winmark Corp | Bank of America | | (7.703) | Worthington Industries Inc | HSBC | (15.589) |
| | | Merrill Lynch | 3.771 | (2.093) | Worthington Industries Inc | Morgan Stanley | (4.981) |
| (4.226) | Winmark Corp | Barclays Bank | (21.320) | (786) | Wound Management Technologies Inc | Bank of America | |
| (1.863) | Winmark Corp | Goldman Sachs | 18.062 | (859) | Wound Management Technologies Inc | Merrill Lynch | 817 |
| (1.285) | Winmark Corp | HSBC | 25.539 | (32.716) | WP Carey Inc (REIT) | Barclays Bank | 2.062 |
| 13.504 | Winnebago Industries Inc | Barclays Bank | 36.056 | (43.124) | WP Carey Inc (REIT) | Bank of America | (95.911) |
| 6.027 | Winnebago Industries Inc | HSBC | (57.377) | (21.348) | WP Carey Inc (REIT) | Merrill Lynch | (122.902) |
| 5.980 | Wintrust Financial Corp | Bank of America | | (35.186) | WP Carey Inc (REIT) | Goldman Sachs | (65.689) |
| | | Merrill Lynch | 21.485 | (6.191) | WP Carey Inc (REIT) | HSBC | (258.422) |
| 22.541 | Wintrust Financial Corp | Barclays Bank | 64.242 | (9.715) | WSFS Financial Corp | Morgan Stanley | (17.892) |
| 20.517 | Wintrust Financial Corp | Goldman Sachs | 77.349 | | | Bank of America | |
| 19.241 | Wintrust Financial Corp | HSBC | 36.565 | (4.649) | WSFS Financial Corp | Merrill Lynch | (29.259) |
| 11.526 | Wintrust Financial Corp | Morgan Stanley | 32.849 | (5.494) | WSFS Financial Corp | Barclays Bank | (6.515) |
| 49.949 | WisdomTree Investments Inc | HSBC | 29.720 | (5.013) | WSFS Financial Corp | Goldman Sachs | (23.734) |
| 1.310 | Wix.com Ltd | Bank of America | | (2.738) | WSFS Financial Corp | HSBC | (13.468) |
| | | Merrill Lynch | (3.031) | 1.117 | WW Grainger Inc | Morgan Stanley | (2.130) |
| 2.026 | Wix.com Ltd | Barclays Bank | (5.409) | | | Bank of America | |
| 4.241 | Wix.com Ltd | Goldman Sachs | (10.264) | 423 | WW Grainger Inc | Merrill Lynch | 10.645 |
| 2.722 | Wix.com Ltd | HSBC | 1.028 | 5.707 | WW Grainger Inc | Barclays Bank | 6.933 |
| 1.178 | Wix.com Ltd | Morgan Stanley | (3.145) | 6.389 | WW Grainger Inc | Goldman Sachs | 54.388 |
| (11.550) | Wolfspeed Inc | Goldman Sachs | (5.775) | 1.232 | WW Grainger Inc | HSBC | 43.531 |
| 8.473 | Wolfspeed Inc | HSBC | 41.919 | 15.682 | WW International Inc | Morgan Stanley | 20.192 |
| (39.554) | Wolverine World Wide Inc | Barclays Bank | (40.348) | | | Bank of America | |
| (9.163) | Wolverine World Wide Inc | Goldman Sachs | (9.346) | | | Merrill Lynch | 2.208 |
| (8.703) | Wolverine World Wide Inc | HSBC | (14.999) | | | Barclays Bank | 13.518 |
| (3.882) | Wolverine World Wide Inc | Morgan Stanley | (4.193) | | | | |
| (711) | Woodward Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (2.570) | | | | |
| (31.164) | Woodward Inc | Barclays Bank | (101.595) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 13.757 | WW International Inc | Goldman Sachs | (4.815) | (20.901) | XL Fleet Corp | Goldman Sachs | 627 |
| 8.389 | WW International Inc | HSBC | (5.511) | (20.536) | XOMA Corp | Barclays Bank | (24.232) |
| 15.250 | WW International Inc | Morgan Stanley | 9.284 | (2.931) | XOMA Corp | Morgan Stanley | (3.459) |
| 9.578 | Wyndham Hotels & Resorts Inc | Barclays Bank | 50.093 | (2.074) | Xometry Inc 'A' | Goldman Sachs | (8.275) |
| (2.356) | Wyndham Hotels & Resorts Inc | Barclays Bank | (12.322) | (7.287) | Xometry Inc 'A' | HSBC | (18.430) |
| 20.855 | Wyndham Hotels & Resorts Inc | Goldman Sachs | 84.046 | (938) | Xometry Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.908) |
| (1.624) | Wyndham Hotels & Resorts Inc | Goldman Sachs | (3.692) | 43.210 | Xos Inc | Goldman Sachs | 19.444 |
| (4.746) | Wyndham Hotels & Resorts Inc | HSBC | (22.888) | (4.678) | XPEL Inc | Bank of America | |
| 24.024 | Wyndham Hotels & Resorts Inc | Morgan Stanley | 125.646 | (4.325) | XPEL Inc | Merrill Lynch | (16.233) |
| (2.700) | Wyndham Hotels & Resorts Inc | Morgan Stanley | (14.121) | (1.247) | XPEL Inc | Barclays Bank | (3.806) |
| (664) | Wynn Resorts Ltd | Bank of America | (4.992) | (3.859) | XPEL Inc | Goldman Sachs | (4.327) |
| 6.813 | Wynn Resorts Ltd | Merrill Lynch | (4.992) | 2.770 | XPO Logistics Inc | HSBC | (30.911) |
| (5.538) | Wynn Resorts Ltd | Barclays Bank | 25.004 | 12.685 | XPO Logistics Inc | Bank of America | |
| 4.995 | X4 Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (20.324) | (10.041) | XPO Logistics Inc | Merrill Lynch | 4.210 |
| 7.804 | X4 Pharmaceuticals Inc | Bank of America | — | 3.752 | XPO Logistics Inc | Barclays Bank | 38.309 |
| 9.905 | X4 Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | (624) | (4.515) | XPO Logistics Inc | Goldman Sachs | (15.262) |
| 3.287 | X4 Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | — | 7.668 | XPO Logistics Inc | Goldman Sachs | 3.607 |
| 5.257 | X4 Pharmaceuticals Inc | HSBC | 625 | 6.054 | XPO Logistics Inc | HSBC | (7.043) |
| (21.459) | XBiotech Inc | Barclays Bank | (421) | (1.613) | Xponential Fitness Inc 'A' | HSBC | 11.962 |
| (1.759) | XBiotech Inc | HSBC | 4.936 | (6.847) | Xponential Fitness Inc 'A' | Morgan Stanley | 20.404 |
| 2.767 | Xcel Energy Inc | Bank of America | 1.390 | (2.842) | XRAY-TWOLF HoldCo Corp | Bank of America | |
| 9.005 | Xcel Energy Inc | Merrill Lynch | 775 | (34.773) | XRAY-TWOLF HoldCo Corp | Merrill Lynch | (5.758) |
| (33.969) | Xcel Energy Inc | Barclays Bank | 2.161 | (18.513) | XRAY-TWOLF HoldCo Corp | HSBC | (15.200) |
| 19.323 | Xcel Energy Inc | Barclays Bank | (8.153) | (28.006) | XRAY-TWOLF HoldCo Corp | Bank of America | |
| (14.429) | Xcel Energy Inc | Goldman Sachs | 2.817 | (17.734) | XRAY-TWOLF HoldCo Corp | Merrill Lynch | (682) |
| 449 | Xcel Energy Inc | HSBC | 656 | 1.046 | Xylem Inc | Barclays Bank | 5.564 |
| 10.811 | Xcel Energy Inc | Morgan Stanley | 2.595 | (1.984) | Xylem Inc | Goldman Sachs | (4.682) |
| (9.234) | Xcel Energy Inc | Morgan Stanley | (2.216) | 10.246 | Xylem Inc | Barclays Bank | 29.679 |
| (2.106) | Xencor Inc | Bank of America | 3.201 | (3.158) | Xylem Inc | Barclays Bank | (9.285) |
| (7.671) | Xencor Inc | Merrill Lynch | 4.986 | 11.743 | Xylem Inc | Goldman Sachs | 32.187 |
| (6.369) | Xencor Inc | Barclays Bank | 4.986 | (18.105) | Xylem Inc | Goldman Sachs | (46.123) |
| (6.684) | Xencor Inc | Goldman Sachs | 9.681 | 2.425 | Xylem Inc | HSBC | 402 |
| (8.684) | Xencor Inc | HSBC | 17.044 | (499) | Xylem Inc | HSBC | 752 |
| (8.767) | Xencor Inc | Morgan Stanley | 5.699 | 5.770 | Xylem Inc | Morgan Stanley | 14.004 |
| (44.394) | Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT) | Barclays Bank | (30.632) | (5.546) | Xylem Inc | Morgan Stanley | (17.017) |
| (84.321) | Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT) | Goldman Sachs | 25.296 | (36.934) | Yellow Corp | Barclays Bank | (3.693) |
| (20.734) | Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT) | HSBC | (14.928) | (4.795) | Yellow Corp | Goldman Sachs | (1.247) |
| 21.788 | Xeris Biopharma Holdings Inc | Barclays Bank | 1.961 | 1.896 | Yelp Inc | Bank of America | |
| 4.938 | Xeris Biopharma Holdings Inc | Goldman Sachs | 247 | 13.815 | Yelp Inc | Merrill Lynch | 797 |
| 10.871 | Xeris Biopharma Holdings Inc | HSBC | 4.566 | 24.881 | Yelp Inc | Barclays Bank | 19.656 |
| 12.628 | Xeris Biopharma Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.137 | 21.894 | Yelp Inc | Goldman Sachs | 13.187 |
| 13.193 | Xerox Holdings Corp | Bank of America | 10.818 | 10.313 | Yelp Inc | HSBC | 11.402 |
| (7.181) | Xerox Holdings Corp | Merrill Lynch | (5.888) | (8.143) | YETI Holdings Inc | Morgan Stanley | 13.923 |
| 8.856 | Xerox Holdings Corp | Barclays Bank | 7.793 | 339 | YETI Holdings Inc | Bank of America | |
| (13.635) | Xerox Holdings Corp | Barclays Bank | (11.999) | (5.122) | YETI Holdings Inc | Merrill Lynch | 13.517 |
| 21.994 | Xerox Holdings Corp | Goldman Sachs | 18.035 | (3.701) | YETI Holdings Inc | Bank of America | |
| 32.227 | Xerox Holdings Corp | HSBC | 35.450 | (7.713) | YETI Holdings Inc | Merrill Lynch | (563) |
| (28.876) | Xerox Holdings Corp | HSBC | (31.764) | (6.240) | YETI Holdings Inc | Barclays Bank | (7.683) |
| 26.941 | Xerox Holdings Corp | Morgan Stanley | 23.708 | 2.243 | YETI Holdings Inc | Goldman Sachs | 4.457 |
| (61.797) | XL Fleet Corp | Bank of America | 1.854 | (1.064) | YETI Holdings Inc | Goldman Sachs | (12.804) |
| | | Merrill Lynch | | 7.525 | Yext Inc | HSBC | (1.647) |
| | | | | 98.322 | Yext Inc | HSBC | 243 |
| | | | | 38.288 | Yext Inc | Morgan Stanley | 1.596 |
| | | | | 15.066 | Yext Inc | Bank of America | |
| | | | | (8.988) | Y-mAbs Therapeutics Inc | Merrill Lynch | 323 |
| | | | | (20.498) | York Water Co | Barclays Bank | 7.762 |
| | | | | (8.360) | York Water Co | Goldman Sachs | (766) |
| | | | | (14.747) | Yum China Holdings Inc | HSBC | (3.013) |
| | | | | 2.374 | Yum China Holdings Inc | Barclays Bank | (13.931) |
| | | | | | | Barclays Bank | 4.510 |
| | | | | | | Goldman Sachs | (3.177) |
| | | | | | | Barclays Bank | (61.495) |
| | | | | | | Barclays Bank | 9.900 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|----------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 236.618 | USD | 241.053 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 5.715 |
| USD | 20.445 | CHF | 20.124 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (543) |
| | | | | | | 5.172 |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 307.667.334 | USD | 326.210.457 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 3.577.258 |
| USD | 28.812.926 | EUR | 27.275.372 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (423.466) |
| | | | | | | 3.153.792 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 16.905 | USD | 20.918 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 363 |
| USD | 1.717 | GBP | 1.390 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (32) |
| | | | | | | 331 |
| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| JPY | 36.665.238.966 | USD | 281.968.148 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 2.905.089 |
| USD | 7.526.329 | JPY | 965.984.322 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 21.044 |
| | | | | | | 2.926.133 |
| Auf SEK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| SEK | 786.962.452 | USD | 79.604.932 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 553.052 |
| USD | 6.663.972 | SEK | 66.225.904 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (81.628) |
| | | | | | | 471.424 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 738.597.000) | | | | | | 6.556.852 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 85,25 |
| Staatsanleihen | 7,93 |
| Industrie | 3,42 |
| Zyklische Konsumgüter | 2,59 |
| Diversifiziert | 0,19 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 0,17 |
| Technologie | 0,11 |
| Kommunikation | 0,01 |
| Energie | 0,01 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 99,68 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 0,32 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|--|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Taiwan Fortsetzung | | | |
| | | | | 90.000 | Unimicron Technology Corp | 668.217 | 1,34 |
| | | | | 20.000 | Wiwynn Corp | 636.004 | 1,27 |
| | | | | | | 3.279.070 | 6,56 |
| STAMMAKTIE | | | | Thailand | | | |
| | Kaimaninseln | | | 3.623.800 | Land & Houses PCL NVDR | 947.780 | 1,89 |
| 19.000 | Alchip Technologies Ltd | 612.059 | 1,22 | 551.800 | Thai Oil PCL NVDR | 935.254 | 1,87 |
| 102.716 | Alibaba Group Holding Ltd | 1.259.873 | 2,52 | | | 1.883.034 | 3,76 |
| 175.000 | CK Hutchison Holdings Ltd | 1.242.171 | 2,48 | Großbritannien | | | |
| 62.100 | ENN Energy Holdings Ltd | 952.018 | 1,90 | 18.782 | Prudential Plc | 247.560 | 0,50 |
| 28.228 | I-Mab ADR | 245.866 | 0,49 | | | 247.560 | 0,50 |
| 148.000 | Li Ning Co Ltd | 1.154.253 | 2,31 | | | | |
| 18.772 | TDCX Inc ADR | 203.301 | 0,41 | | | | |
| | | 5.669.541 | 11,33 | Gesamt Stammaktien | | | |
| | China | | | KURZFRISTIGE TITEL | | | |
| 106.785 | Anhui Honglu Steel Construction Group Co Ltd 'A' | 621.889 | 1,24 | Frankreich | | | |
| 648.000 | China National Building Material Co Ltd 'H' | 818.345 | 1,64 | USD 2.101.000 | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 1/6/2022 (Zero Coupon) | 2.101.000 | 4,20 |
| 55.800 | Eve Energy Co Ltd 'A' | 672.419 | 1,34 | | | 2.101.000 | 4,20 |
| 100.300 | Hangzhou Silan Micro-electronics Co Ltd 'A' | 677.743 | 1,36 | Deutschland | | | |
| 215.510 | Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd 'A' | 962.536 | 1,92 | USD 2.292.000 | DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank 25/7/2022 (Zero Coupon) | 2.287.634 | 4,57 |
| 228.700 | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd 'A' | 1.302.080 | 2,60 | USD 2.101.000 | Landesbank Baden Wuerttemberg 21/6/2022 (Zero Coupon) | 2.100.031 | 4,20 |
| 109.080 | Joinn Laboratories China Co Ltd 'H' | 870.177 | 1,74 | | | 4.387.665 | 8,77 |
| 6.000 | Kweichow Moutai Co Ltd 'A' | 1.621.746 | 3,24 | Jersey | | | |
| 65.500 | WuXi AppTec Co Ltd 'H' | 808.405 | 1,62 | USD 2.103.000 | Cancara Asset Securitisation LLC 5/7/2022 (Zero Coupon) | 2.100.736 | 4,20 |
| | | 8.355.340 | 16,70 | | | 2.100.736 | 4,20 |
| | Hongkong | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 262.000 | BOC Hong Kong Holdings Ltd* | 1.006.646 | 2,01 | USD 2.275.000 | Barton Capital SA 25/7/2022 (Zero Coupon) | 2.270.734 | 4,54 |
| | | 1.006.646 | 2,01 | USD 2.100.000 | Federation des Caisses Desjardins 7/6/2022 (Zero Coupon) | 2.099.741 | 4,20 |
| | Indien | | | USD 2.272.000 | Mont Blanc Capital Corp 18/7/2022 (Zero Coupon) | 2.268.292 | 4,53 |
| 78.647 | ICICI Bank Ltd | 758.245 | 1,52 | | | 6.638.767 | 13,27 |
| 59.720 | Oberoi Realty Ltd | 618.113 | 1,23 | | | 15.228.168 | 30,44 |
| | | 1.376.358 | 2,75 | Gesamt kurzfristige Titel | | | |
| | Indonesien | | | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| 1.478.900 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT | 930.588 | 1,86 | | | 46.072.854 | 92,09 |
| 1.267.700 | Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT | 845.510 | 1,69 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| | | 1.776.098 | 3,55 | Irland | | | |
| | Philippinen | | | 39.923 | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Dist)~ | 3.992.666 | 7,98 |
| 49.050 | GT Capital Holdings Inc | 470.487 | 0,94 | | | 3.992.666 | 7,98 |
| | | 470.487 | 0,94 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| | Singapur | | | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | |
| 41.400 | Jardine Cycle & Carriage Ltd | 884.770 | 1,77 | | | 50.065.520 | 100,07 |
| | | 884.770 | 1,77 | Sonstige Nettoverbindlichkeiten | | | |
| | Südkorea | | | | | (32.603) | (0,07) |
| 27.676 | Hana Financial Group Inc | 1.107.308 | 2,21 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | | |
| 2.039 | Korea Zinc Co Ltd | 980.605 | 1,96 | | | 50.032.917 | 100,00 |
| 130.352 | Korean Reinsurance Co | 1.015.675 | 2,03 | ^ Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |
| 14.000 | Samsung Electronics Co Ltd | 762.690 | 1,52 | ~ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9. | | | |
| 4.162 | SK Bioscience Co Ltd | 455.829 | 0,91 | | | | |
| 4.267 | SK Innovation Co Ltd | 743.242 | 1,49 | | | | |
| 8.857 | S-Oil Corp | 830.433 | 1,66 | | | | |
| | | 5.895.782 | 11,78 | | | | |
| | Taiwan | | | | | | |
| 80.000 | President Chain Store Corp | 759.345 | 1,52 | | | | |
| 63.000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 1.215.504 | 2,43 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|--|-------------------------------|---|---|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Taiwan | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (458.000) | Acer Inc | JP Morgan | (35.631) |
| Australien | | | | (14.000) | ASMedia Technology Inc | JP Morgan | (47.654) |
| (34.881) | Fortescue Metals Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (47.147) | (54.000) | Asustek Computer Inc | JP Morgan | 13.215 |
| | | | (47.147) | (367.000) | Cathay Financial Holding Co Ltd | Morgan Stanley | (56.274) |
| Kaimaninseln | | | | (873.000) | China Steel Corp | Bank of America Merrill Lynch | (69.582) |
| (49.867) | NIO Inc ADR | Morgan Stanley | (57.846) | (76.000) | Makalot Industrial Co Ltd | JP Morgan | (20.691) |
| | | | (57.846) | (33.000) | Realtek Semiconductor Corp | Bank of America Merrill Lynch | (33.091) |
| Hongkong | | | | (1.391.554) | Shin Kong Financial Holding Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (31.171) |
| (287.500) | AAC Technologies Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (31.712) | (327.000) | Shin Kong Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | (4.296) |
| (65.800) | ANTA Sports Products Ltd | Morgan Stanley | (70.247) | (225.000) | Shin Kong Financial Holding Co Ltd | Morgan Stanley | (4.113) |
| (983.000) | China Coal Energy Co Ltd 'H' | Morgan Stanley | (50.399) | (1.230.000) | Yuanta Financial Holding Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (41.282) |
| (228.000) | China Railway Group Ltd 'H' | Bank of America Merrill Lynch | 527 | | | | (330.570) |
| 36.500 | CK Hutchison Holdings Ltd | JP Morgan | 5.669 | Thailand | | | |
| (171.500) | Hengan International Group Co Ltd | Morgan Stanley | (14.488) | (283.400) | Energy Absolute PCL NVDR | Morgan Stanley | (17.626) |
| (16.000) | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | Morgan Stanley | (16.132) | | | | (17.626) |
| (193.000) | Jiumaojiu International Holdings Ltd | JP Morgan | (72.440) | Großbritannien | | | |
| 6.080 | Joinn Laboratories China Co Ltd 'H' | Morgan Stanley | 3.657 | 62.067 | Prudential Plc | Morgan Stanley | 24.451 |
| (71.300) | Kuaishou Technology | JP Morgan | (151.348) | | | | 24.451 |
| (462.000) | Ming Yuan Cloud Group Holdings Ltd | Morgan Stanley | 7.460 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| (240.900) | Ping An Healthcare and Technology Co Ltd | Morgan Stanley | (46.866) | (3.147) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | JP Morgan | (58.355) |
| (146.200) | Pop Mart International Group Ltd | JP Morgan | (4.850) | (150.712) | Grab Holdings Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (14.318) |
| (23.400) | Tencent Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (37.336) | (35.421) | Grab Holdings Ltd 'A' | Morgan Stanley | 7.793 |
| | | | (478.505) | 147.100 | Mobile World Investment Corp | JP Morgan | 44.927 |
| Indonesien | | | | (22.595) | Tata Motors Ltd ADR | Morgan Stanley | (18.302) |
| (1.040.300) | Bank Artos Indonesia Tbk PT | JP Morgan | 94.966 | (28.718) | XPeng Inc ADR | Bank of America Merrill Lynch | (20.103) |
| | | | 94.966 | | | | (58.358) |
| Philippinen | | | | Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 30.714.605) | | | |
| (1.070.000) | SM Prime Holdings Inc | JP Morgan | (50.496) | | | | (1.816.085) |
| | | | (50.496) | Singapur | | | |
| Singapur | | | | 141.800 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | JP Morgan | 14.278 |
| | | | 14.278 | Südkorea | | | |
| (351.350) | Hanwha Life Insurance Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (49.082) | (28.781) | Hanwha Solutions Corp | Bank of America Merrill Lynch | (220.411) |
| (28.781) | Hanwha Solutions Corp | Bank of America Merrill Lynch | (220.411) | (226) | Hyosung TNC Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (12.990) |
| | | | (220.411) | (1.779) | Hyosung TNC Co Ltd | JP Morgan | (68.175) |
| | | | (220.411) | (3.631) | Krafton Inc | Bank of America Merrill Lynch | (80.207) |
| | | | (220.411) | (1.470) | LG Energy Solution | JP Morgan | (71.835) |
| | | | (220.411) | (933) | LG Household & Health Care Ltd | JP Morgan | (50.257) |
| | | | (220.411) | (8.332) | OCI Co Ltd | Morgan Stanley | (156.819) |
| | | | (220.411) | (23.845) | Seegene Inc | Morgan Stanley | (38.883) |
| | | | (220.411) | (8.632) | SK Bioscience Co Ltd | JP Morgan | (112.133) |
| | | | (220.411) | (2.895) | SKC Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (48.440) |
| | | | (220.411) | | | | (909.232) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|--|---------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (295) | USD | FTSE China A50 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 3.999.020 | (81.749) |
| 37 | KRW | KOSPI 200 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 2.647.824 | 26.006 |
| (66) | USD | SGX FTSE Indonesia Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 1.171.500 | (48.510) |
| (55) | USD | SGX NIFTY 50 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 1.821.600 | (32.487) |
| Gesamt | | | | | (136.740) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|---------|---------|----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 393.011 | USD | 400.250 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 9.618 |
| USD | 27.563 | CHF | 27.138 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (739) |
| | | | | | | 8.879 |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 796.504 | USD | 844.371 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 9.400 |
| USD | 38.522 | EUR | 36.421 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (518) |
| | | | | | | 8.882 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 479.726 | USD | 593.505 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 10.423 |
| USD | 41.253 | GBP | 33.398 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (793) |
| | | | | | | 9.630 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 1.976.953) | | | | | | 27.391 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 37,60 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 10,60 |
| Industrie | 9,17 |
| Zyklische Konsumgüter | 8,43 |
| Technologie | 8,21 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 7,98 |
| Energie | 5,02 |
| Staatsanleihen | 4,20 |
| Kommunikation | 2,52 |
| Diversifiziert | 2,48 |
| Grundstoffe | 1,96 |
| Versorger | 1,90 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 100,07 |
| Sonstige Nettverbindlichkeiten | (0,07) |
| <hr/> | |
| | 100,00 |

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | China Fortsetzung | | | |
| STAMMAKTIEN | | | | | | | |
| China | | | | | | | |
| 24.200 | Angang Steel Co Ltd 'A' | 12.581 | 0,04 | 1.700 | Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd 'A' | 12.363 | 0,04 |
| 100 | Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd 'A' | 3.920 | 0,01 | 15.200 | Yunda Holding Co Ltd 'A' | 41.357 | 0,12 |
| 6.800 | Avary Holding Shenzhen Co Ltd 'A' | 30.911 | 0,09 | 7.200 | Yunnan Tin Co Ltd 'A' | 18.252 | 0,05 |
| 4.795 | Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co Ltd 'A' | 91.519 | 0,27 | 5.427 | Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd 'A' | 44.981 | 0,13 |
| 103.900 | BOE Technology Group Co Ltd 'A' | 58.999 | 0,17 | 18.840 | Zhejiang NHU Co Ltd 'A' | 58.543 | 0,17 |
| 5.600 | BYD Co Ltd 'A' | 248.276 | 0,72 | 13.000 | Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd 'A' | 35.741 | 0,10 |
| 600 | Chacha Food Co Ltd 'A' | 4.988 | 0,01 | 6.744 | ZTE Corp 'A' | 24.584 | 0,07 |
| 400 | China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co Ltd 'A' | 2.630 | 0,01 | | | 1.990.900 | 5,78 |
| 1.000 | Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd 'A' | 13.077 | 0,04 | Malaysia | | | |
| 3.000 | Contemporary Amperex Technology Co Ltd 'A' | 183.387 | 0,53 | 54.100 | Farm Fresh Bhd | 20.758 | 0,06 |
| 3.786 | Do-Fluoride Chemicals Co Ltd 'A' | 21.947 | 0,06 | | | 20.758 | 0,06 |
| 16.200 | Dong-E-E-Jiao Co Ltd 'A' | 77.039 | 0,22 | Südkorea | | | |
| 38.800 | FAW Jiefang Group Co Ltd 'A' | 52.087 | 0,15 | 345 | LG Energy Solution | 123.812 | 0,36 |
| 21.400 | Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai 'A' | 103.146 | 0,30 | | | 123.812 | 0,36 |
| 2.400 | Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd 'A' | 27.228 | 0,08 | Gesamt Stammaktien | | | |
| 4.200 | Guangzhou Tinci Materials Technology Co Ltd 'A' | 23.944 | 0,07 | | | 2.135.470 | 6,20 |
| 13.200 | Guoyuan Securities Co Ltd 'A' | 11.411 | 0,03 | ANLEIHEN | | | |
| 22.800 | Hesteel Co Ltd 'A' | 8.028 | 0,02 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 1.200 | Huizhou Desay Sv Automotive Co Ltd 'A' | 22.806 | 0,07 | USD 675.000 | United States Treasury Bill 7/6/2022 (Zero Coupon) | 674.949 | 1,96 |
| 100 | Imeik Technology Development Co Ltd 'A' | 8.104 | 0,02 | USD 250.000 | United States Treasury Bill 16/6/2022 (Zero Coupon) | 249.936 | 0,73 |
| 300 | Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd 'A' | 7.416 | 0,02 | USD 825.000 | United States Treasury Bill 21/6/2022 (Zero Coupon) | 824.753 | 2,39 |
| 9.400 | Leyard Optoelectronic Co Ltd 'A' | 8.760 | 0,03 | USD 250.000 | United States Treasury Bill 3/11/2022 (Zero Coupon) | 249.093 | 0,72 |
| 6.800 | Lomon Billions Group Co Ltd 'A' | 19.347 | 0,06 | USD 500.000 | United States Treasury Bill 29/12/2022 (Zero Coupon) | 497.115 | 1,44 |
| 6.800 | Luxshare Precision Industry Co Ltd 'A' | 34.446 | 0,10 | USD 250.000 | United States Treasury Bill 23/3/2023 (Zero Coupon) | 246.425 | 0,72 |
| 2.600 | Luzhou Laojiao Co Ltd 'A' | 83.675 | 0,24 | USD 300.000 | United States Treasury Note/Bond 0,125% 31/1/2023 | 296.717 | 0,86 |
| 18.600 | NavInfo Co Ltd 'A' | 36.646 | 0,11 | | | 3.038.988 | 8,82 |
| 82.695 | Northeast Securities Co Ltd 'A' | 79.791 | 0,23 | Gesamt Anleihen | | | |
| 6.200 | Pangang Group Vanadium Titanium & Resources Co Ltd 'A' | 3.112 | 0,01 | | | 3.038.988 | 8,82 |
| 400 | Pharmaron Beijing Co Ltd 'A' | 7.148 | 0,02 | EINLAGENZERTIFIKATE | | | |
| 1.900 | SG Micro Corp 'A' | 81.823 | 0,24 | Kanada | | | |
| 12.800 | Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd 'A' | 23.243 | 0,07 | USD 300.000 | Bank Of Montreal 1,28% 5/5/2023 | 300.000 | 0,87 |
| 2.325 | Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd 'A' | 44.797 | 0,13 | USD 300.000 | Royal Bank of Canada FRN 20/10/2022 | 298.107 | 0,86 |
| 25.500 | Shanxi Taigang Stainless Steel Co Ltd 'A' | 22.083 | 0,06 | USD 250.000 | Toronto-Dominion Bank FRN 21/4/2023 | 250.000 | 0,73 |
| 5.300 | Shenzhen Capchem Technology Co Ltd 'A' | 31.922 | 0,09 | USD 250.000 | Toronto-Dominion Bank FRN 28/4/2023 | 250.000 | 0,73 |
| 1.100 | Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd 'A' | 49.855 | 0,15 | | | 1.098.107 | 3,19 |
| 18.500 | Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co Ltd 'A' | 71.457 | 0,21 | Japan | | | |
| 5.200 | Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd 'A' | 13.876 | 0,04 | USD 500.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp 1,23% 22/7/2022 | 500.000 | 1,45 |
| 61.900 | TongFu Microelectronics Co Ltd 'A' | 129.654 | 0,38 | | | 500.000 | 1,45 |
| | | | | Spanien | | | |
| | | | | USD 500.000 | Banco Santander SA 1,23% 28/10/2022 | 500.000 | 1,45 |
| | | | | | | 500.000 | 1,45 |
| | | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| | | | | USD 500.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 8/6/2022 | 500.000 | 1,45 |
| | | | | USD 250.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 12/9/2022 | 250.000 | 0,73 |
| | | | | USD 500.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 21/1/2023 | 500.000 | 1,45 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|---------------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Spanien | | | |
| USD 500.000 | Natixis SA 7/7/2022 (Zero Coupon) | 500.000 | 1,45 | USD 500.000 | Banco Santander SA FRN 6/6/2022 | 499.941 | 1,45 |
| USD 250.000 | Nordea Bank Abp FRN 24/6/2022 | 249.967 | 0,72 | | | 499.941 | 1,45 |
| USD 250.000 | Nordea Bank Abp FRN 24/6/2022 | 250.000 | 0,73 | Schweden | | | |
| USD 70.000 | Standard Chartered Bank FRN 17/3/2023 | 69.629 | 0,20 | USD 350.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB 21/6/2022 (Zero Coupon) | 349.953 | 1,02 |
| USD 250.000 | Svenska Handelsbanken AB FRN 18/10/2022 | 250.005 | 0,73 | USD 500.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB 6/9/2022 (Zero Coupon) | 499.737 | 1,45 |
| | | 2.569.601 | 7,46 | USD 300.000 | Svenska Handelsbanken AB 1/6/2022 (Zero Coupon) | 300.000 | 0,87 |
| Gesamt Einlagezertifikate | | 4.667.708 | 13,55 | USD 250.000 | Svenska Handelsbanken AB 27/10/2022 (Zero Coupon) | 249.651 | 0,72 |
| KURZFRISTIGE TITEL | | | | USD 250.000 | Svenska Handelsbanken AB FRN 14/2/2023 | 247.599 | 0,72 |
| Australien | | | | USD 250.000 | Swedbank AB 1,13% 13/10/2022 | 250.000 | 0,73 |
| USD 1.050.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd 7/7/2022 (Zero Coupon) | 1.048.950 | 3,05 | | | 1.896.940 | 5,51 |
| USD 250.000 | National Australia Bank Ltd 24/2/2023 (Zero Coupon) | 247.395 | 0,72 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| USD 250.000 | Westpac Banking Corp 20/10/2022 (Zero Coupon) | 249.667 | 0,72 | USD 400.000 | Amazon.com Inc 30/11/2022 (Zero Coupon) | 398.079 | 1,16 |
| | | 1.546.012 | 4,49 | USD 250.000 | ASB Bank Ltd FRN 8/9/2022 | 250.000 | 0,73 |
| Kanada | | | | USD 500.000 | Atlantic Asset Securitization LLC 11/7/2022 (Zero Coupon) | 499.583 | 1,45 |
| USD 500.000 | National Bank of Canada 0,94% 28/7/2022 | 500.000 | 1,45 | USD 500.000 | Atlantic Asset Securitization LLC 11/8/2022 (Zero Coupon) | 498.570 | 1,45 |
| USD 250.000 | National Bank of Canada 1,18% 13/11/2023 | 250.000 | 0,72 | USD 500.000 | Bedford Row Funding Corp 14/7/2022 (Zero Coupon) | 500.000 | 1,45 |
| USD 250.000 | National Bank Of Canada 10/11/2022 (Zero Coupon) | 250.000 | 0,73 | USD 500.000 | Bennington Stark Capital Co 10/6/2022 (Zero Coupon) | 499.888 | 1,45 |
| USD 350.000 | Toronto-Dominion Bank 11/10/2022 (Zero Coupon) | 348.652 | 1,01 | USD 250.000 | BNZ International Funding Ltd FRN 19/8/2022 | 250.000 | 0,73 |
| USD 250.000 | Toronto-Dominion Bank FRN 2/3/2023 | 247.146 | 0,72 | USD 500.000 | Charta LLC 2/6/2022 (Zero Coupon) | 499.989 | 1,45 |
| | | 1.595.798 | 4,63 | USD 500.000 | Collateralized Commercial Paper V Co LLC 14/6/2022 (Zero Coupon) | 499.935 | 1,45 |
| Frankreich | | | | USD 350.000 | Commonwealth Bank of Australia 1/9/2022 (Zero Coupon) | 350.000 | 1,02 |
| USD 250.000 | BPCE SA 22/2/2023 (Zero Coupon) | 247.414 | 0,72 | USD 500.000 | Goldman Sachs International 6/6/2022 (Zero Coupon) | 499.942 | 1,45 |
| USD 474.000 | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 27/6/2022 (Zero Coupon) | 473.678 | 1,37 | USD 250.000 | Gotham Funding 6/6/2022 (Zero Coupon) | 249.974 | 0,73 |
| | | 721.092 | 2,09 | USD 350.000 | ING US Funding LLC 7/6/2022 (Zero Coupon) | 349.948 | 1,02 |
| Irland | | | | USD 500.000 | JP Morgan Securities LLC 2/11/2022 (Zero Coupon) | 497.647 | 1,44 |
| USD 625.000 | Glencore Funding LLC 27/6/2022 (Zero Coupon) | 624.535 | 1,81 | USD 650.000 | Lime Funding LLC 24/6/2022 (Zero Coupon) | 649.610 | 1,89 |
| USD 500.000 | Glencore Funding LLC 23/8/2022 (Zero Coupon) | 498.225 | 1,45 | USD 500.000 | Mackinac Funding Co LLC 16/8/2022 (Zero Coupon) | 499.071 | 1,45 |
| | | 1.122.760 | 3,26 | USD 500.000 | Macquarie Bank Ltd 24/8/2022 (Zero Coupon) | 498.122 | 1,45 |
| Japan | | | | USD 250.000 | National Australia Bank Ltd 25/10/2022 (Zero Coupon) | 250.000 | 0,73 |
| USD 250.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp 8/9/2022 (Zero Coupon) | 249.037 | 0,72 | USD 750.000 | Nieuw Amsterdam Receivables Corp 23/6/2022 (Zero Coupon) | 749.595 | 2,18 |
| | | 249.037 | 0,72 | USD 385.000 | Old Line Funding LLC 15/8/2022 (Zero Coupon) | 384.294 | 1,11 |
| Jersey | | | | USD 500.000 | Old Line Funding LLC 16/8/2022 (Zero Coupon) | 498.649 | 1,45 |
| USD 625.000 | Cancara Asset Securitisation LLC 23/8/2022 (Zero Coupon) | 622.839 | 1,81 | USD 430.000 | Ontario Teachers' Finance Trust 6/7/2022 (Zero Coupon) | 429.854 | 1,25 |
| | | 622.839 | 1,81 | USD 250.000 | Regatta Funding Co LLC 1/8/2022 (Zero Coupon) | 249.839 | 0,72 |
| Neuseeland | | | | | | | |
| USD 350.000 | ASB Finance Ltd 2/8/2022 (Zero Coupon) | 349.879 | 1,02 | | | | |
| | | 349.879 | 1,02 | | | | |
| Norwegen | | | | | | | |
| USD 250.000 | DNB Bank ASA 2/3/2023 (Zero Coupon) | 247.146 | 0,72 | | | | |
| | | 247.146 | 0,72 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| USD 250.000 | Siemens Capital Co LLC 28/6/2022 (Zero Coupon) | 249.829 | 0,72 |
| USD 500.000 | Societe Generale SA 24/6/2022 (Zero Coupon) | 499.709 | 1,45 |
| USD 500.000 | ST Engineering North America Inc 17/6/2022 (Zero Coupon) | 499.800 | 1,45 |
| USD 250.000 | Starbird Funding Corp 1,23% 8/7/2022 | 250.000 | 0,73 |
| USD 500.000 | Swedbank AB FRN 23/11/2022 | 500.000 | 1,45 |
| USD 250.000 | Thunder Bay Funding LLC 1/7/2022 (Zero Coupon) | 249.833 | 0,72 |
| USD 750.000 | Thunder Bay Funding LLC 22/7/2022 (Zero Coupon) | 748.672 | 2,17 |
| USD 250.000 | Thunder Bay Funding LLC 7/11/2022 (Zero Coupon) | 247.770 | 0,72 |
| USD 500.000 | United Overseas Bank Ltd FRN 27/10/2022 | 500.000 | 1,45 |
| USD 500.000 | Versailles Commercial Paper LLC 12/7/2022 (Zero Coupon) | 499.391 | 1,45 |
| USD 500.000 | Walmart Inc 13/6/2022 (Zero Coupon) | 499.862 | 1,45 |
| | | 14.797.455 | 42,97 |
| Gesamt kurzfristige Titel | | 23.648.899 | 68,67 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 33.491.065 | 97,24 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 33.491.065 | 97,24 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 950.271 | 2,76 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | 34.441.336 | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|---|-------------|---|-------------------------------|------------------------------------|-------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | 1.108 | Australian Ethical Investment Ltd | JP Morgan | 346 |
| | Australien | | | (3.030) | Australian Strategic Materials Ltd | Citibank | (135) |
| (3.145) | 29Metals Ltd | Citibank | 144 | (1.615) | Australian Strategic Materials Ltd | JP Morgan | 172 |
| (5.271) | a2 Milk Co Ltd | JP Morgan | (3.077) | (3.151) | Bank of Queensland Ltd | HSBC | (268) |
| 26.616 | Abacus Property Group (REIT) | Citibank | (38) | (1.009) | Bapcor Ltd | HSBC | (130) |
| 28.042 | Abacus Property Group (REIT) | JP Morgan | 35 | (1.644) | Bapcor Ltd | JP Morgan | (90) |
| (11.842) | Adairs Ltd | Citibank | 234 | 14.779 | Beach Energy Ltd | JP Morgan | 975 |
| (43.990) | Adairs Ltd | JP Morgan | 5.462 | (35.781) | Bega Cheese Ltd | HSBC | (3.376) |
| 24.718 | Adbri Ltd | Citibank | 298 | (98.139) | Bega Cheese Ltd | JP Morgan | (3.672) |
| (6.000) | Adbri Ltd | HSBC | 253 | (26.665) | Bellevue Gold Ltd | HSBC | (1.316) |
| (3.827) | Adbri Ltd | JP Morgan | 297 | (45.325) | Bellevue Gold Ltd | JP Morgan | (1.434) |
| 16.019 | Adbri Ltd | JP Morgan | (1.245) | (5.019) | Bendigo & Adelaide Bank Ltd | JP Morgan | (581) |
| 365 | Allkem Ltd | JP Morgan | 768 | (880) | Blackmores Ltd | HSBC | (2.871) |
| 2.274 | ALS Ltd | Citibank | 1.220 | (951) | Blackmores Ltd | JP Morgan | (2.302) |
| 3.984 | ALS Ltd | HSBC | 1.783 | 180 | Block Inc - CDI 'A' | Citibank | 1.265 |
| 3.562 | ALS Ltd | JP Morgan | 1.059 | 38 | Block Inc - CDI 'A' | HSBC | 53 |
| (732) | Altium Ltd | HSBC | 255 | (106) | BlueScope Steel Ltd | HSBC | (45) |
| (171) | Altium Ltd | JP Morgan | 103 | (2.523) | BlueScope Steel Ltd | JP Morgan | (515) |
| (752) | Alumina Ltd | HSBC | (2) | 14.214 | Boral Ltd | Citibank | 88 |
| (24.372) | Alumina Ltd | JP Morgan | 460 | 20.227 | Boral Ltd | HSBC | (2.398) |
| 51.865 | AMA Group Ltd | Citibank | (1.401) | 6.956 | Boral Ltd | JP Morgan | (849) |
| (927) | Amcor Plc - CDI | HSBC | (497) | (424) | Brambles Ltd | Citibank | 104 |
| (4.502) | Amcor Plc - CDI | JP Morgan | (1.435) | (5.236) | Brambles Ltd | HSBC | 329 |
| (68.838) | AMP Ltd | HSBC | 1.223 | (848) | Brambles Ltd | JP Morgan | 76 |
| (34.945) | AMP Ltd | JP Morgan | 1.318 | (7.184) | Bravura Solutions Ltd | JP Morgan | 40 |
| 559 | Ampol Ltd | Citibank | 79 | 2.776 | Breville Group Ltd | Citibank | 1.959 |
| 1.569 | Ampol Ltd | JP Morgan | 537 | (281) | Breville Group Ltd | HSBC | 41 |
| (951) | Ansell Ltd | HSBC | (1.157) | (4.218) | Breville Group Ltd | JP Morgan | 1.734 |
| (3.179) | Ansell Ltd | JP Morgan | (2.861) | 1.119 | Breville Group Ltd | JP Morgan | (421) |
| 704 | APA Group (Unit) | Citibank | (181) | (1.062) | Brickworks Ltd | HSBC | 791 |
| 6.165 | APA Group (Unit) | JP Morgan | 1.722 | (10.071) | Brickworks Ltd | JP Morgan | 11.689 |
| (1.451) | Appen Ltd | HSBC | (164) | 12.446 | BWP Trust (REIT) | Citibank | 792 |
| (4.115) | Appen Ltd | JP Morgan | (146) | 7.918 | BWP Trust (REIT) | HSBC | 921 |
| (270) | ARB Corp Ltd | HSBC | (285) | (1.841) | BWX Ltd | Citibank | 61 |
| (343) | ARB Corp Ltd | JP Morgan | (233) | (33.391) | BWX Ltd | JP Morgan | (2.489) |
| 8.318 | Arena (REIT) | Citibank | 244 | (8.774) | Calix Ltd | Citibank | (3.733) |
| 1.383 | Arena (REIT) | HSBC | 117 | (700) | Calix Ltd | JP Morgan | (577) |
| 14.150 | Arena (REIT) | JP Morgan | 470 | (5.430) | Capricorn Metals Ltd | Citibank | (564) |
| 4.236 | Aristocrat Leisure Ltd | Citibank | (5.111) | (35.466) | Carnarvon Energy Ltd | Citibank | 73 |
| 963 | Aristocrat Leisure Ltd | JP Morgan | 1.899 | (2.826) | carsales.com Ltd | HSBC | (4.429) |
| (1.428) | ASX Ltd | JP Morgan | 1.860 | (366) | carsales.com Ltd | JP Morgan | (446) |
| 24.649 | Atlas Arteria Ltd (Unit) | HSBC | 9.687 | 11.476 | Centuria Industrial (REIT) | Citibank | 268 |
| 9.345 | Atlas Arteria Ltd (Unit) | JP Morgan | 2.906 | 32.758 | Centuria Industrial (REIT) | JP Morgan | (298) |
| 6.025 | AUB Group Ltd | Citibank | (1.075) | 23.208 | Centuria Office (REIT) | JP Morgan | 692 |
| 1.534 | AUB Group Ltd | HSBC | (2.563) | (3.023) | Chalice Mining Ltd | HSBC | (337) |
| 6.894 | AUB Group Ltd | JP Morgan | (15.701) | (13.221) | Chalice Mining Ltd | JP Morgan | (459) |
| 10.450 | Auckland International Airport Ltd | JP Morgan | 763 | (7.936) | Challenger Ltd | HSBC | (684) |
| (14.351) | Auckland International Airport Ltd | JP Morgan | (1.048) | (6.844) | Challenger Ltd | JP Morgan | 76 |
| (106.223) | Aurelia Metals Ltd | Citibank | 887 | (4.631) | Champion Iron Ltd | Citibank | 90 |
| (205.999) | Aurelia Metals Ltd | JP Morgan | 1.726 | (12.761) | Champion Iron Ltd | JP Morgan | (5.731) |
| 12.805 | Aurizon Holdings Ltd | Citibank | 532 | 10.696 | Charter Hall Long Wales (REIT) | Citibank | 586 |
| 5.391 | Aurizon Holdings Ltd | HSBC | 465 | 6.995 | Charter Hall Long Wales (REIT) | HSBC | 1.118 |
| 6.718 | Aurizon Holdings Ltd | JP Morgan | 256 | (8.059) | Charter Hall Long Wales (REIT) | HSBC | (1.361) |
| (346) | Aussie Broadband Ltd | Citibank | (4) | 22.006 | Charter Hall Long Wales (REIT) | JP Morgan | 2.240 |
| (8.115) | Austal Ltd | HSBC | (486) | (12.910) | Charter Hall Long Wales (REIT) | JP Morgan | (1.314) |
| (8.522) | Austal Ltd | JP Morgan | (311) | 24.365 | Charter Hall Retail (REIT) | Citibank | 884 |
| (926) | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | HSBC | (465) | 24.597 | Charter Hall Retail (REIT) | HSBC | 5.269 |
| (12.102) | Australian Agricultural Co Ltd | HSBC | (3.303) | 90.793 | Charter Hall Retail (REIT) | JP Morgan | 15.202 |
| (2.636) | Australian Agricultural Co Ltd | JP Morgan | (688) | | | | |
| 3.932 | Australian Ethical Investment Ltd | Citibank | 37 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|---|-------------|---|-------------------------------|---|-------------|---|
| Australien Fortsetzung | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| 2.524 | Charter Hall Social Infrastructure (REIT) | Citibank | 152 | 318 | Domino's Pizza Enterprises Ltd | JP Morgan | 446 |
| 7.189 | Charter Hall Social Infrastructure (REIT) | HSBC | 1.039 | (9.130) | Downer EDI Ltd | HSBC | (2.688) |
| 8.016 | Charter Hall Social Infrastructure (REIT) | JP Morgan | 252 | (3.949) | Downer EDI Ltd | JP Morgan | (903) |
| (2.666) | Chorus Ltd | HSBC | (479) | 14.836 | Eagers Automotive Ltd | Citibank | (574) |
| (1.042) | City Chic Collective Ltd | Citibank | 79 | 737 | Eagers Automotive Ltd | HSBC | (284) |
| (1.725) | City Chic Collective Ltd | HSBC | (81) | 6.317 | Eagers Automotive Ltd | JP Morgan | (2.464) |
| (21.241) | City Chic Collective Ltd | JP Morgan | (389) | 10.175 | Eclipx Group Ltd | Citibank | (1.139) |
| (37.005) | Cleanaway Waste Management Ltd | HSBC | (1.929) | 8.422 | Eclipx Group Ltd | HSBC | (1.106) |
| (47.277) | Cleanaway Waste Management Ltd | JP Morgan | (756) | 30.839 | Eclipx Group Ltd | JP Morgan | (4.703) |
| 779 | Clinuvel Pharmaceuticals Ltd | Citibank | (431) | 12.816 | Elders Ltd | Citibank | (13.144) |
| 1.229 | Clinuvel Pharmaceuticals Ltd | HSBC | 967 | 6.344 | Elders Ltd | HSBC | (1.388) |
| 977 | Clinuvel Pharmaceuticals Ltd | JP Morgan | 596 | 306 | Elders Ltd | JP Morgan | (118) |
| (121) | Cochlear Ltd | JP Morgan | (765) | 12.425 | EML Payments Ltd | Citibank | 392 |
| 1.324 | Coles Group Ltd | Citibank | (59) | (12.902) | EML Payments Ltd | JP Morgan | (882) |
| 4.224 | Coles Group Ltd | HSBC | (2.257) | 10.693 | EML Payments Ltd | JP Morgan | 587 |
| 1.721 | Coles Group Ltd | JP Morgan | (1.308) | (9.454) | Endeavour Group Ltd | HSBC | 1.111 |
| 315 | Collins Foods Ltd | Citibank | (81) | (8.762) | Endeavour Group Ltd | JP Morgan | 1.937 |
| 2.731 | Collins Foods Ltd | HSBC | (335) | (1.034) | Estia Health Ltd | Citibank | (38) |
| 5.514 | Collins Foods Ltd | JP Morgan | (1.040) | (40.510) | Estia Health Ltd | JP Morgan | (2.603) |
| 411 | Commonwealth Bank of Australia | HSBC | 1.333 | (143) | EVENT Hospitality and Entertainment Ltd | HSBC | (18) |
| 171 | Commonwealth Bank of Australia | JP Morgan | 344 | (2.349) | EVENT Hospitality and Entertainment Ltd | JP Morgan | (1.451) |
| 1.642 | Computershare Ltd | HSBC | 244 | 1.889 | Evolution Mining Ltd | Citibank | 211 |
| 390 | Computershare Ltd | JP Morgan | (193) | 8.808 | Evolution Mining Ltd | HSBC | 1.712 |
| 10.192 | Cooper Energy Ltd | Citibank | (18) | (7.770) | Fineos Corp Ltd - CDI | JP Morgan | (133) |
| 29.502 | Cooper Energy Ltd | JP Morgan | (43) | 348 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | Citibank | 38 |
| (585) | Corporate Travel Management Ltd | Citibank | (76) | 1.353 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | HSBC | 311 |
| (4.813) | Corporate Travel Management Ltd | HSBC | (5.156) | 4.968 | Fletcher Building Ltd | Citibank | (646) |
| (6.424) | Corporate Travel Management Ltd | JP Morgan | (5.054) | 577 | Flight Centre Travel Group Ltd | JP Morgan | (18) |
| (66.496) | Costa Group Holdings Ltd | JP Morgan | (10.595) | (4.206) | Fortescue Metals Group Ltd | JP Morgan | (2.085) |
| 679 | Credit Corp Group Ltd | Citibank | 363 | (88.568) | G8 Education Ltd | HSBC | (3.342) |
| (16.460) | Cromwell Property Group (REIT) | HSBC | (84) | (128.422) | G8 Education Ltd | JP Morgan | (2.976) |
| (17.977) | Cromwell Property Group (REIT) | JP Morgan | 82 | 124.905 | GDI Property Group Partnership (REIT) | Citibank | 3.868 |
| (959) | Crown Resorts Ltd | HSBC | (236) | 18.708 | GDI Property Group Partnership (REIT) | HSBC | 640 |
| (8.681) | Crown Resorts Ltd | JP Morgan | (797) | 54.973 | GDI Property Group Partnership (REIT) | JP Morgan | 1.032 |
| (167) | CSL Ltd | JP Morgan | (374) | (26.735) | Genworth Mortgage Insurance Australia Ltd | HSBC | (1.383) |
| 36.885 | CSR Ltd | Citibank | (9.582) | (2.973) | Genworth Mortgage Insurance Australia Ltd | JP Morgan | (47) |
| 3.715 | CSR Ltd | HSBC | (2.667) | 12.692 | Gold Road Resources Ltd | Citibank | 163 |
| 39.059 | CSR Ltd | JP Morgan | (30.772) | (18.417) | Gold Road Resources Ltd | HSBC | (429) |
| 3.048 | Data#3 Ltd | Citibank | (8) | 16.806 | Gold Road Resources Ltd | HSBC | 392 |
| 2.517 | Data#3 Ltd | HSBC | (532) | 14.166 | Gold Road Resources Ltd | JP Morgan | 1.347 |
| 7.935 | Data#3 Ltd | JP Morgan | (2.182) | 8.924 | Goodman Group (REIT) | Citibank | 9.837 |
| (31.642) | De Grey Mining Ltd | HSBC | (2.207) | 1.301 | Goodman Group (REIT) | HSBC | 1.792 |
| (11.263) | De Grey Mining Ltd | JP Morgan | (538) | 10.975 | GPT Group (REIT) | HSBC | 1.653 |
| 5.698 | Deterra Royalties Ltd | Citibank | (110) | 7.649 | GPT Group (REIT) | JP Morgan | 1.610 |
| 1.744 | Deterra Royalties Ltd | HSBC | 111 | 4.158 | GrainCorp Ltd 'A' | Citibank | (47) |
| 11.256 | Deterra Royalties Ltd | JP Morgan | (71) | 3.000 | GrainCorp Ltd 'A' | HSBC | (1.053) |
| 797 | Dexus (REIT) | Citibank | (28) | 5.020 | GrainCorp Ltd 'A' | JP Morgan | (2.401) |
| 10.418 | Dexus (REIT) | JP Morgan | (1.157) | 74.968 | Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT) | Citibank | 7.867 |
| 42.825 | Domain Holdings Australia Ltd | Citibank | (1.809) | 16.609 | Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT) | HSBC | 2.793 |
| 10.797 | Domain Holdings Australia Ltd | HSBC | 259 | 20.371 | Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT) | JP Morgan | 2.497 |
| 53.645 | Domain Holdings Australia Ltd | JP Morgan | (229) | (2.568) | GUD Holdings Ltd | HSBC | 65 |
| | | | | (3.863) | GUD Holdings Ltd | JP Morgan | 646 |
| | | | | (5.328) | Hansen Technologies Ltd | JP Morgan | (399) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|---|-------------|---|-------------------------------|----------------------------------|-------------|---|
| Australien Fortsetzung | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| (4.776) | Harvey Norman Holdings Ltd | HSBC | 288 | (2.200) | Kelsian Group Ltd | HSBC | 242 |
| (7.395) | Harvey Norman Holdings Ltd | JP Morgan | 853 | (23.798) | Kelsian Group Ltd | JP Morgan | 4.873 |
| (8.657) | Healius Ltd | HSBC | (984) | 1.598 | Kogan.com Ltd | JP Morgan | (22) |
| (24.713) | Healius Ltd | JP Morgan | (4.355) | (4.551) | Lendlease Corp Ltd (Unit) | JP Morgan | 1.562 |
| (18.478) | HomeCo Daily Needs (REIT) | HSBC | (1.194) | (2.353) | Life360 Inc - CDI | Citibank | 225 |
| 11.473 | Hotel Property Investments (REIT) | Citibank | 689 | (212) | Life360 Inc - CDI | HSBC | (107) |
| 25.361 | Hotel Property Investments (REIT) | JP Morgan | 163 | (903) | Life360 Inc - CDI | JP Morgan | (423) |
| (717) | HUB24 Ltd | Citibank | 213 | (705) | Lifestyle Communities Ltd | HSBC | (950) |
| (1.741) | HUB24 Ltd | HSBC | 248 | (1.415) | Lifestyle Communities Ltd | JP Morgan | (1.586) |
| (1.476) | HUB24 Ltd | JP Morgan | 275 | (16.676) | Link Administration Holdings Ltd | JP Morgan | 5.119 |
| 382 | IDP Education Ltd | JP Morgan | 11 | (383) | Liontown Resources Ltd | Citibank | (36) |
| 3.934 | IGO Ltd | JP Morgan | 3.009 | (16.014) | Liontown Resources Ltd | HSBC | (2.179) |
| 204 | Iluka Resources Ltd | HSBC | 113 | (13.205) | Liontown Resources Ltd | JP Morgan | (1.598) |
| 2.331 | Iluka Resources Ltd | JP Morgan | 992 | (2.033) | Lottery Corp Ltd | HSBC | (6.917) |
| 8.716 | Imdex Ltd | Citibank | 891 | (18.886) | Lottery Corp Ltd | JP Morgan | (64.262) |
| 777 | Imdex Ltd | HSBC | 58 | 566 | Lovisa Holdings Ltd | Citibank | 226 |
| 27.526 | Incitec Pivot Ltd | Citibank | (851) | 1.405 | Lovisa Holdings Ltd | HSBC | (165) |
| 2.717 | Incitec Pivot Ltd | HSBC | (419) | 1.252 | Lovisa Holdings Ltd | JP Morgan | (413) |
| 14.658 | Incitec Pivot Ltd | JP Morgan | (2.274) | (3.248) | Lynas Rare Earths Ltd | HSBC | (3.646) |
| (50.537) | Infomedia Ltd | JP Morgan | (20.225) | (3.889) | Lynas Rare Earths Ltd | JP Morgan | (3.968) |
| (4.055) | Ingenia Communities Group (REIT) | HSBC | (753) | 1.792 | Macquarie Group Ltd | JP Morgan | 7.631 |
| (49.409) | Ingenia Communities Group (REIT) | JP Morgan | (6.848) | (2.102) | Magellan Financial Group Ltd | Citibank | (927) |
| (32.595) | Inghams Group Ltd | Citibank | (2.022) | (68) | Magellan Financial Group Ltd | HSBC | 8 |
| (57.397) | Inghams Group Ltd | HSBC | (7.997) | (2.163) | Magellan Financial Group Ltd | JP Morgan | (77) |
| (22.686) | Inghams Group Ltd | JP Morgan | (2.592) | 890 | Marley Spoon AG - CDI | Citibank | (23) |
| 4.658 | Insignia Financial Ltd | Citibank | 238 | 12.138 | Marley Spoon AG - CDI | HSBC | (342) |
| 3.148 | Insignia Financial Ltd | JP Morgan | 181 | 15.046 | Marley Spoon AG - CDI | JP Morgan | (495) |
| (8.018) | Insurance Australia Group Ltd | HSBC | 709 | 63.263 | Mayne Pharma Group Ltd | JP Morgan | 1.047 |
| (4.595) | Insurance Australia Group Ltd | JP Morgan | 661 | 2.082 | McMillan Shakespeare Ltd | Citibank | 1.025 |
| (20.360) | Integral Diagnostics Ltd | HSBC | 290 | 1.524 | McMillan Shakespeare Ltd | HSBC | 950 |
| (55.660) | Integral Diagnostics Ltd | JP Morgan | 3.230 | 923 | McMillan Shakespeare Ltd | JP Morgan | 451 |
| 29.809 | Investec Australia Property Fund (REIT) | JP Morgan | 284 | (16.705) | Medibank Pvt Ltd | HSBC | (1.720) |
| (2.636) | InvoCare Ltd | HSBC | 1.799 | (7.745) | Medibank Pvt Ltd | JP Morgan | (391) |
| (23.110) | InvoCare Ltd | JP Morgan | 19.604 | (388) | Megaport Ltd | Citibank | 36 |
| (19.141) | ioneer Ltd | HSBC | (1.043) | (2.405) | Megaport Ltd | HSBC | (333) |
| (99.981) | ioneer Ltd | JP Morgan | (4.486) | (8.838) | Megaport Ltd | JP Morgan | (121) |
| (4.352) | IPH Ltd | HSBC | (2.045) | (223) | Mineral Resources Ltd | JP Morgan | (1.712) |
| (1.459) | IPH Ltd | JP Morgan | (511) | 12.164 | Mirvac Group (REIT) | Citibank | 792 |
| (9.046) | IRESS Ltd | HSBC | (1.045) | 12.469 | Mirvac Group (REIT) | HSBC | 747 |
| (30.917) | IRESS Ltd | JP Morgan | 362 | 27.947 | Mirvac Group (REIT) | JP Morgan | 1.843 |
| 727 | James Hardie Industries Plc - CDI | Citibank | (933) | 674 | Monadelphous Group Ltd | Citibank | 440 |
| 352 | James Hardie Industries Plc - CDI | HSBC | (332) | 2.885 | Monadelphous Group Ltd | JP Morgan | 2.565 |
| 3.907 | James Hardie Industries Plc - CDI | JP Morgan | (5.490) | 22.592 | Money3 Corp Ltd | Citibank | 3.246 |
| (1.417) | Janus Henderson Group Plc - CDI | HSBC | (1.474) | 13.674 | Money3 Corp Ltd | HSBC | 1.004 |
| (1.719) | Janus Henderson Group Plc - CDI | JP Morgan | (1.018) | 17.485 | Money3 Corp Ltd | JP Morgan | 808 |
| 468 | JB Hi-Fi Ltd | JP Morgan | (499) | (5.854) | Mount Gibson Iron Ltd | Citibank | 56 |
| 19.034 | Judo Capital Holdings Ltd | Citibank | 907 | 3.684 | Nanosonics Ltd | Citibank | 148 |
| 12.081 | Judo Capital Holdings Ltd | JP Morgan | 2.096 | (12.315) | Nanosonics Ltd | JP Morgan | (4.124) |
| 5.084 | Jumbo Interactive Ltd | Citibank | (1.225) | 511 | Nanosonics Ltd | JP Morgan | 171 |
| 469 | Jumbo Interactive Ltd | HSBC | 24 | (2.461) | National Australia Bank Ltd | HSBC | (1.132) |
| 2.249 | Jumbo Interactive Ltd | JP Morgan | (317) | (2.592) | National Australia Bank Ltd | JP Morgan | 201 |
| (10.957) | Karoon Energy Ltd | HSBC | (1.956) | 26.794 | National Storage (REIT) | Citibank | 1.773 |
| (6.417) | Karoon Energy Ltd | JP Morgan | (625) | 14.501 | National Storage (REIT) | JP Morgan | 1.505 |
| (394) | Kelsian Group Ltd | Citibank | 2 | (19.772) | Nearmap Ltd | HSBC | (1.723) |
| | | | | (246) | Newcrest Mining Ltd | HSBC | (118) |
| | | | | (1.662) | Newcrest Mining Ltd | JP Morgan | 724 |
| | | | | (3.651) | NEXTDC Ltd | HSBC | (2.984) |
| | | | | (4.679) | NEXTDC Ltd | JP Morgan | (3.254) |
| | | | | 1.069 | nib holdings Ltd | Citibank | 198 |
| | | | | 2.933 | nib holdings Ltd | HSBC | 743 |
| | | | | (2.505) | nib holdings Ltd | JP Morgan | (605) |
| | | | | (24.352) | Nickel Mines Ltd | HSBC | (2.337) |
| | | | | (43.513) | Nickel Mines Ltd | JP Morgan | (3.514) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return

Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|--|-------------|---|-------------------------------|--|-------------|---|
| Australien Fortsetzung | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| (781) | Nine Entertainment Co Holdings Ltd | HSBC | 48 | (5.416) | Ramelius Resources Ltd | JP Morgan | 61 |
| (3.845) | Nine Entertainment Co Holdings Ltd | JP Morgan | 344 | (1.602) | Ramsay Health Care Ltd | JP Morgan | (304) |
| (1.438) | Northern Star Resources Ltd | HSBC | (143) | 200 | REA Group Ltd | HSBC | 1.188 |
| 20.369 | NRW Holdings Ltd | Citibank | 641 | (51.436) | Red 5 Ltd | Citibank | (866) |
| 1.790 | NRW Holdings Ltd | HSBC | 190 | (86.968) | Red 5 Ltd | JP Morgan | (3.346) |
| 17.033 | NRW Holdings Ltd | JP Morgan | 1.484 | (1.992) | Reece Ltd | HSBC | 38 |
| 13.397 | Nufarm Ltd | Citibank | (188) | (1.242) | Reece Ltd | JP Morgan | 47 |
| 6.679 | Nufarm Ltd | HSBC | (4.230) | (24.059) | Regis Resources Ltd | HSBC | (3.720) |
| 17.802 | Nufarm Ltd | JP Morgan | (14.003) | (40.068) | Regis Resources Ltd | JP Morgan | (5.176) |
| (29.371) | Omni Bridgeway Ltd | HSBC | (2.975) | (27.292) | Reliance Worldwide Corp Ltd | HSBC | 1.508 |
| 5.898 | oOh!media Ltd | Citibank | (532) | (17.119) | Reliance Worldwide Corp Ltd | JP Morgan | 1.475 |
| 10.023 | oOh!media Ltd | JP Morgan | (210) | (560) | ResMed Inc - CDI | HSBC | (635) |
| 1.033 | Orica Ltd | Citibank | 99 | 80.660 | Resolute Mining Ltd | Citibank | (1.941) |
| 1.446 | Orica Ltd | HSBC | 117 | 18.353 | Resolute Mining Ltd | HSBC | (349) |
| 954 | Orica Ltd | JP Morgan | 296 | 371.442 | Resolute Mining Ltd | JP Morgan | (8.446) |
| 34.415 | Orora Ltd | Citibank | 2.386 | (219) | Rio Tinto Ltd | JP Morgan | (1.383) |
| 622 | Orora Ltd | HSBC | 57 | (569) | Rural Funds Group (REIT) | Citibank | (20) |
| 13.184 | Orora Ltd | JP Morgan | 585 | (6.870) | Rural Funds Group (REIT) | HSBC | (665) |
| (751) | Pact Group Holdings Ltd | HSBC | (59) | (2.360) | Rural Funds Group (REIT) | JP Morgan | (170) |
| (2.713) | Pact Group Holdings Ltd | JP Morgan | (142) | 12.663 | Sandfire Resources Ltd | Citibank | 1.556 |
| (95.771) | Paladin Energy Ltd | Citibank | (4.603) | 3.182 | Sandfire Resources Ltd | HSBC | 1.651 |
| (17.425) | Paladin Energy Ltd | HSBC | (1.438) | 22.227 | Sandfire Resources Ltd | JP Morgan | 5.436 |
| (10.399) | Paladin Energy Ltd | JP Morgan | (581) | (1.482) | Santos Ltd | HSBC | (364) |
| (5.532) | Pendal Group Ltd | HSBC | (1.574) | (10.837) | Santos Ltd | JP Morgan | (1.608) |
| (10.917) | Pendal Group Ltd | JP Morgan | (2.467) | 25.672 | Scentre Group (REIT) | Citibank | 684 |
| 31.778 | Perenti Global Ltd | Citibank | (873) | 6.487 | Scentre Group (REIT) | HSBC | 1.046 |
| 25.967 | Perenti Global Ltd | HSBC | (382) | (504) | SEEK Ltd | JP Morgan | 31 |
| 34.478 | Perenti Global Ltd | JP Morgan | (68) | (682) | Select Harvests Ltd | Citibank | 70 |
| (126) | Perpetual Ltd | Citibank | (52) | (7.345) | Select Harvests Ltd | HSBC | (447) |
| 2.065 | Perpetual Ltd | Citibank | 854 | (34.069) | Select Harvests Ltd | JP Morgan | 635 |
| (304) | Perpetual Ltd | HSBC | (178) | (632) | Seven Group Holdings Ltd | HSBC | 101 |
| 125 | Perpetual Ltd | HSBC | 115 | (13.621) | Seven Group Holdings Ltd | JP Morgan | 5.381 |
| 2.550 | Perpetual Ltd | JP Morgan | 495 | 111.771 | Shopping Centres Australasia Property Group (REIT) | Citibank | 668 |
| 11.672 | Perseus Mining Ltd | Citibank | 1.191 | 5.083 | Shopping Centres Australasia Property Group (REIT) | HSBC | 830 |
| 34.245 | Perseus Mining Ltd | JP Morgan | 3.765 | 98.198 | Shopping Centres Australasia Property Group (REIT) | JP Morgan | 12.706 |
| (5.442) | Pinnacle Investment Management Group Ltd | HSBC | (478) | (16.285) | Sigma Healthcare Ltd | HSBC | (388) |
| (966) | Pinnacle Investment Management Group Ltd ^{tr} | JP Morgan | — | (101.069) | Sigma Healthcare Ltd | JP Morgan | (1.825) |
| 58.643 | Platinum Asset Management Ltd | Citibank | 1.981 | (4.828) | Silver Lake Resources Ltd | HSBC | (374) |
| (8.688) | Platinum Asset Management Ltd | HSBC | (564) | 14.648 | Silver Lake Resources Ltd | JP Morgan | 750 |
| 15.853 | Platinum Asset Management Ltd | HSBC | 1.214 | (30.002) | Silver Lake Resources Ltd | JP Morgan | (1.960) |
| 15.872 | Platinum Asset Management Ltd | JP Morgan | 731 | 2.452 | Sims Ltd | Citibank | 709 |
| (2.569) | PointsBet Holdings Ltd | Citibank | (691) | (417) | Sims Ltd | HSBC | 111 |
| (7.392) | PointsBet Holdings Ltd | HSBC | (1.826) | 207 | Sims Ltd | HSBC | (55) |
| (4.109) | PointsBet Holdings Ltd | JP Morgan | (882) | 741 | Sims Ltd | JP Morgan | (362) |
| (18.145) | PolyNovo Ltd | Citibank | (281) | 8.591 | SiteMinder Ltd | Citibank | (1.502) |
| 23.049 | PolyNovo Ltd | Citibank | 357 | 3.521 | SiteMinder Ltd | JP Morgan | 260 |
| (5.862) | PolyNovo Ltd | HSBC | (1.391) | (7.574) | SKY Network Television Ltd | HSBC | (1.160) |
| 7.008 | PolyNovo Ltd | HSBC | 1.663 | (15.994) | SKYCITY Entertainment Group Ltd | JP Morgan | 1.408 |
| (1.608) | PolyNovo Ltd | JP Morgan | (364) | (2.545) | Sonic Healthcare Ltd | HSBC | (869) |
| 11.055 | PolyNovo Ltd | JP Morgan | 2.500 | 7.405 | South32 Ltd | Citibank | 1.989 |
| (2.076) | Premier Investments Ltd | HSBC | (106) | 16.016 | South32 Ltd | JP Morgan | 4.825 |
| 2.053 | Pro Medicus Ltd | Citibank | 939 | 4.938 | Southern Cross Media Group Ltd | JP Morgan | (402) |
| 325 | Pro Medicus Ltd | HSBC | 546 | (25.182) | SpeedCast International Ltd ^{tr} | Citibank | — |
| 4.030 | Pro Medicus Ltd | JP Morgan | 5.228 | (42.399) | SpeedCast International Ltd ^{tr} | HSBC | 23.384 |
| 8.645 | Qantas Airways Ltd | Citibank | 631 | 16.529 | St Barbara Ltd | Citibank | 260 |
| 4.960 | Qantas Airways Ltd | HSBC | 379 | 20.607 | St Barbara Ltd | HSBC | 1.738 |
| 709 | QBE Insurance Group Ltd | Citibank | (48) | 18.100 | St Barbara Ltd | JP Morgan | 1.408 |
| 2.432 | QBE Insurance Group Ltd | HSBC | (244) | (912) | Star Entertainment Grp Ltd | HSBC | (41) |
| 1.634 | QBE Insurance Group Ltd | JP Morgan | (186) | | | | |
| 45.153 | Qube Holdings Ltd | JP Morgan | 12.287 | | | | |
| (39.286) | Ramelius Resources Ltd | HSBC | (1.093) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|-------------|---|-----------------------------|---|-------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| 16.000 | Angang Steel Co Ltd 'H' | HSBC | 63 | 1.500 | Brii Biosciences Ltd | Citibank | (91) |
| 60.000 | Angang Steel Co Ltd 'H' | JP Morgan | 240 | (82.000) | Brilliance China Automotive Holdings Ltd | Citibank | 67.647 |
| (6.000) | Anhui Conch Cement Co Ltd 'H' | HSBC | 830 | (8.000) | Brilliance China Automotive Holdings Ltd | JP Morgan | 6.672 |
| 42.000 | Anhui Expressway Co Ltd 'H' | Citibank | (1.221) | 35.800 | Budweiser Brewing Co APAC Ltd | Citibank | 5.544 |
| 10.000 | Anhui Expressway Co Ltd 'H' | HSBC | 194 | 3.500 | Budweiser Brewing Co APAC Ltd | HSBC | 694 |
| 48.000 | Anhui Expressway Co Ltd 'H' | JP Morgan | 932 | 11.400 | Budweiser Brewing Co APAC Ltd | JP Morgan | 2.261 |
| 800 | ANTA Sports Products Ltd | Citibank | 853 | 500 | BYD Co Ltd 'H' | JP Morgan | 4.146 |
| 1.000 | ANTA Sports Products Ltd | HSBC | 1.061 | (23.000) | C&D International Investment Group Ltd | HSBC | 3.909 |
| 3.000 | ANTA Sports Products Ltd | JP Morgan | 3.184 | (4.000) | Cafe de Coral Holdings Ltd | HSBC | 39 |
| 33.000 | Aoyuan Healthy Life Group Co Ltd | Citibank | (895) | (600) | CanSino Biologics Inc 'H' | Citibank | (655) |
| 21.000 | Aoyuan Healthy Life Group Co Ltd | HSBC | (569) | 20.000 | CARsgen Therapeutics Holdings Ltd | Citibank | (2.388) |
| 80.000 | Aoyuan Healthy Life Group Co Ltd | JP Morgan | (2.169) | 3.000 | CARsgen Therapeutics Holdings Ltd | HSBC | 223 |
| (13.000) | Archosaur Games Inc | Citibank | 1.107 | 26.000 | CARsgen Therapeutics Holdings Ltd | JP Morgan | 1.933 |
| (6.000) | Archosaur Games Inc | JP Morgan | 595 | 4.000 | Cathay Pacific Airways Ltd | Citibank | 179 |
| 1.400 | Ascentage Pharma Group International | Citibank | 144 | 1.000 | Cathay Pacific Airways Ltd | HSBC | 51 |
| 1.100 | Ascentage Pharma Group International | JP Morgan | 763 | 147.000 | Cathay Pacific Airways Ltd | JP Morgan | 7.543 |
| (11.600) | AsialInfo Technologies Ltd | JP Morgan | (184) | (515.000) | CGN Mining Co Ltd | Citibank | (5.919) |
| 13.000 | ASM Pacific Technology Ltd | Citibank | (216) | (35.000) | CGN Mining Co Ltd | JP Morgan | (269) |
| 1.100 | ASM Pacific Technology Ltd | HSBC | (984) | (14.000) | CGN New Energy Holdings Co Ltd | Citibank | (483) |
| 3.400 | ASM Pacific Technology Ltd | JP Morgan | (3.042) | (54.000) | CGN New Energy Holdings Co Ltd | JP Morgan | (4.825) |
| 200 | Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd 'H' | Citibank | 205 | (97.000) | Champion (REIT) | Citibank | (1.124) |
| 600 | Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd 'H' | HSBC | 734 | (16.000) | Champion (REIT) | HSBC | (492) |
| 1.100 | Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd 'H' | JP Morgan | 2.214 | 12.500 | Chaoju Eye Care Holdings Ltd | Citibank | (94) |
| 46.000 | BAIC Motor Corp Ltd 'H' | Citibank | 531 | 3.500 | Chaoju Eye Care Holdings Ltd | HSBC | 45 |
| 59.000 | BAIC Motor Corp Ltd 'H' | HSBC | 1.810 | 14.500 | Chaoju Eye Care Holdings Ltd | JP Morgan | 187 |
| 50.000 | BAIC Motor Corp Ltd 'H' | JP Morgan | 1.534 | 139.500 | Cheerwin Group Ltd | Citibank | 1.077 |
| 2.000 | Bairong Inc | JP Morgan | (142) | 5.000 | Cheerwin Group Ltd | HSBC | (6) |
| 84.800 | Bank of East Asia Ltd | Citibank | 681 | 209.000 | Cheerwin Group Ltd | JP Morgan | (245) |
| 11.400 | Bank of East Asia Ltd | HSBC | (81) | 95.000 | China Aoyuan Group Ltd | Citibank | (1.635) |
| 145.000 | Bank of East Asia Ltd | JP Morgan | (1.036) | 24.000 | China Aoyuan Group Ltd | HSBC | (413) |
| 23.000 | BBMG Corp 'H' | Citibank | (58) | 23.000 | China Aoyuan Group Ltd | JP Morgan | (396) |
| 23.000 | BBMG Corp 'H' | JP Morgan | (292) | 26.000 | China Bohai Bank Co Ltd 'H' | Citibank | 34 |
| (100.000) | Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H' | Citibank | (4.347) | 8.500 | China Bohai Bank Co Ltd 'H' | JP Morgan | (10) |
| (10.000) | Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H' | HSBC | (715) | (239.000) | China Cinda Asset Management Co Ltd 'H' | Citibank | (1.229) |
| (12.000) | Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H' | JP Morgan | (858) | (98.000) | China Cinda Asset Management Co Ltd 'H' | JP Morgan | (880) |
| 500 | Beijing Enterprises Holdings Ltd | Citibank | 45 | 11.000 | China CITIC Bank Corp Ltd 'H' | Citibank | 114 |
| 4.000 | Beijing Enterprises Holdings Ltd | HSBC | 922 | 15.000 | China CITIC Bank Corp Ltd 'H' | HSBC | 308 |
| 500 | Beijing Enterprises Holdings Ltd | JP Morgan | 115 | 24.000 | China CITIC Bank Corp Ltd 'H' | JP Morgan | 493 |
| 14.000 | Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd 'H' | Citibank | 72 | (8.500) | China Conch Environment Protection Holdings Ltd | Citibank | 722 |
| 2.000 | Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd 'H' | HSBC | 8 | (10.000) | China Conch Environment Protection Holdings Ltd | HSBC | 1.395 |
| 98.000 | Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd 'H' | JP Morgan | 383 | (22.000) | China Conch Venture Holdings Ltd | Citibank | 685 |
| (2.400) | BOC Aviation Ltd | Citibank | (953) | (10.000) | China Conch Venture Holdings Ltd | JP Morgan | (200) |
| (1.300) | BOC Aviation Ltd | JP Morgan | (840) | 7.000 | China Construction Bank Corp 'H' | Citibank | 207 |
| (41.500) | BOC Hong Kong Holdings Ltd | Citibank | (4.537) | | | | |
| (6.000) | BOC Hong Kong Holdings Ltd | JP Morgan | (658) | | | | |
| (4.000) | BOE Varitronix Ltd | Citibank | (623) | | | | |
| (1.000) | BOE Varitronix Ltd | JP Morgan | (189) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|-------------|---|-----------------------------|---|-------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| 37.000 | China Construction Bank Corp 'H' | HSBC | 1.612 | 13.000 | China Merchants Bank Co Ltd 'H' | JP Morgan | 12.414 |
| (46.000) | China Datang Corp Renewable Power Co Ltd 'H' | Citibank | 274 | 10.000 | China Merchants Port Holdings Co Ltd | Citibank | 566 |
| (6.000) | China Datang Corp Renewable Power Co Ltd 'H' | JP Morgan | (60) | 6.000 | China Merchants Port Holdings Co Ltd | HSBC | 1.181 |
| 10.500 | China East Education Holdings Ltd | Citibank | 68 | 10.000 | China Merchants Port Holdings Co Ltd | JP Morgan | 1.747 |
| 2.500 | China East Education Holdings Ltd | HSBC | 64 | 407.500 | China Minsheng Banking Corp Ltd 'H' | Citibank | 2.119 |
| 39.000 | China East Education Holdings Ltd | JP Morgan | 821 | 59.500 | China Minsheng Banking Corp Ltd 'H' | HSBC | 1.372 |
| 32.000 | China Education Group Holdings Ltd | Citibank | 1.351 | 16.500 | China Minsheng Banking Corp Ltd 'H' | JP Morgan | 381 |
| 23.000 | China Education Group Holdings Ltd | HSBC | (1.577) | 29.000 | China Modern Dairy Holdings Ltd | Citibank | 149 |
| 18.000 | China Education Group Holdings Ltd | JP Morgan | 579 | 16.000 | China Modern Dairy Holdings Ltd | HSBC | 143 |
| 12.000 | China Everbright Bank Co Ltd 'H' | JP Morgan | (228) | 6.000 | China Modern Dairy Holdings Ltd | JP Morgan | 54 |
| (137.000) | China Everbright Environment Group Ltd | Citibank | (1.942) | 93.000 | China Molybdenum Co Ltd 'H' | Citibank | 960 |
| (4.000) | China Everbright Environment Group Ltd | HSBC | (16) | 102.000 | China Molybdenum Co Ltd 'H' | HSBC | 3.451 |
| 5.000 | China Everbright Greentech Ltd | Citibank | 58 | 42.000 | China Molybdenum Co Ltd 'H' | JP Morgan | 1.073 |
| (3.000) | China Feihe Ltd | Citibank | (180) | (28.000) | China National Building Material Co Ltd 'H' | Citibank | (366) |
| 14.500 | China Galaxy Securities Co Ltd 'H' | Citibank | 298 | 23.000 | China New Higher Education Group Ltd | Citibank | (27) |
| 23.000 | China Galaxy Securities Co Ltd 'H' | HSBC | 737 | 8.000 | China New Higher Education Group Ltd | HSBC | (81) |
| 7.000 | China Galaxy Securities Co Ltd 'H' | JP Morgan | 224 | 52.000 | China New Higher Education Group Ltd | JP Morgan | (524) |
| 3.200 | China Gas Holdings Ltd | Citibank | 295 | (64.000) | China Nonferrous Mining Corp Ltd | Citibank | (1.797) |
| 2.600 | China Gas Holdings Ltd | HSBC | 806 | (32.000) | China Nonferrous Mining Corp Ltd | JP Morgan | (2.931) |
| (22.000) | China Glass Holdings Ltd | Citibank | (422) | (3.500) | China Overseas Land & Investment Ltd | Citibank | 399 |
| 13.500 | China Hongqiao Group Ltd | Citibank | (219) | (9.500) | China Overseas Land & Investment Ltd | JP Morgan | 1.019 |
| 15.000 | China Hongqiao Group Ltd | HSBC | 1.955 | (400) | China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H' | HSBC | (86) |
| 31.500 | China Hongqiao Group Ltd | JP Morgan | 4.107 | (3.200) | China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | (687) |
| 6.000 | China International Capital Corp Ltd 'H' | Citibank | 370 | 78.000 | China Petroleum & Chemical Corp 'H' | JP Morgan | (384) |
| 6.400 | China International Capital Corp Ltd 'H' | JP Morgan | 562 | (18.000) | China Power International Development Ltd | Citibank | (2) |
| (14.200) | China Isotope & Radiation Corp | Citibank | 1.257 | (45.000) | China Power International Development Ltd | JP Morgan | (2.473) |
| (11.000) | China Isotope & Radiation Corp | JP Morgan | 299 | (12.000) | China Reinsurance Group Corp 'H' | JP Morgan | (31) |
| (14.000) | China Jinmao Holdings Group Ltd | Citibank | 195 | (34.000) | China Resources Cement Holdings Ltd | Citibank | (440) |
| 56.000 | China Kepei Education Group Ltd | Citibank | (68) | (66.000) | China Resources Cement Holdings Ltd | JP Morgan | (1.784) |
| 4.000 | China Kepei Education Group Ltd | HSBC | (168) | 4.000 | China Resources Gas Group Ltd | JP Morgan | 2.019 |
| 8.000 | China Kepei Education Group Ltd | JP Morgan | (336) | (8.000) | China Resources Land Ltd | Citibank | 704 |
| (40.000) | China Life Insurance Co Ltd 'H' | Citibank | (2.463) | 3.500 | China Resources Medical Holdings Co Ltd | Citibank | (35) |
| (1.800) | China Literature Ltd | Citibank | (426) | 17.000 | China Resources Medical Holdings Co Ltd | HSBC | 287 |
| (4.400) | China Literature Ltd | JP Morgan | (1.464) | 26.500 | China Resources Medical Holdings Co Ltd | JP Morgan | 515 |
| (35.000) | China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H' | Citibank | (3.944) | 1.800 | China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd | Citibank | (112) |
| (2.000) | China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H' | HSBC | (572) | | | | |
| (1.000) | China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H' | JP Morgan | (286) | | | | |
| (19.000) | China Mengniu Dairy Co Ltd | Citibank | 95 | | | | |
| 16.000 | China Merchants Bank Co Ltd 'H' | Citibank | 2.881 | | | | |
| 3.500 | China Merchants Bank Co Ltd 'H' | HSBC | 3.374 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------|---|-------------|---|-----------|---|-------------|---|
| | Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | |
| 200 | China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd | HSBC | 65 | (49.000) | China Youran Dairy Group Ltd | JP Morgan | (693) |
| 5.400 | China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd | JP Morgan | 1.763 | 180.000 | China Yuhua Education Corp Ltd | Citibank | 2.071 |
| 8.500 | China Resources Pharmaceutical Group Ltd | Citibank | (183) | 172.000 | China Yuhua Education Corp Ltd | HSBC | 1.653 |
| 3.500 | China Resources Pharmaceutical Group Ltd | JP Morgan | 10 | 274.000 | China Yuhua Education Corp Ltd | JP Morgan | 2.457 |
| (4.000) | China Resources Power Holdings Co Ltd | Citibank | (461) | 27.600 | China Zhongwang Holdings Ltd' | Citibank | (2.206) |
| (2.000) | China Resources Power Holdings Co Ltd | HSBC | (582) | 56.000 | China Zhongwang Holdings Ltd' | HSBC | (4.476) |
| (85.000) | China Sanjiang Fine Chemicals Co Ltd | Citibank | (221) | 28.800 | China Zhongwang Holdings Ltd' | JP Morgan | (2.302) |
| (293.000) | China Sanjiang Fine Chemicals Co Ltd | JP Morgan | 355 | (6.000) | Chow Sang Sang Holdings International Ltd | Citibank | (55) |
| (158.000) | China SCE Group Holdings Ltd | Citibank | 799 | (11.000) | Chow Sang Sang Holdings International Ltd | HSBC | (284) |
| (8.000) | China SCE Group Holdings Ltd | JP Morgan | 71 | (4.000) | Chow Sang Sang Holdings International Ltd | JP Morgan | (103) |
| (28.000) | China South City Holdings Ltd | Citibank | 320 | 6.400 | Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd | Citibank | 802 |
| (2.000) | China South City Holdings Ltd | JP Morgan | 25 | 5.400 | Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd | HSBC | 884 |
| (36.000) | China Suntien Green Energy Corp Ltd 'H' | Citibank | (1.840) | 13.000 | Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd | JP Morgan | 2.128 |
| 5.400 | China Taiping Insurance Holdings Co Ltd | Citibank | 380 | 26.000 | CIFI Holdings Group Co Ltd | JP Morgan | 501 |
| 39.200 | China Taiping Insurance Holdings Co Ltd | HSBC | 3.361 | 6.000 | CIMC Enric Holdings Ltd | Citibank | 116 |
| 25.200 | China Taiping Insurance Holdings Co Ltd | JP Morgan | 2.161 | 16.000 | CIMC Enric Holdings Ltd | HSBC | 863 |
| (40.000) | China Tobacco International HK Co Ltd | Citibank | 1.207 | 10.000 | CIMC Enric Holdings Ltd | JP Morgan | 551 |
| (8.000) | China Tobacco International HK Co Ltd | JP Morgan | 15 | 19.000 | CITIC Ltd | Citibank | 659 |
| (42.000) | China Tower Corp Ltd 'H' | Citibank | (55) | 9.000 | CITIC Ltd | HSBC | 394 |
| (70.000) | China Tower Corp Ltd 'H' | JP Morgan | (270) | 138.000 | CITIC Ltd | JP Morgan | 14.117 |
| (20.000) | China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd | Citibank | (538) | (2.300) | CITIC Securities Co Ltd 'H' | JP Morgan | (213) |
| (2.000) | China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd | HSBC | (74) | 5.500 | CK Hutchison Holdings Ltd | HSBC | (34) |
| (842.000) | China Travel International Investment Hong Kong Ltd | Citibank | (6.478) | 500 | CK Hutchison Holdings Ltd | JP Morgan | 78 |
| (32.000) | China Travel International Investment Hong Kong Ltd | HSBC | (614) | (23.000) | CLP Holdings Ltd | Citibank | 818 |
| (744.000) | China Travel International Investment Hong Kong Ltd | JP Morgan | (14.264) | (34.000) | C-Mer Eye Care Holdings Ltd | Citibank | (568) |
| (25.700) | China Vanke Co Ltd 'H' | Citibank | 2.473 | (104.000) | C-Mer Eye Care Holdings Ltd | JP Morgan | (6.801) |
| (1.400) | China Vanke Co Ltd 'H' | HSBC | 17 | (24.000) | CMGE Technology Group Ltd | Citibank | (2) |
| (500) | China Vanke Co Ltd 'H' | JP Morgan | 6 | (268.000) | CMGE Technology Group Ltd | JP Morgan | (3.084) |
| 10.000 | China Water Affairs Group Ltd | Citibank | (176) | (20.000) | Concord New Energy Group Ltd | Citibank | (77) |
| 10.000 | China Water Affairs Group Ltd | HSBC | (341) | (60.000) | Convoy Global Holdings Ltd' | Citibank | 1.227 |
| 8.000 | China Water Affairs Group Ltd | JP Morgan | (272) | (324.000) | Convoy Global Holdings Ltd' | HSBC | 6.606 |
| (38.000) | China XLX Fertiliser Ltd | Citibank | 1.831 | (192.000) | Convoy Global Holdings Ltd' | JP Morgan | (170) |
| (2.000) | China XLX Fertiliser Ltd | JP Morgan | 58 | (77.000) | COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'H' | Citibank | (299) |
| 35.500 | China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd | Citibank | 4.849 | (57.000) | COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'H' | HSBC | (803) |
| 45.000 | China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd | HSBC | 7.812 | (8.000) | COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'H' | JP Morgan | (113) |
| 7.000 | China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd | JP Morgan | 1.215 | 20.000 | COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'H' | JP Morgan | 3.011 |
| (88.000) | China Youran Dairy Group Ltd | Citibank | (794) | 3.350 | COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H' | Citibank | 130 |
| | | | | 15.750 | COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H' | HSBC | 3.419 |
| | | | | 6.150 | COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H' | JP Morgan | 1.160 |
| | | | | 36.000 | COSCO SHIPPING Ports Ltd | Citibank | 879 |
| | | | | 16.000 | COSCO SHIPPING Ports Ltd | HSBC | 1.044 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|-------------|---|-----------------------------|---|-------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| 34.000 | COSCO SHIPPING Ports Ltd | JP Morgan | 2.218 | 400 | Ganfeng Lithium Co Ltd 'H' | Citibank | (50) |
| 25.600 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd | Citibank | 1.508 | 800 | Ganfeng Lithium Co Ltd 'H' | HSBC | 1.344 |
| 12.000 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd | HSBC | 1.289 | 200 | Ganfeng Lithium Co Ltd 'H' | JP Morgan | 336 |
| 10.320 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd | JP Morgan | 1.108 | (71.000) | GCL Technology Holdings Ltd | Citibank | (1.635) |
| 26.400 | Dah Sing Banking Group Ltd | Citibank | 948 | (16.000) | GCL Technology Holdings Ltd | JP Morgan | (1.103) |
| 137.600 | Dah Sing Banking Group Ltd | HSBC | 6.877 | (8.000) | Genertec Universal Medical Group Co Ltd | Citibank | (134) |
| 44.400 | Dah Sing Banking Group Ltd | JP Morgan | 2.219 | (1.500) | Genertec Universal Medical Group Co Ltd | HSBC | (37) |
| 22.000 | Dali Foods Group Co Ltd | Citibank | 87 | (19.500) | Genertec Universal Medical Group Co Ltd | JP Morgan | (476) |
| 17.500 | Dali Foods Group Co Ltd | HSBC | (175) | 43.000 | Genor Biopharma Holdings Ltd | Citibank | 882 |
| 19.000 | Dali Foods Group Co Ltd | JP Morgan | (190) | 58.000 | Genor Biopharma Holdings Ltd | HSBC | 83 |
| 158.000 | Datang International Power Generation Co Ltd 'H' | Citibank | 1.215 | 57.000 | Genor Biopharma Holdings Ltd | JP Morgan | 81 |
| 224.000 | Datang International Power Generation Co Ltd 'H' | HSBC | 5.436 | (4.000) | Genscript Biotech Corp | Citibank | (411) |
| 34.000 | Datang International Power Generation Co Ltd 'H' | JP Morgan | 825 | (6.000) | GF Securities Co Ltd 'H' | HSBC | (698) |
| (146.000) | Differ Group Holding Co Ltd | Citibank | 733 | 53.000 | GOME Retail Holdings Ltd | Citibank | (101) |
| (118.000) | Differ Group Holding Co Ltd | JP Morgan | (462) | 95.000 | GOME Retail Holdings Ltd | HSBC | 244 |
| (18.000) | Dongyue Group Ltd | Citibank | (304) | 66.000 | GOME Retail Holdings Ltd | JP Morgan | 169 |
| (43.000) | Dynagreen Environmental Protection Group Co Ltd 'H' | Citibank | (443) | 199.000 | Goodbaby International Holdings Ltd | Citibank | 1.529 |
| (27.000) | EC Healthcare | Citibank | (1.934) | 20.000 | Goodbaby International Holdings Ltd | HSBC | 1 |
| (12.000) | EC Healthcare | JP Morgan | (1.400) | 147.000 | Goodbaby International Holdings Ltd | JP Morgan | 7 |
| 48.000 | Edvantage Group Holdings Ltd | Citibank | 248 | 64.000 | Great Wall Motor Co Ltd 'H' | Citibank | 18.784 |
| 26.000 | Edvantage Group Holdings Ltd | HSBC | (560) | 1.500 | Great Wall Motor Co Ltd 'H' | HSBC | 958 |
| 28.000 | Edvantage Group Holdings Ltd | JP Morgan | (603) | 8.000 | Great Wall Motor Co Ltd 'H' | JP Morgan | 5.111 |
| 7.000 | ESR Cayman Ltd | Citibank | 407 | 72.000 | Greentown Management Holdings Co Ltd | Citibank | 2.766 |
| 600 | ESR Cayman Ltd | HSBC | (30) | 3.000 | Greentown Management Holdings Co Ltd | HSBC | 77 |
| 2.200 | ESR Cayman Ltd | JP Morgan | (110) | 32.000 | Greentown Management Holdings Co Ltd | JP Morgan | 823 |
| 6.000 | E-Star Commercial Management Co Ltd | Citibank | (107) | 2.000 | Greentown Service Group Co Ltd | HSBC | 250 |
| 1.000 | E-Star Commercial Management Co Ltd | HSBC | (29) | (22.000) | Guangdong Investment Ltd | Citibank | 441 |
| 20.000 | E-Star Commercial Management Co Ltd | JP Morgan | (584) | (10.000) | Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'H' | Citibank | (1.600) |
| 18.000 | Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Ltd | Citibank | 323 | (4.000) | Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'H' | HSBC | (641) |
| 2.000 | Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Ltd | HSBC | 23 | (3.200) | Haier Smart Home Co Ltd 'H' | HSBC | (534) |
| 8.000 | Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Ltd | JP Morgan | 154 | (13.000) | Hainan Meilan International Airport Co Ltd 'H' | Citibank | (4.678) |
| 45.000 | Far East Horizon Ltd | Citibank | 1.272 | (4.000) | Hainan Meilan International Airport Co Ltd 'H' | HSBC | (1.470) |
| 13.000 | Far East Horizon Ltd | HSBC | 1.080 | 4.800 | Haitong Securities Co Ltd 'H' | Citibank | 99 |
| 43.000 | Far East Horizon Ltd | JP Morgan | 3.574 | 20.000 | Haitong Securities Co Ltd 'H' | HSBC | 846 |
| 30.000 | FIH Mobile Ltd | Citibank | 39 | 3.000 | Hang Lung Group Ltd | Citibank | 32 |
| 23.000 | FIH Mobile Ltd | HSBC | 89 | 5.000 | Hang Lung Group Ltd | HSBC | (35) |
| 9.000 | FIH Mobile Ltd | JP Morgan | 35 | 11.000 | Hang Lung Group Ltd | JP Morgan | (77) |
| (28.000) | First Tractor Co Ltd 'H' | Citibank | (503) | 4.000 | Hang Lung Properties Ltd | Citibank | 53 |
| (30.000) | First Tractor Co Ltd 'H' | JP Morgan | (769) | 14.000 | Hang Lung Properties Ltd | HSBC | 580 |
| 40.000 | FIT Hon Teng Ltd | JP Morgan | 512 | 4.000 | Hang Lung Properties Ltd | JP Morgan | 166 |
| (6.000) | Flat Glass Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | (2.875) | (9.200) | Hang Seng Bank Ltd | Citibank | 777 |
| (74.000) | Fosun International Ltd | Citibank | (1.246) | (5.400) | Hang Seng Bank Ltd | JP Morgan | 1.825 |
| (1.500) | Fosun International Ltd | HSBC | (106) | 1.700 | Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H' | Citibank | (645) |
| (10.000) | Fuyao Glass Industry Group Co Ltd 'H' | Citibank | (4.090) | 500 | Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H' | HSBC | 393 |
| (13.000) | Galaxy Entertainment Group Ltd | Citibank | (1.261) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return

Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|---|-------------|---|-----------------------------|---|-------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| 700 | Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H' | JP Morgan | 551 | 13.000 | Hysan Development Co Ltd | Citibank | (652) |
| (24.000) | Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd | Citibank | (2.052) | 1.000 | Hysan Development Co Ltd | HSBC | 46 |
| (14.000) | Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd | HSBC | (2.862) | 2.000 | Hysan Development Co Ltd | JP Morgan | 91 |
| (40.000) | Harbin Electric Co Ltd 'H' | Citibank | (1.172) | (27.000) | IGG Inc | Citibank | (3) |
| 9.500 | Health & Happiness H&H International Holdings Ltd | Citibank | 628 | (20.000) | IGG Inc | HSBC | (589) |
| 9.000 | Health & Happiness H&H International Holdings Ltd | HSBC | 717 | (15.000) | IGG Inc | JP Morgan | (442) |
| 7.000 | Health & Happiness H&H International Holdings Ltd | JP Morgan | 663 | 12.000 | Immunotech Biopharm Ltd | Citibank | 109 |
| (9.000) | Helens International Holdings Co Ltd | JP Morgan | (4.729) | 6.000 | Immunotech Biopharm Ltd | HSBC | 70 |
| (10.000) | Henderson Land Development Co Ltd | Citibank | (839) | 7.000 | Immunotech Biopharm Ltd | JP Morgan | 82 |
| (61.000) | Henderson Land Development Co Ltd | HSBC | (15.242) | 51.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' | Citibank | 463 |
| (30.000) | Henderson Land Development Co Ltd | JP Morgan | (7.496) | 61.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' | HSBC | 1.334 |
| (12.000) | Hengan International Group Co Ltd | Citibank | (1.010) | 23.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' | JP Morgan | 503 |
| (1.000) | Hengan International Group Co Ltd | HSBC | (231) | (2.000) | InnoCare Pharma Ltd | Citibank | 71 |
| (10.000) | Hengan International Group Co Ltd | JP Morgan | (2.310) | (2.000) | InnoCare Pharma Ltd | HSBC | (167) |
| (11.500) | HKBN Ltd | Citibank | 524 | (1.000) | InnoCare Pharma Ltd | JP Morgan | (83) |
| (11.000) | HKBN Ltd | HSBC | (688) | 500 | Innovent Biologics Inc | Citibank | 115 |
| (8.000) | HKBN Ltd | JP Morgan | (455) | 1.000 | Innovent Biologics Inc | HSBC | 627 |
| (86.000) | Hong Kong & China Gas Co Ltd | Citibank | (2.875) | 500 | Innovent Biologics Inc | JP Morgan | 313 |
| (2.100) | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | Citibank | (2.111) | 6.000 | Inspur International Ltd | Citibank | 184 |
| (33.000) | Hong Kong Technology Venture Co Ltd | Citibank | (1.443) | 6.000 | Inspur International Ltd | HSBC | 229 |
| (5.000) | Hong Kong Technology Venture Co Ltd | HSBC | (224) | 14.000 | Inspur International Ltd | JP Morgan | 185 |
| (31.000) | Hong Kong Technology Venture Co Ltd | JP Morgan | (1.391) | (2.250) | JD Health International Inc | Citibank | (763) |
| 304.000 | Hope Education Group Co Ltd | Citibank | 893 | (150) | JD Health International Inc | HSBC | (200) |
| 246.000 | Hope Education Group Co Ltd | HSBC | 632 | 6.200 | JD Logistics Inc | HSBC | 415 |
| 426.000 | Hope Education Group Co Ltd | JP Morgan | 942 | 2.800 | JD Logistics Inc | JP Morgan | 187 |
| (31.930) | Hopson Development Holdings Ltd | Citibank | (421) | (4.064) | JD.com Inc 'A' | Citibank | (6.866) |
| (2.860) | Hopson Development Holdings Ltd | JP Morgan | 472 | (4) | JD.com Inc 'A' | HSBC | (9) |
| 2.000 | Hua Hong Semiconductor Ltd | Citibank | 168 | (66.000) | Jiangsu Expressway Co Ltd 'H' | Citibank | (1.616) |
| 1.000 | Hua Hong Semiconductor Ltd | HSBC | 645 | (44.000) | Jiangsu Expressway Co Ltd 'H' | HSBC | (3.267) |
| 1.000 | Hua Hong Semiconductor Ltd | JP Morgan | 645 | (6.000) | Jiangsu Expressway Co Ltd 'H' | JP Morgan | (445) |
| (390.000) | Huanxi Media Group Ltd | Citibank | 489 | 6.000 | Jiangxi Copper Co Ltd 'H' | Citibank | 263 |
| (40.000) | Huanxi Media Group Ltd | JP Morgan | 151 | 7.000 | Jiangxi Copper Co Ltd 'H' | HSBC | 537 |
| 118.000 | Huisen Household International Group Ltd | Citibank | 453 | 6.000 | Jiangxi Copper Co Ltd 'H' | JP Morgan | 1.016 |
| 2.000 | Huisen Household International Group Ltd | HSBC | 13 | 77.000 | Jinchuan Group International Resources Co Ltd | Citibank | (292) |
| 330.000 | Huisen Household International Group Ltd | JP Morgan | 2.111 | 128.000 | Jinchuan Group International Resources Co Ltd | JP Morgan | 5 |
| 4.500 | HUTCHMED China Ltd | Citibank | 243 | 400 | Jinke Smart Services Group Co Ltd 'H' | Citibank | (44) |
| 500 | HUTCHMED China Ltd | HSBC | 57 | 3.000 | Jinxin Fertility Group Ltd | Citibank | 287 |
| 3.500 | HUTCHMED China Ltd | JP Morgan | 622 | 1.000 | Jinxin Fertility Group Ltd | HSBC | 204 |
| (2.400) | Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd | Citibank | (1.578) | 14.500 | Jinxin Fertility Group Ltd | JP Morgan | 2.959 |
| (6.200) | Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd | JP Morgan | (8.384) | (14.000) | Jiumaojiu International Holdings Ltd | Citibank | (3.612) |
| | | | | (10.000) | Jiumaojiu International Holdings Ltd | JP Morgan | (2.672) |
| | | | | 14.500 | JNBY Design Ltd | Citibank | 337 |
| | | | | 4.500 | JNBY Design Ltd | HSBC | 179 |
| | | | | 16.000 | JNBY Design Ltd | JP Morgan | 638 |
| | | | | 25.000 | Johnson Electric Holdings Ltd | Citibank | 2.729 |
| | | | | 3.500 | Johnson Electric Holdings Ltd | HSBC | 459 |
| | | | | 11.500 | Johnson Electric Holdings Ltd | JP Morgan | 2.028 |
| | | | | 500 | Joynn Laboratories China Co Ltd 'H' | Citibank | 300 |
| | | | | 500 | Joynn Laboratories China Co Ltd 'H' | HSBC | 686 |
| | | | | 2.300 | Joynn Laboratories China Co Ltd 'H' | JP Morgan | 3.156 |
| | | | | 9.000 | JW Cayman Therapeutics Co Ltd | Citibank | 116 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|---|-------------|---|-----------------------------|--|-------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| 13.500 | JW Cayman Therapeutics Co Ltd | HSBC | 1.449 | 12.000 | Man Wah Holdings Ltd | Citibank | 599 |
| 16.500 | JW Cayman Therapeutics Co Ltd | JP Morgan | 1.771 | 2.000 | Man Wah Holdings Ltd | HSBC | 281 |
| 2.750 | Kaisa Property Holdings Ltd | Citibank | (52) | 4.800 | Man Wah Holdings Ltd | JP Morgan | 674 |
| 4.750 | Kaisa Property Holdings Ltd | HSBC | (17) | (4.400) | Man Wah Holdings Ltd | JP Morgan | (618) |
| 26.000 | Kaisa Property Holdings Ltd | JP Morgan | (94) | (19.200) | Maoyan Entertainment | Citibank | (885) |
| (11.000) | Kerry Logistics Network Ltd | HSBC | (1.242) | (31.000) | Maoyan Entertainment | JP Morgan | (2.773) |
| 30.500 | Kerry Properties Ltd | Citibank | (1.301) | (14.000) | MECOM Power and Construction Ltd | Citibank | 3 |
| 26.000 | Kerry Properties Ltd | HSBC | (805) | (1.200) | MECOM Power and Construction Ltd | Citibank | (45) |
| 16.000 | Kerry Properties Ltd | JP Morgan | (539) | (42.000) | MECOM Power and Construction Ltd | HSBC | 260 |
| 4.500 | Keymed Biosciences Inc | Citibank | 405 | (4.200) | MECOM Power and Construction Ltd | HSBC | (158) |
| 8.000 | Keymed Biosciences Inc | HSBC | 3.575 | (178.000) | MECOM Power and Construction Ltd | JP Morgan | 1.102 |
| 6.000 | Keymed Biosciences Inc | JP Morgan | 2.681 | (17.800) | MECOM Power and Construction Ltd | JP Morgan | (669) |
| 1.000 | Kingboard Holdings Ltd | Citibank | 415 | 3.500 | Medlive Technology Co Ltd | Citibank | 68 |
| 2.000 | Kingboard Holdings Ltd | HSBC | 704 | 1.000 | Medlive Technology Co Ltd | HSBC | 5 |
| 500 | Kingboard Holdings Ltd | JP Morgan | 176 | 4.500 | Medlive Technology Co Ltd | JP Morgan | 25 |
| (25.000) | Kingboard Laminates Holdings Ltd | Citibank | (2.750) | (1.500) | Meitu Inc ¹ | Citibank | — |
| (500) | Kingboard Laminates Holdings Ltd | JP Morgan | (79) | (50.000) | Meitu Inc | HSBC | (129) |
| (24.000) | Kingdee International Software Group Co Ltd | Citibank | (392) | (500) | Meituan 'B' | HSBC | (2.246) |
| (11.400) | Kingsoft Corp Ltd | Citibank | (1.317) | (100) | Meituan 'B' | JP Morgan | (449) |
| (5.200) | Kingsoft Corp Ltd | HSBC | (3.153) | (71.000) | Melco International Development Ltd | Citibank | (2.455) |
| 2.000 | Kintor Pharmaceutical Ltd | Citibank | 142 | (6.000) | Melco International Development Ltd | HSBC | (17) |
| 1.000 | Kintor Pharmaceutical Ltd | HSBC | 558 | (6.000) | Melco International Development Ltd | JP Morgan | (17) |
| (900) | Kuaishou Technology | Citibank | (1.155) | 5.000 | Metallurgical Corp of China Ltd 'H' ¹ | Citibank | — |
| (12.000) | Kunlun Energy Co Ltd | Citibank | (18) | 130.000 | Metallurgical Corp of China Ltd 'H' | HSBC | 442 |
| (4.000) | Kunlun Energy Co Ltd | HSBC | (185) | 18.000 | Metallurgical Corp of China Ltd 'H' | JP Morgan | 35 |
| (2.000) | Kunlun Energy Co Ltd | JP Morgan | (92) | (4.800) | MGM China Holdings Ltd | Citibank | (96) |
| 11.000 | Lee & Man Paper Manufacturing Ltd | Citibank | 240 | (6.100) | Microport Scientific Corp | Citibank | (128) |
| 3.000 | Lee & Man Paper Manufacturing Ltd | HSBC | 62 | (10.000) | Midea Real Estate Holding Ltd | Citibank | 2.926 |
| 31.000 | Lee & Man Paper Manufacturing Ltd | JP Morgan | 637 | (4.400) | Midea Real Estate Holding Ltd | JP Morgan | 939 |
| 14.000 | Lenovo Group Ltd | Citibank | 22 | (3.000) | Ming Yuan Cloud Group Holdings Ltd | Citibank | 49 |
| 4.000 | Lenovo Group Ltd | HSBC | (167) | (2.000) | Ming Yuan Cloud Group Holdings Ltd | HSBC | (90) |
| 88.000 | Lenovo Group Ltd | JP Morgan | (3.670) | (15.000) | Ming Yuan Cloud Group Holdings Ltd | JP Morgan | (675) |
| (6.500) | Li Ning Co Ltd | Citibank | (5.852) | (4.000) | Minth Group Ltd | Citibank | (711) |
| 212.000 | Liaoning Port Co Ltd 'H' | Citibank | 275 | 20.000 | MMG Ltd | Citibank | 2 |
| 18.000 | Liaoning Port Co Ltd 'H' | HSBC | 46 | 4.000 | MMG Ltd | HSBC | 225 |
| 100.000 | Liaoning Port Co Ltd 'H' | JP Morgan | 258 | 96.000 | MMG Ltd | JP Morgan | 5.395 |
| (22.000) | Lifetech Scientific Corp | Citibank | (226) | (15.000) | Mobvista Inc | Citibank | (60) |
| (44.000) | Lifetech Scientific Corp | HSBC | (2.023) | 24.000 | NagaCorp Ltd | Citibank | 1.351 |
| (184.000) | Lifetech Scientific Corp | JP Morgan | (8.458) | 4.000 | NagaCorp Ltd | HSBC | 129 |
| 900 | Link (REIT) | Citibank | 140 | 20.000 | NagaCorp Ltd | JP Morgan | 643 |
| 900 | Link (REIT) | HSBC | 536 | 3.000 | Nayuki Holdings Ltd | Citibank | 532 |
| 23.600 | Link (REIT) | JP Morgan | 14.053 | 12.500 | Nayuki Holdings Ltd | JP Morgan | 2.806 |
| (2.000) | Longfor Group Holdings Ltd | Citibank | 23 | 34.000 | NetDragon Websoft Holdings Ltd | Citibank | 365 |
| (2.500) | Longfor Group Holdings Ltd | HSBC | (769) | 500 | NetDragon Websoft Holdings Ltd | HSBC | 58 |
| (500) | Longfor Group Holdings Ltd | JP Morgan | (154) | 2.500 | NetDragon Websoft Holdings Ltd | JP Morgan | 288 |
| (4.000) | Luk Fook Holdings International Ltd | Citibank | (461) | (3.200) | NetEase Inc | Citibank | (6.278) |
| (4.000) | Luoyang Glass Co Ltd 'H' | Citibank | (786) | (1.600) | NetEase Inc | HSBC | (1.729) |
| (10.000) | Luoyang Glass Co Ltd 'H' | JP Morgan | (3.419) | (1.000) | NetEase Inc | JP Morgan | (1.096) |
| 252.000 | LVGEM China Real Estate Investment Co Ltd | Citibank | (635) | | | | |
| 144.000 | LVGEM China Real Estate Investment Co Ltd | HSBC | (1.645) | | | | |
| 16.000 | LVGEM China Real Estate Investment Co Ltd | JP Morgan | (183) | | | | |
| 18.000 | Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'H' | Citibank | 25 | | | | |
| 22.000 | Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'H' | HSBC | 395 | | | | |
| 54.000 | Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'H' | JP Morgan | 970 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------|--|-------------|---|-----------|--|-------------|---|
| | Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | |
| (15.900) | New China Life Insurance Co Ltd 'H' | Citibank | (1.976) | 5.500 | Powerlong Commercial Management Holdings Ltd | HSBC | (650) |
| (700) | New China Life Insurance Co Ltd 'H' | JP Morgan | (146) | 9.500 | Powerlong Commercial Management Holdings Ltd | JP Morgan | (1.123) |
| 4.000 | New Horizon Health Ltd | Citibank | (303) | 37.000 | Powerlong Real Estate Holdings Ltd | Citibank | 3 |
| 2.000 | New Horizon Health Ltd | HSBC | 34 | 15.000 | Powerlong Real Estate Holdings Ltd | HSBC | (572) |
| 1.000 | New Horizon Health Ltd | JP Morgan | (59) | 2.000 | Powerlong Real Estate Holdings Ltd | JP Morgan | (76) |
| 11.000 | New World Development Co Ltd | Citibank | 712 | 700 | PRADA SpA | JP Morgan | 345 |
| 9.000 | New World Development Co Ltd | HSBC | 1.560 | (28.000) | Realord Group Holdings Ltd | Citibank | 1.343 |
| 1.000 | New World Development Co Ltd | JP Morgan | 173 | (8.000) | Realord Group Holdings Ltd | HSBC | 179 |
| (10.000) | Newborn Town Inc | Citibank | (13) | (14.000) | Realord Group Holdings Ltd | JP Morgan | 313 |
| (56.000) | Newborn Town Inc | JP Morgan | 493 | 50.000 | Redsun Properties Group Ltd | Citibank | (569) |
| 6.000 | Nine Dragons Paper Holdings Ltd | HSBC | 331 | 24.000 | Redsun Properties Group Ltd | HSBC | (731) |
| 9.000 | Nine Dragons Paper Holdings Ltd | JP Morgan | 496 | 34.000 | Redsun Properties Group Ltd | JP Morgan | (1.036) |
| (5.600) | Nongfu Spring Co Ltd 'H' | JP Morgan | (1.868) | (282.000) | Sa Sa International Holdings Ltd | Citibank | (2.529) |
| (9.000) | NWS Holdings Ltd | Citibank | 158 | (48.000) | Sa Sa International Holdings Ltd | JP Morgan | (219) |
| (167.000) | NWS Holdings Ltd | HSBC | (21.120) | (2.400) | Sands China Ltd | Citibank | 42 |
| (5.000) | NWS Holdings Ltd | JP Morgan | (632) | (10.000) | Sands China Ltd | HSBC | 452 |
| 48.800 | Orient Securities Co Ltd 'H' | Citibank | 131 | (4.800) | Sands China Ltd | JP Morgan | 217 |
| 12.800 | Orient Securities Co Ltd 'H' | HSBC | 328 | (12.000) | Sany Heavy Equipment International Holdings Co Ltd | Citibank | (630) |
| 16.400 | Orient Securities Co Ltd 'H' | JP Morgan | 421 | 40.000 | SCE Intelligent Commercial Management Holdings Ltd | JP Morgan | 972 |
| 19.000 | Pacific Basin Shipping Ltd | Citibank | (385) | 6.000 | S-Enjoy Service Group Co Ltd | Citibank | 93 |
| 121.000 | Pacific Basin Shipping Ltd | HSBC | 4.492 | 3.000 | S-Enjoy Service Group Co Ltd | HSBC | 215 |
| 12.000 | Pacific Basin Shipping Ltd | JP Morgan | 445 | 4.000 | S-Enjoy Service Group Co Ltd | JP Morgan | 287 |
| (211.000) | People's Insurance Co Group of China Ltd 'H' | Citibank | (18) | 12.000 | Shandong Gold Mining Co Ltd 'H' | JP Morgan | 1.108 |
| (70.000) | People's Insurance Co Group of China Ltd 'H' | HSBC | (275) | (17.200) | Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd 'H' | Citibank | (531) |
| (75.000) | Perfect Medical Health Management Ltd | Citibank | (489) | 500 | Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | 195 |
| (10.000) | Perfect Medical Health Management Ltd | JP Morgan | (129) | (9.000) | Shanghai Fudan Microelectronics Group Co Ltd 'H' | Citibank | 1.195 |
| 26.000 | PetroChina Co Ltd 'H' | Citibank | 898 | (2.000) | Shanghai Fudan Microelectronics Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | (729) |
| 6.000 | PetroChina Co Ltd 'H' | HSBC | 330 | (200) | Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd 'H' | Citibank | 178 |
| 282.000 | PetroChina Co Ltd 'H' | JP Morgan | 15.499 | (3.600) | Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'H' | Citibank | (57) |
| 800 | Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' | Citibank | 716 | 10.000 | Shenzhen Expressway Corp Ltd 'H' | Citibank | 194 |
| 2.700 | Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' | HSBC | 3.554 | 10.000 | Shenzhen Expressway Corp Ltd 'H' | HSBC | 182 |
| 200 | Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' | JP Morgan | 263 | 2.000 | Shenzhen Expressway Corp Ltd 'H' | JP Morgan | 36 |
| (6.000) | PICC Property & Casualty Co Ltd 'H' | Citibank | 182 | (6.056) | Shenzhen International Holdings Ltd | Citibank | (187) |
| (22.000) | PICC Property & Casualty Co Ltd 'H' | HSBC | 189 | (2.000) | Shenzhen International Holdings Ltd | JP Morgan | 246 |
| (64.000) | PICC Property & Casualty Co Ltd 'H' | JP Morgan | 549 | (11.300) | Shenzhou International Group Holdings Ltd | Citibank | (11.415) |
| 10.000 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | Citibank | 3.330 | 14.500 | Shimao Group Holdings Ltd | Citibank | (935) |
| 3.000 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | HSBC | 1.104 | | | | |
| 500 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | JP Morgan | 148 | | | | |
| (2.200) | Pop Mart International Group Ltd | Citibank | 193 | | | | |
| (9.800) | Pop Mart International Group Ltd | JP Morgan | 379 | | | | |
| (34.000) | Postal Savings Bank of China Co Ltd 'H' | Citibank | 470 | | | | |
| (7.000) | Postal Savings Bank of China Co Ltd 'H' | JP Morgan | 194 | | | | |
| 18.000 | Powerlong Commercial Management Holdings Ltd | Citibank | 326 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|---|-------------|---|-----------------------------|---|-------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| 2.500 | Shimao Group Holdings Ltd' | HSBC | (161) | (6.000) | Sun Hung Kai Properties Ltd | Citibank | (746) |
| 16.000 | Shimao Group Holdings Ltd' | JP Morgan | (1.031) | (12.000) | Sun Hung Kai Properties Ltd | HSBC | (8.688) |
| 140.000 | Shoucheng Holdings Ltd | Citibank | 175 | (10.000) | Sun King Technology Group Ltd | Citibank | (205) |
| 270.000 | Shoucheng Holdings Ltd | HSBC | 1.253 | (6.000) | Sun King Technology Group Ltd | JP Morgan | (260) |
| 92.000 | Shoucheng Holdings Ltd | JP Morgan | 803 | 6.000 | Sunac China Holdings Ltd' | Citibank | (401) |
| 32.000 | Shougang Fushan Resources Group Ltd | Citibank | 411 | 12.000 | Sunac China Holdings Ltd' | JP Morgan | (801) |
| 32.000 | Shougang Fushan Resources Group Ltd | HSBC | 2.288 | (147.000) | SUNeVision Holdings Ltd | Citibank | 1.280 |
| 34.000 | Shougang Fushan Resources Group Ltd | JP Morgan | (1) | (94.000) | SUNeVision Holdings Ltd | HSBC | 1.651 |
| (31.000) | Sino Biopharmaceutical Ltd | Citibank | (645) | (109.000) | SUNeVision Holdings Ltd | JP Morgan | 1.915 |
| (88.686) | Sino Land Co Ltd | Citibank | 870 | 3.500 | Swire Pacific Ltd 'A' | Citibank | 1.009 |
| (32.491) | Sino Land Co Ltd | HSBC | (2.665) | 8.000 | Swire Pacific Ltd 'A' | HSBC | 3.940 |
| (28.430) | Sino Land Co Ltd | JP Morgan | (2.332) | 9.500 | Swire Pacific Ltd 'A' | JP Morgan | 4.679 |
| 23.500 | Sino-Ocean Service Holding Ltd | Citibank | (387) | 15.400 | Swire Properties Ltd | Citibank | (68) |
| 3.000 | Sino-Ocean Service Holding Ltd | HSBC | (76) | 6.200 | Swire Properties Ltd | HSBC | 495 |
| 56.000 | Sino-Ocean Service Holding Ltd | JP Morgan | (1.419) | 23.400 | Swire Properties Ltd | JP Morgan | 1.868 |
| 38.000 | Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H' | Citibank | 393 | (6.000) | SY Holdings Group Ltd | Citibank | (169) |
| 500 | Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H' | HSBC | 1 | (88.000) | TCL Electronics Holdings Ltd | Citibank | (3.282) |
| 214.000 | Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | 583 | 3.500 | Techtronic Industries Co Ltd | Citibank | 1.328 |
| 18.000 | Sinopec Oilfield Service Corp 'H' | Citibank | 115 | 4.500 | Techtronic Industries Co Ltd | HSBC | 1.794 |
| 10.000 | Sinopec Oilfield Service Corp 'H' | HSBC | 89 | 9.500 | Techtronic Industries Co Ltd | JP Morgan | 7.971 |
| 44.000 | Sinopec Oilfield Service Corp 'H' | JP Morgan | 394 | 200 | Tencent Holdings Ltd | JP Morgan | 543 |
| 44.000 | Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H' | Citibank | 114 | 4.000 | Texhong Textile Group Ltd | HSBC | (100) |
| 8.000 | Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H' | HSBC | 123 | 10.500 | Texhong Textile Group Ltd | JP Morgan | (264) |
| 38.000 | Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H' | JP Morgan | 583 | 4.500 | Tian Lun Gas Holdings Ltd | Citibank | (140) |
| (28.400) | Sinopharm Group Co Ltd 'H' | Citibank | (1.394) | 32.000 | Tiangong International Co Ltd | Citibank | 247 |
| (3.600) | Sinopharm Group Co Ltd 'H' | HSBC | (654) | 56.000 | Tiangong International Co Ltd | HSBC | 1.505 |
| (2.000) | Sinopharm Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | (363) | 48.000 | Tiangong International Co Ltd | JP Morgan | 1.290 |
| 14.000 | SITC International Holdings Co Ltd | Citibank | 3.492 | (24.000) | Tianjin Capital Environmental Protection Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | 272 |
| 6.000 | SITC International Holdings Co Ltd | HSBC | 2.568 | 2.000 | Tianneng Power International Ltd | Citibank | (25) |
| 5.000 | SITC International Holdings Co Ltd | JP Morgan | 2.140 | 4.000 | Tianneng Power International Ltd | HSBC | 440 |
| 16.000 | SJM Holdings Ltd | Citibank | 430 | 14.000 | Tianneng Power International Ltd | JP Morgan | 1.538 |
| (87.000) | SJM Holdings Ltd | Citibank | (2.338) | (3.000) | Times Neighborhood Holdings Ltd | Citibank | 65 |
| 182.000 | SJM Holdings Ltd | HSBC | 6.750 | 14.000 | Tingyi Cayman Islands Holding Corp | Citibank | 1.469 |
| 29.000 | SJM Holdings Ltd | JP Morgan | 1.076 | 10.000 | Tingyi Cayman Islands Holding Corp | HSBC | (962) |
| (3.000) | SJM Holdings Ltd | JP Morgan | (111) | 4.000 | Tingyi Cayman Islands Holding Corp | JP Morgan | (385) |
| (26.000) | Skyworth Group Ltd | Citibank | 195 | 8.000 | Tong Ren Tang Technologies Co Ltd 'H' | Citibank | (60) |
| 72.000 | Skyworth Group Ltd | Citibank | (541) | 2.000 | Tong Ren Tang Technologies Co Ltd 'H' | HSBC | 8 |
| 8.000 | Skyworth Group Ltd | HSBC | (518) | 9.000 | Tong Ren Tang Technologies Co Ltd 'H' | JP Morgan | 37 |
| (20.000) | Skyworth Group Ltd | JP Morgan | 1.296 | (40.400) | Tongcheng-Elong Holdings Ltd | Citibank | (8.977) |
| 78.000 | Skyworth Group Ltd | JP Morgan | (5.054) | (4.400) | Tongcheng-Elong Holdings Ltd | HSBC | (1.180) |
| (96.000) | SMI Holding Group Ltd** | Citibank | — | (67.000) | TravelSky Technology Ltd 'H' | Citibank | (10.272) |
| (216.000) | SMI Holding Group Ltd** | JP Morgan | — | (6.000) | Truly International Holdings Ltd | Citibank | (23) |
| (17.000) | Smooere International Holdings Ltd | Citibank | (3.260) | (8.000) | Truly International Holdings Ltd | HSBC | (347) |
| (1.000) | Smooere International Holdings Ltd | HSBC | (500) | 2.000 | Tsingtao Brewery Co Ltd 'H' | Citibank | 1.661 |
| (16.000) | SOHO China Ltd | Citibank | (21) | | | | |
| 16.000 | SSY Group Ltd | HSBC | (446) | | | | |
| 22.000 | Sun Art Retail Group Ltd | Citibank | 226 | | | | |
| 19.000 | Sun Art Retail Group Ltd | HSBC | 26 | | | | |
| 132.500 | Sun Art Retail Group Ltd | JP Morgan | 183 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|-------------|---|-----------------------------|--|-------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| 97.000 | Uni-President China Holdings Ltd | Citibank | (1.462) | 3.000 | Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co Ltd | JP Morgan | 268 |
| 7.000 | Uni-President China Holdings Ltd | HSBC | (185) | (22.200) | Xiaomi Corp 'B' | Citibank | (1.866) |
| 72.000 | Uni-President China Holdings Ltd | JP Morgan | (1.906) | 200 | Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'H' | Citibank | 19 |
| (11.000) | United Co RUSAL International PJSC | Citibank | 13 | (84.000) | Xinyi Energy Holdings Ltd | Citibank | (761) |
| 18.000 | United Laboratories International Holdings Ltd | Citibank | (112) | (38.000) | Xinyi Energy Holdings Ltd | HSBC | (1.217) |
| 62.000 | United Laboratories International Holdings Ltd | HSBC | 1.037 | (10.000) | Xinyi Energy Holdings Ltd | JP Morgan | (320) |
| 110.000 | United Laboratories International Holdings Ltd | JP Morgan | 1.840 | (26.000) | Xinyi Glass Holdings Ltd | Citibank | (2.535) |
| (23.000) | Value Partners Group Ltd | Citibank | (501) | (1.000) | Xinyi Glass Holdings Ltd | HSBC | (365) |
| (17.000) | Value Partners Group Ltd | HSBC | (652) | (3.000) | Xinyi Glass Holdings Ltd | JP Morgan | (1.096) |
| (5.000) | Vesync Co Ltd | JP Morgan | (322) | (6.666) | Xinyi Solar Holdings Ltd | Citibank | (411) |
| 1.000 | Vinda International Holdings Ltd | JP Morgan | 72 | (18.192) | Xinyi Solar Holdings Ltd | HSBC | (6.361) |
| (13.500) | Viva Biotech Holdings | Citibank | (1) | (43.285) | Xinyi Solar Holdings Ltd | JP Morgan | (15.135) |
| (7.500) | Viva Biotech Holdings | HSBC | (364) | 15.000 | Xtep International Holdings Ltd | Citibank | 1.879 |
| (32.000) | Viva China Holdings Ltd | Citibank | (616) | 2.000 | Xtep International Holdings Ltd | HSBC | 355 |
| (40.000) | Vobile Group Ltd | Citibank | (209) | 1.500 | Xtep International Holdings Ltd | JP Morgan | 266 |
| (20.000) | Vobile Group Ltd | JP Morgan | (1.023) | 2.000 | Yadea Group Holdings Ltd | JP Morgan | 322 |
| 34.000 | VPower Group International Holdings Ltd | Citibank | 88 | 6.000 | Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co 'H' | Citibank | (74) |
| 23.000 | VPower Group International Holdings Ltd | JP Morgan | 1 | 7.000 | Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co 'H' | JP Morgan | 21 |
| (46.000) | VSTECs Holdings Ltd | Citibank | 869 | 4.800 | Yidu Tech Inc | Citibank | (146) |
| (34.000) | VSTECs Holdings Ltd | HSBC | (703) | 12.000 | Yidu Tech Inc | HSBC | 386 |
| (4.000) | VSTECs Holdings Ltd | JP Morgan | (83) | 4.400 | Yidu Tech Inc | JP Morgan | 142 |
| 24.000 | Want Want China Holdings Ltd | HSBC | 2.148 | (10.000) | Yihai International Holding Ltd | Citibank | (2.391) |
| 1.000 | Want Want China Holdings Ltd | JP Morgan | 90 | (1.000) | Yihai International Holding Ltd | HSBC | (503) |
| (13.000) | Weichai Power Co Ltd 'H' | Citibank | (1.496) | (87.000) | Youyuan International Holdings Ltd | Citibank | 1.818 |
| (7.000) | Weichai Power Co Ltd 'H' | JP Morgan | (1.823) | (38.000) | Youyuan International Holdings Ltd | JP Morgan | 807 |
| (15.000) | Weimob Inc | Citibank | (557) | (9.000) | Zensun Enterprises Ltd | Citibank | (299) |
| (70.000) | West China Cement Ltd | Citibank | (295) | (21.000) | Zensun Enterprises Ltd | HSBC | (832) |
| 106.000 | WH Group Ltd | Citibank | 2.453 | (41.000) | Zensun Enterprises Ltd | JP Morgan | (1.625) |
| 27.000 | WH Group Ltd | HSBC | 2.621 | 17.000 | Zhaojin Mining Industry Co Ltd 'H' | Citibank | (364) |
| 85.500 | WH Group Ltd | JP Morgan | 8.300 | 8.000 | Zhaojin Mining Industry Co Ltd 'H' | HSBC | 349 |
| (9.000) | Wharf Holdings Ltd | Citibank | (2.703) | 44.500 | Zhaojin Mining Industry Co Ltd 'H' | JP Morgan | 1.941 |
| (28.000) | Wharf Holdings Ltd | HSBC | (17.332) | 12.000 | Zhejiang Expressway Co Ltd 'H' | Citibank | 461 |
| (15.000) | Wharf Holdings Ltd | JP Morgan | (9.285) | 14.000 | Zhejiang Expressway Co Ltd 'H' | HSBC | 914 |
| (14.000) | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | Citibank | (732) | 6.000 | Zhejiang Expressway Co Ltd 'H' | JP Morgan | 392 |
| (3.000) | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | JP Morgan | (655) | 22.000 | Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co Ltd 'H' | Citibank | 1.132 |
| 26.000 | Wisdom Education International Holdings Co Ltd | Citibank | (199) | 7.800 | Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co Ltd 'H' | HSBC | 539 |
| 6.000 | Wisdom Education International Holdings Co Ltd | HSBC | (84) | 4.000 | Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | 338 |
| 96.000 | Wisdom Education International Holdings Co Ltd | JP Morgan | (1.344) | 40.000 | Zhenro Services Group Ltd | Citibank | (50) |
| 836 | WuXi AppTec Co Ltd 'H' | Citibank | 120 | 1.000 | Zhenro Services Group Ltd | HSBC | 1 |
| 60 | WuXi AppTec Co Ltd 'H' | HSBC | 9 | 8.000 | Zhenro Services Group Ltd | JP Morgan | 10 |
| 780 | WuXi AppTec Co Ltd 'H' | JP Morgan | 113 | (2.800) | ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd 'H' | Citibank | 39 |
| (2.500) | Wuxi Biologics Cayman Inc | Citibank | (562) | 500 | Zhongsheng Group Holdings Ltd | HSBC | 428 |
| (58.000) | Wynn Macau Ltd | Citibank | (1.930) | (120.500) | Zhou Hei Ya International Holdings Co Ltd | Citibank | (1.283) |
| (39.200) | Wynn Macau Ltd | HSBC | (656) | | | | |
| 2.200 | XD Inc | Citibank | 408 | | | | |
| (4.800) | XD Inc | Citibank | (890) | | | | |
| (600) | XD Inc | JP Morgan | (309) | | | | |
| 14.500 | Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co Ltd | Citibank | 692 | | | | |
| 1.500 | Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co Ltd | HSBC | 134 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|---|-------------|---|-------------------------------|--|-------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Indonesien Fortsetzung | | | |
| (14.500) | Zhou Hei Ya International Holdings Co Ltd | JP Morgan | (721) | (142.950) | Merdeka Copper Gold Tbk PT | JP Morgan | (4.621) |
| (126.000) | Zhuguang Holdings Group Co Ltd | Citibank | 155 | (24.200) | Metro Healthcare Indonesia Tbk PT | JP Morgan | (70) |
| (9.700) | Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd | Citibank | (2.050) | 53.300 | Perusahaan Gas Negara Tbk PT | Citibank | 931 |
| (3.100) | Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd | HSBC | (1.170) | 449.000 | Perusahaan Gas Negara Tbk PT | HSBC | 10.698 |
| (1.200) | Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd | JP Morgan | (453) | 726.300 | Perusahaan Gas Negara Tbk PT | JP Morgan | 17.015 |
| 2.000 | Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H' | Citibank | 54 | (738.600) | Sarana Menara Nusantara Tbk PT | JP Morgan | (1.067) |
| 9.800 | Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H' | HSBC | 476 | (1.900) | Semen Indonesia Persero Tbk PT | JP Morgan | (77) |
| 94.600 | Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H' | JP Morgan | 4.600 | 208.000 | Surya Citra Media Tbk PT | Citibank | (37) |
| 8.000 | ZTE Corp 'H' | Citibank | 1.472 | 172.200 | Surya Citra Media Tbk PT | HSBC | (170) |
| 10.600 | ZTE Corp 'H' | HSBC | 2.223 | 3.273.300 | Surya Citra Media Tbk PT | JP Morgan | (3.452) |
| 3.200 | ZTE Corp 'H' | JP Morgan | 671 | (10.400) | Telkom Indonesia Persero Tbk PT | JP Morgan | (105) |
| | | | 98.642 | (22.600) | Tower Bersama Infrastructure Tbk PT | HSBC | 101 |
| | | | | (65.600) | Unilever Indonesia Tbk PT | Citibank | 536 |
| | | | | (10.600) | Unilever Indonesia Tbk PT | HSBC | (518) |
| | | | | (88.900) | Unilever Indonesia Tbk PT | JP Morgan | (4.248) |
| | | | | | | | 18.496 |
| Indonesien | | | | Japan | | | |
| 798.000 | AKR Corporindo Tbk PT | Citibank | 6.641 | (1.500) | 77 Bank Ltd | Citibank | (440) |
| 545.000 | AKR Corporindo Tbk PT | HSBC | 1.236 | (300) | 77 Bank Ltd | HSBC | (187) |
| 864.600 | AKR Corporindo Tbk PT | JP Morgan | 1.703 | (700) | ABC-Mart Inc | HSBC | (787) |
| 118.600 | Bank Central Asia Tbk PT | Citibank | 2.265 | 1.100 | Acom Co Ltd | HSBC | (98) |
| 12.000 | Bank Central Asia Tbk PT | HSBC | 112 | 6.400 | Acom Co Ltd | JP Morgan | (581) |
| 355.500 | Bank Central Asia Tbk PT | JP Morgan | 2.584 | 4 | Activia Properties Inc (REIT) | HSBC | (13) |
| 25.000 | Bank Mandiri Persero Tbk PT | Citibank | 1.157 | 900 | Adastria Co Ltd | Citibank | 163 |
| 7.600 | Bank Mandiri Persero Tbk PT | HSBC | 83 | 100 | Adastria Co Ltd | HSBC | 38 |
| 8.900 | Bank Mandiri Persero Tbk PT | JP Morgan | 77 | 700 | Adastria Co Ltd | JP Morgan | 700 |
| (40.100) | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT | JP Morgan | (822) | (400) | ADEKA Corp | HSBC | (445) |
| 3.100 | Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT | Citibank | 12 | (5.300) | ADEKA Corp | JP Morgan | (5.818) |
| 14.100 | Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT | HSBC | (22) | (20) | Advance Residence Investment Corp (REIT) | Citibank | (1.329) |
| 1.087.500 | Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT | JP Morgan | (2.235) | (19) | Advance Residence Investment Corp (REIT) | HSBC | (1.512) |
| (815.800) | Barito Pacific Tbk PT | JP Morgan | (573) | (21) | Advance Residence Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (1.625) |
| (24.400) | Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT | HSBC | (772) | 700 | Advantest Corp | HSBC | 2.524 |
| (156.900) | Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT | JP Morgan | (4.750) | 600 | Advantest Corp | JP Morgan | 2.132 |
| (600) | Gudang Garam Tbk PT | HSBC | (47) | 100 | Adventure Inc | Citibank | (152) |
| (3.200) | Indah Kiat Pulp & Paper Tbk PT | JP Morgan | (194) | (2.800) | Aeon Co Ltd | JP Morgan | 32 |
| (5.700) | Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT | JP Morgan | 130 | 900 | Aeon Delight Co Ltd | Citibank | 51 |
| (20.000) | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT | HSBC | (662) | 1.900 | Aeon Delight Co Ltd | JP Morgan | 43 |
| (17.400) | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT | JP Morgan | (1.351) | 700 | AEON Financial Service Co Ltd | Citibank | (43) |
| (12.200) | Indofood Sukses Makmur Tbk PT | JP Morgan | (368) | (6.800) | Aeon Hokkaido Corp | JP Morgan | (3.994) |
| (3.100) | Indosat Tbk PT | JP Morgan | 263 | (11) | AEON Investment Corp (REIT) | Citibank | (232) |
| 29.700 | Kalbe Farma Tbk PT | HSBC | 290 | (43) | AEON Investment Corp (REIT) | HSBC | (2.335) |
| 27.000 | Kalbe Farma Tbk PT | JP Morgan | 252 | (10) | AEON Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (534) |
| (147.400) | Lippo Karawaci Tbk PT | HSBC | (38) | (200) | AGC Inc | JP Morgan | 100 |
| (905.700) | Medikaloka Hermina Tbk PT | JP Morgan | 2.057 | 1.800 | Ai Holdings Corp | Citibank | (713) |
| (6.947) | Merdeka Copper Gold Tbk PT | Citibank | (305) | 1.300 | Ai Holdings Corp | HSBC | (34) |
| (93.300) | Merdeka Copper Gold Tbk PT | HSBC | (3.143) | 1.400 | Ai Holdings Corp | JP Morgan | (270) |
| | | | | 500 | Aica Kogyo Co Ltd | JP Morgan | (535) |
| | | | | (100) | Aichi Bank Ltd | Citibank | 31 |
| | | | | (1.100) | Aichi Bank Ltd | HSBC | (506) |
| | | | | (1.300) | Aichi Corp | Citibank | 27 |
| | | | | (5.100) | Aichi Corp | HSBC | 41 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return

Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------|-------------|---|--------------------------|-----------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (1.800) | Aichi Corp | JP Morgan | 25 | 5.200 | Asahi Kasei Corp | HSBC | (632) |
| (1.200) | Aida Engineering Ltd | Citibank | 159 | 4.000 | Asahi Kasei Corp | JP Morgan | (513) |
| (2.200) | Aida Engineering Ltd | HSBC | 721 | (700) | Asanuma Corp | HSBC | (1.346) |
| (1.500) | Aida Engineering Ltd | JP Morgan | 443 | (600) | Asics Corp | HSBC | 93 |
| 200 | Aidma Holdings Inc | Citibank | 230 | 1.000 | ASKUL Corp | Citibank | (166) |
| 100 | Aidma Holdings Inc | HSBC | 212 | 1.100 | ASKUL Corp | JP Morgan | (207) |
| 100 | Aidma Holdings Inc | JP Morgan | 245 | 1.300 | Astellas Pharma Inc | HSBC | 1.693 |
| (5.700) | Aiful Corp | Citibank | 152 | (7.500) | Atom Corp | Citibank | 1.022 |
| (24.000) | Aiful Corp | JP Morgan | 3.986 | 200 | Atrae Inc | Citibank | 342 |
| 800 | Ain Holdings Inc | Citibank | (229) | 100 | Atrae Inc | HSBC | 170 |
| (100) | Air Water Inc | Citibank | 2 | 400 | Autobacs Seven Co Ltd | Citibank | (103) |
| (200) | Air Water Inc | HSBC | 2 | 900 | Autobacs Seven Co Ltd | HSBC | (114) |
| (500) | Air Water Inc | JP Morgan | (300) | 300 | Autobacs Seven Co Ltd | JP Morgan | (16) |
| 300 | Aisin Corp | HSBC | 1.155 | 900 | Avex Inc | JP Morgan | (1.527) |
| 300 | Ajinomoto Co Inc | HSBC | 180 | (200) | Awa Bank Ltd | Citibank | 100 |
| 3.900 | Ajinomoto Co Inc | JP Morgan | 2.270 | (1.300) | Awa Bank Ltd | HSBC | 1.225 |
| (100) | Akatsuki Inc | Citibank | 118 | (2.700) | Awa Bank Ltd | JP Morgan | 2.579 |
| (800) | Akatsuki Inc | HSBC | 275 | 1.100 | Azbil Corp | HSBC | 689 |
| (700) | Akatsuki Inc | JP Morgan | 254 | 300 | Bandai Namco Holdings Inc | HSBC | 2.808 |
| 2.100 | Alfresa Holdings Corp | Citibank | (981) | 1.000 | Bandai Namco Holdings Inc | JP Morgan | 9.306 |
| 3.900 | Alfresa Holdings Corp | HSBC | (1.645) | (100) | Bank of Kyoto Ltd | Citibank | (257) |
| 1.400 | Alfresa Holdings Corp | JP Morgan | (743) | (200) | Bank of Kyoto Ltd | HSBC | (510) |
| (200) | Alpen Co Ltd | Citibank | 22 | (300) | Bank of Kyoto Ltd | JP Morgan | 138 |
| (1.300) | Alpen Co Ltd | HSBC | (105) | 100 | Belc Co Ltd | Citibank | (64) |
| (100) | Alpen Co Ltd | JP Morgan | (4) | 200 | Belc Co Ltd | HSBC | (123) |
| (100) | Alps Alpine Co Ltd | JP Morgan | 24 | 6.400 | Bell System24 Holdings Inc | Citibank | (3.413) |
| 500 | Altech Corp | HSBC | 260 | 2.400 | Bell System24 Holdings Inc | JP Morgan | (290) |
| 3.900 | Amada Co Ltd | Citibank | 58 | (3.000) | Belluna Co Ltd | Citibank | 83 |
| 6.400 | Amada Co Ltd | JP Morgan | 1.382 | (1.000) | Belluna Co Ltd | HSBC | 295 |
| 1.900 | Amano Corp | Citibank | 976 | (100) | Benefit One Inc | Citibank | 74 |
| 1.300 | Amano Corp | HSBC | 367 | (300) | Benefit One Inc | JP Morgan | (191) |
| 300 | Amvis Holdings Inc | HSBC | (994) | 3.300 | Benesse Holdings Inc | Citibank | (1.848) |
| 100 | Amvis Holdings Inc | JP Morgan | (334) | 800 | Benesse Holdings Inc | HSBC | (346) |
| (2.700) | ANA Holdings Inc | Citibank | (130) | 400 | Bengo4.com Inc | Citibank | (613) |
| (2.900) | ANA Holdings Inc | JP Morgan | (2.655) | 1.300 | Bengo4.com Inc | JP Morgan | 3.900 |
| 1.500 | Anest Iwata Corp | Citibank | (251) | (16.100) | Bic Camera Inc | JP Morgan | (1.538) |
| 1.100 | Anest Iwata Corp | JP Morgan | 268 | 400 | BIPROGY Inc | Citibank | (284) |
| 1.100 | Anicom Holdings Inc | JP Morgan | 438 | 1.000 | BIPROGY Inc | HSBC | 26 |
| 1.600 | Anritsu Corp | Citibank | (402) | 500 | BIPROGY Inc | JP Morgan | (233) |
| 600 | Anritsu Corp | JP Morgan | 29 | 100 | BML Inc | Citibank | 41 |
| 6.800 | Aoyama Trading Co Ltd | Citibank | 3.756 | 600 | Bridgestone Corp | JP Morgan | 1.770 |
| 2.300 | Aoyama Trading Co Ltd | JP Morgan | 3.689 | 4.700 | Broadleaf Co Ltd | Citibank | 117 |
| (600) | Aozora Bank Ltd | Citibank | 150 | 11.000 | Broadleaf Co Ltd | JP Morgan | 2.781 |
| (900) | Aozora Bank Ltd | JP Morgan | 363 | (600) | Brother Industries Ltd | Citibank | (281) |
| 200 | Appier Group Inc | JP Morgan | 190 | (6.100) | Brother Industries Ltd | HSBC | (5.750) |
| 100 | Arata Corp | Citibank | 52 | (1.100) | Brother Industries Ltd | JP Morgan | (930) |
| 1.000 | Arata Corp | HSBC | 3.577 | (1.900) | Bushiroad Inc | JP Morgan | (2.535) |
| 1.800 | Arata Corp | JP Morgan | 6.165 | 1.300 | BuySell Technologies Co Ltd | Citibank | 812 |
| (700) | Arcland Sakamoto Co Ltd | Citibank | 184 | 200 | BuySell Technologies Co Ltd | JP Morgan | 1.461 |
| (2.100) | Arcland Sakamoto Co Ltd | HSBC | 747 | 3.500 | Calbee Inc | Citibank | (2.753) |
| (12.500) | Arcland Sakamoto Co Ltd | JP Morgan | 4.678 | 200 | Canon Inc | HSBC | (2) |
| 2.100 | Arcland Service Holdings Co Ltd | Citibank | (455) | 600 | Capcom Co Ltd | HSBC | 1.492 |
| 300 | Arcland Service Holdings Co Ltd | JP Morgan | (83) | 5.500 | Casio Computer Co Ltd | Citibank | (1.145) |
| 700 | Arcs Co Ltd | Citibank | (367) | 2.000 | Casio Computer Co Ltd | JP Morgan | (1.932) |
| 2.900 | Arcs Co Ltd | HSBC | (2.217) | (4.400) | Central Glass Co Ltd | Citibank | (3.976) |
| (500) | Argo Graphics Inc | Citibank | 336 | (800) | Central Glass Co Ltd | JP Morgan | (778) |
| (100) | Argo Graphics Inc | JP Morgan | (73) | (2.400) | Change Inc | Citibank | (721) |
| (200) | Ariake Japan Co Ltd | Citibank | 350 | 800 | Charm Care Corp KK | Citibank | (656) |
| (400) | Ariake Japan Co Ltd | HSBC | 302 | 100 | Charm Care Corp KK | HSBC | (25) |
| (200) | Ariake Japan Co Ltd | JP Morgan | 157 | 700 | Charm Care Corp KK | JP Morgan | (335) |
| 1.500 | ARTERIA Networks Corp | Citibank | (451) | (3.500) | Chiba Bank Ltd | HSBC | 2.227 |
| 800 | ARTERIA Networks Corp | HSBC | (447) | (6.000) | Chiba Bank Ltd | JP Morgan | 3.846 |
| 1.100 | ARTERIA Networks Corp | JP Morgan | (624) | (500) | Chofu Seisakusho Co Ltd | HSBC | 103 |
| (200) | Aruhi Corp | JP Morgan | 36 | (400) | Chofu Seisakusho Co Ltd | JP Morgan | 99 |
| (200) | As One Corp | Citibank | 818 | (1.500) | Chubu Electric Power Co Inc | Citibank | 431 |
| (300) | As One Corp | JP Morgan | 276 | (4.000) | Chubu Electric Power Co Inc | JP Morgan | 508 |
| (800) | Asahi Group Holdings Ltd | Citibank | (392) | | | | |
| (700) | Asahi Intecc Co Ltd | JP Morgan | 498 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------------|-------------|---|--------------------------|--|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 4.500 | Chubu Shiryō Co Ltd | Citibank | (884) | (100) | Daiichi Sankyo Co Ltd | Citibank | 9 |
| 10.500 | Chubu Shiryō Co Ltd | JP Morgan | 2.179 | (1.000) | Daiichi Sankyo Co Ltd | HSBC | (1.123) |
| 600 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | (505) | (300) | Daiichi Sankyo Co Ltd | JP Morgan | (396) |
| 700 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | (645) | (300) | Daiichikoshō Co Ltd | Citibank | (273) |
| 400 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | (155) | (700) | Daiichikoshō Co Ltd | JP Morgan | (2.446) |
| (12.300) | Chugoku Bank Ltd | JP Morgan | 2.573 | 2.300 | Daiken Corp | Citibank | (371) |
| 1.800 | Citizen Watch Co Ltd | Citibank | (6) | 1.400 | Daiken Corp | JP Morgan | (1.877) |
| 1.500 | Citizen Watch Co Ltd | JP Morgan | 782 | (800) | Daiki Aluminium Industry Co Ltd | Citibank | 534 |
| 2.300 | CKD Corp | Citibank | 31 | (1.600) | Daiki Aluminium Industry Co Ltd | JP Morgan | (228) |
| 700 | CKD Corp | JP Morgan | 1.330 | 300 | Daikin Industries Ltd | Citibank | 1.653 |
| 2.100 | CMIC Holdings Co Ltd | HSBC | 620 | 300 | Daikin Industries Ltd | JP Morgan | 4.195 |
| 1.800 | CMIC Holdings Co Ltd | JP Morgan | 516 | 600 | Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co Ltd | JP Morgan | (356) |
| 2.100 | Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc | Citibank | (1.967) | (1.100) | Daio Paper Corp | Citibank | (113) |
| 2.700 | Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc | HSBC | (1.933) | (1.900) | Daio Paper Corp | HSBC | 510 |
| (15.700) | COLOPL Inc | Citibank | 151 | (1.000) | Daio Paper Corp | JP Morgan | (116) |
| (7.100) | COLOPL Inc | HSBC | (578) | (1.100) | Daishi Hokuetsu Financial Group Inc | Citibank | 19 |
| (500) | COLOPL Inc | JP Morgan | (39) | (4.800) | Daishi Hokuetsu Financial Group Inc | JP Morgan | 864 |
| 400 | Colowide Co Ltd | Citibank | (341) | 500 | Daishinku Corp | Citibank | 36 |
| (7) | Comforia Residential Inc (REIT) | Citibank | (248) | 700 | Daishinku Corp | JP Morgan | (190) |
| (3) | Comforia Residential Inc (REIT) | JP Morgan | (288) | 200 | Daito Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | (188) |
| 2.600 | COMSYS Holdings Corp | JP Morgan | (4.808) | 200 | Daito Trust Construction Co Ltd | Citibank | 139 |
| 600 | Comture Corp | Citibank | (728) | 100 | Daito Trust Construction Co Ltd | HSBC | 65 |
| 600 | Comture Corp | HSBC | 632 | 200 | Daito Trust Construction Co Ltd | JP Morgan | 115 |
| 900 | Comture Corp | JP Morgan | 388 | 2.000 | Daiwa House Industry Co Ltd | Citibank | (2.092) |
| (13.200) | Concordia Financial Group Ltd | Citibank | 648 | 1.000 | Daiwa House Industry Co Ltd | HSBC | 315 |
| (16.700) | Concordia Financial Group Ltd | JP Morgan | 5.053 | (22) | Daiwa House Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (1.359) |
| 2.200 | Cosel Co Ltd | Citibank | (267) | (3) | Daiwa Office Investment Corp (REIT) | HSBC | 749 |
| (600) | Cosmo Energy Holdings Co Ltd | HSBC | (1.554) | (8) | Daiwa Office Investment Corp (REIT) | JP Morgan | 2.034 |
| (300) | Cosmo Energy Holdings Co Ltd | JP Morgan | (771) | (2.600) | Daiwa Securities Group Inc | Citibank | 74 |
| 300 | Cosmos Pharmaceutical Corp | Citibank | 1.601 | (5.500) | Daiwa Securities Group Inc | HSBC | (277) |
| 400 | Cosmos Pharmaceutical Corp | HSBC | 3.388 | (24.600) | Daiwa Securities Group Inc | JP Morgan | (1.145) |
| 200 | Cosmos Pharmaceutical Corp | JP Morgan | 1.680 | (53) | Daiwa Securities Living Investments Corp (REIT) | Citibank | (1.557) |
| (16) | CRE Logistics Inc (REIT) | Citibank | (658) | (60) | Daiwa Securities Living Investments Corp (REIT) | HSBC | (2.482) |
| (51) | CRE Logistics Inc (REIT) | JP Morgan | (5.560) | (115) | Daiwa Securities Living Investments Corp (REIT) | JP Morgan | (4.676) |
| (500) | Create Restaurants Holdings Inc | Citibank | 38 | (1.200) | Daiwabo Holdings Co Ltd | Citibank | 216 |
| (1.900) | Create Restaurants Holdings Inc | JP Morgan | (1.119) | (900) | Daiwabo Holdings Co Ltd | HSBC | (713) |
| (2.900) | Credit Saison Co Ltd | Citibank | 947 | (2.600) | Daiwabo Holdings Co Ltd | JP Morgan | (2.034) |
| (3.300) | Credit Saison Co Ltd | HSBC | 355 | (11.600) | DCM Holdings Co Ltd | Citibank | 2.763 |
| (1.300) | Credit Saison Co Ltd | JP Morgan | 314 | (1.800) | DCM Holdings Co Ltd | HSBC | 64 |
| 2.100 | Curves Holdings Co Ltd | Citibank | (838) | 1.100 | Demae-Can Co Ltd | Citibank | (463) |
| 1.600 | Curves Holdings Co Ltd | JP Morgan | 134 | 900 | Demae-Can Co Ltd | HSBC | (456) |
| (700) | CyberAgent Inc | HSBC | (224) | 1.700 | Demae-Can Co Ltd | JP Morgan | (864) |
| (2.900) | CYBERDYNE Inc | Citibank | 228 | (900) | DeNA Co Ltd | JP Morgan | 22 |
| (1.500) | CYBERDYNE Inc | HSBC | (26) | (200) | Denka Co Ltd | HSBC | 386 |
| (800) | CYBERDYNE Inc | JP Morgan | (24) | (1.400) | Denka Co Ltd | JP Morgan | 2.228 |
| 600 | Dai Nippon Printing Co Ltd | Citibank | (121) | (300) | Densu Corp | Citibank | (456) |
| 800 | Dai Nippon Printing Co Ltd | HSBC | 1.019 | 1.200 | Dentsu Group Inc | Citibank | (2.890) |
| 600 | Dai-Dan Co Ltd | HSBC | 154 | 1.000 | Dentsu Group Inc | HSBC | (2.834) |
| (300) | Daido Steel Co Ltd | HSBC | 132 | 500 | Dentsu Group Inc | JP Morgan | (1.410) |
| 800 | Daifuku Co Ltd | HSBC | 2.513 | (400) | Descente Ltd | Citibank | 194 |
| 500 | Daifuku Co Ltd | JP Morgan | 1.547 | (100) | Descente Ltd | JP Morgan | (217) |
| (400) | Daiichi Jitsugyo Co Ltd | JP Morgan | 915 | 600 | DIC Corp | HSBC | 72 |
| (600) | Dai-ichi Life Holdings Inc | HSBC | (51) | | | | |
| (5.000) | Dai-ichi Life Holdings Inc | JP Morgan | (347) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return

Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------|-------------|---|--------------------------|---|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 1.300 | DIC Corp | JP Morgan | 135 | (400) | Food & Life Cos Ltd | HSBC | 315 |
| 800 | Digital Arts Inc | Citibank | 9 | (1.300) | Food & Life Cos Ltd | JP Morgan | 1.049 |
| (400) | Digital Garage Inc | Citibank | 432 | 1.800 | FP Corp | Citibank | 272 |
| (300) | Digital Garage Inc | JP Morgan | 485 | 2.600 | FP Corp | JP Morgan | 1.332 |
| 1.200 | Digital Hearts Holdings Co Ltd | Citibank | (539) | (500) | Freee KK | Citibank | 1.424 |
| 300 | Digital Hearts Holdings Co Ltd | HSBC | 585 | (300) | Freee KK | HSBC | 577 |
| 1.600 | Digital Hearts Holdings Co Ltd | JP Morgan | 3.101 | (100) | Freee KK | JP Morgan | 237 |
| (800) | Digital Holdings Inc | Citibank | 551 | 600 | Fronteo Inc | JP Morgan | 866 |
| (2.600) | Digital Holdings Inc | HSBC | 312 | (11) | Frontier Real Estate Investment Corp (REIT) | Citibank | (1.105) |
| (2.000) | Digital Holdings Inc | JP Morgan | 345 | (6) | Frontier Real Estate Investment Corp (REIT) | HSBC | (1.618) |
| 300 | dip Corp | HSBC | (251) | (2) | Frontier Real Estate Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (533) |
| 100 | Dip Corp | Citibank | (335) | (400) | Fudo Tetra Corp | HSBC | (148) |
| 1.200 | Dip Corp | JP Morgan | (2.126) | (2.100) | Fudo Tetra Corp | JP Morgan | (758) |
| 2.300 | Direct Marketing MiX Inc | JP Morgan | 3.952 | (1.100) | Fuji Corp | JP Morgan | (651) |
| 300 | Disco Corp | JP Morgan | 10.461 | (600) | Fuji Electric Co Ltd | Citibank | (802) |
| 6.700 | DMG Mori Co Ltd | JP Morgan | 15.370 | (800) | Fuji Electric Co Ltd | HSBC | (2.345) |
| 2.600 | Doshisha Co Ltd | Citibank | 121 | 3.200 | Fuji Media Holdings Inc | Citibank | 183 |
| 1.400 | Doshisha Co Ltd | HSBC | (66) | 4.400 | Fuji Media Holdings Inc | HSBC | (193) |
| 3.100 | Doshisha Co Ltd | JP Morgan | (117) | 9.100 | Fuji Media Holdings Inc | JP Morgan | (436) |
| 800 | Double Standard Inc | JP Morgan | 1.641 | 2.200 | Fuji Oil Holdings Inc | Citibank | (1.210) |
| 3.200 | Doutor Nichires Holdings Co Ltd | Citibank | (796) | 2.000 | Fuji Oil Holdings Inc | HSBC | (802) |
| 2.700 | Doutor Nichires Holdings Co Ltd | HSBC | (310) | 1.200 | Fuji Oil Holdings Inc | JP Morgan | (577) |
| 400 | Doutor Nichires Holdings Co Ltd | JP Morgan | 86 | 2.600 | Fuji Seal International Inc | Citibank | (1.370) |
| (200) | Dowa Holdings Co Ltd | JP Morgan | 989 | 2.200 | Fuji Seal International Inc | HSBC | (2.730) |
| 1.300 | Duskin Co Ltd | Citibank | (503) | 2.200 | Fuji Seal International Inc | JP Morgan | (2.754) |
| 500 | Duskin Co Ltd | HSBC | (163) | (100) | Fuji Soft Inc | JP Morgan | (272) |
| 3.100 | Duskin Co Ltd | JP Morgan | (1.062) | 1.500 | Fujicco Co Ltd | HSBC | (1.038) |
| (400) | DyDo Group Holdings Inc | JP Morgan | 703 | 1.200 | FUJIFILM Holdings Corp | Citibank | 1.617 |
| 300 | East Japan Railway Co | Citibank | (298) | 100 | FUJIFILM Holdings Corp | HSBC | 7 |
| 600 | East Japan Railway Co | HSBC | (227) | 1.500 | Fujimi Inc | Citibank | 2.031 |
| 400 | East Japan Railway Co | JP Morgan | (177) | 100 | Fujimi Inc | HSBC | 268 |
| 900 | Ebara Corp | Citibank | (877) | 600 | Fujimi Inc | JP Morgan | 1.586 |
| 1.200 | Ebara Corp | HSBC | (3.078) | 900 | Fujimori Kogyo Co Ltd | Citibank | 1 |
| (100) | Eisai Co Ltd | Citibank | 265 | 1.800 | Fujimori Kogyo Co Ltd | JP Morgan | 765 |
| 3.900 | Elan Corp | Citibank | 111 | (200) | Fujio Food Group Inc | Citibank | 76 |
| 200 | Elan Corp | HSBC | 180 | (100) | Fujio Food Group Inc | JP Morgan | 37 |
| 800 | Elan Corp | JP Morgan | 715 | (2.800) | Fujitec Co Ltd | JP Morgan | (179) |
| (100) | Elecom Co Ltd | Citibank | 43 | (900) | Fujitsu General Ltd | Citibank | (690) |
| (100) | Elecom Co Ltd | JP Morgan | 6 | (500) | Fujitsu General Ltd | HSBC | (1.286) |
| (400) | EM Systems Co Ltd | JP Morgan | 103 | (1.800) | Fujitsu General Ltd | JP Morgan | (4.605) |
| 1.900 | en Japan Inc | Citibank | (1.796) | 100 | Fujitsu Ltd | Citibank | (458) |
| (2.400) | ENEOS Holdings Inc | Citibank | (2) | 100 | Fujiya Co Ltd | HSBC | (1) |
| (12.200) | ENEOS Holdings Inc | HSBC | (4.755) | 3.800 | Fujiya Co Ltd | JP Morgan | (92) |
| (4.900) | ENEOS Holdings Inc | JP Morgan | (1.895) | 2.000 | Fukui Computer Holdings Inc | Citibank | (1.681) |
| (500) | Enplas Corp | Citibank | 151 | 300 | Fukui Computer Holdings Inc | HSBC | 171 |
| (100) | Enplas Corp | HSBC | 3 | 700 | Fukui Computer Holdings Inc | JP Morgan | 386 |
| (3.300) | ES-Con Japan Ltd | Citibank | 38 | (5.000) | Fukuoka Financial Group Inc | JP Morgan | 5.713 |
| (9.400) | ES-Con Japan Ltd | HSBC | (2.092) | (1.200) | Fukuyama Transporting Co Ltd | JP Morgan | 4.083 |
| (9.700) | ES-Con Japan Ltd | JP Morgan | (1.824) | 1.100 | FULLCAST Holdings Co Ltd | JP Morgan | 77 |
| (3.700) | euglena Co Ltd | Citibank | 969 | 700 | Funai Soken Holdings Inc | Citibank | (263) |
| (6.200) | euglena Co Ltd | JP Morgan | (1.704) | 1.400 | Funai Soken Holdings Inc | HSBC | 343 |
| 7.400 | EXEO Group Inc | Citibank | (3.088) | 1.500 | Funai Soken Holdings Inc | JP Morgan | 348 |
| 2.300 | EXEO Group Inc | HSBC | (1.498) | (900) | Furukawa Battery Co Ltd | Citibank | (164) |
| 2.000 | EXEO Group Inc | JP Morgan | (1.330) | (100) | Furukawa Battery Co Ltd | HSBC | (22) |
| 600 | Ezaki Glico Co Ltd | Citibank | (665) | (1.800) | Furukawa Battery Co Ltd | JP Morgan | (376) |
| (1.000) | Fancl Corp | JP Morgan | 1.574 | 200 | Furukawa Electric Co Ltd | JP Morgan | 85 |
| (400) | FANUC Corp | Citibank | (263) | 400 | Fuso Chemical Co Ltd | Citibank | 54 |
| 400 | Fast Fitness Japan Inc | Citibank | (218) | 1.000 | Fuso Chemical Co Ltd | HSBC | 1.065 |
| 200 | Fast Fitness Japan Inc | HSBC | (59) | 900 | Fuso Chemical Co Ltd | JP Morgan | 891 |
| 600 | Fast Fitness Japan Inc | JP Morgan | 28 | 200 | Future Corp | Citibank | (55) |
| (100) | Fast Retailing Co Ltd | JP Morgan | (2.713) | 800 | Future Corp | HSBC | (240) |
| 4.800 | FCC Co Ltd | Citibank | (228) | 200 | Future Corp | JP Morgan | (30) |
| 600 | FCC Co Ltd | HSBC | 42 | | | | |
| 1.400 | FCC Co Ltd | JP Morgan | 86 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-------------|---|--------------------------|---------------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 500 | Fuyo General Lease Co Ltd | Citibank | (322) | (4.400) | Heiwa Corp | HSBC | (1.659) |
| 100 | Fuyo General Lease Co Ltd | HSBC | 268 | (500) | Heiwa Corp | JP Morgan | (183) |
| 1.100 | Fuyo General Lease Co Ltd | JP Morgan | 2.901 | 400 | Heiwa Real Estate Co Ltd | Citibank | (320) |
| 1.100 | G-7 Holdings Inc | Citibank | (224) | 400 | Heiwa Real Estate Co Ltd | HSBC | (426) |
| 100 | G-7 Holdings Inc | HSBC | (64) | 900 | Heiwa Real Estate Co Ltd | JP Morgan | (722) |
| 1.400 | G-7 Holdings Inc | JP Morgan | (601) | (32) | Heiwa Real Estate Inc (REIT) | JP Morgan | 551 |
| 1.100 | Gakken Holdings Co Ltd | Citibank | 143 | 100 | Henнге KK | HSBC | 101 |
| 1.100 | Gakken Holdings Co Ltd | JP Morgan | 105 | 1.000 | Henнге KK | JP Morgan | 1.001 |
| 400 | Geo Holdings Corp | Citibank | 10 | 900 | Hibiya Engineering Ltd | Citibank | 307 |
| 1.500 | Geo Holdings Corp | JP Morgan | (184) | (900) | Hiday Hidaka Corp | Citibank | 312 |
| (1.700) | gitfee Inc | JP Morgan | (2.333) | (2.900) | Hiday Hidaka Corp | HSBC | (1.902) |
| (5) | Global One Real Estate Investment Corp (REIT) | Citibank | 15 | (100) | Hiday Hidaka Corp | JP Morgan | (8) |
| (3) | Global One Real Estate Investment Corp (REIT) | HSBC | (21) | 100 | Hikari Tsushin Inc | Citibank | 240 |
| (2) | Global One Real Estate Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (12) | 100 | Hikari Tsushin Inc | JP Morgan | 378 |
| (200) | GLOBERIDE Inc | HSBC | 98 | (2.600) | Hino Motors Ltd | JP Morgan | (800) |
| (200) | GLOBERIDE Inc | JP Morgan | 101 | 200 | Hioki EE Corp | Citibank | (298) |
| 4.000 | Glory Ltd | JP Morgan | (3.791) | 100 | Hioki EE Corp | JP Morgan | (30) |
| (34) | GLP J- (REIT) | JP Morgan | 910 | (600) | Hirata Corp | Citibank | (296) |
| (4.500) | GMO Financial Holdings Inc | Citibank | (155) | (300) | Hirata Corp | HSBC | (179) |
| (2.400) | GMO Financial Holdings Inc | HSBC | 189 | (300) | Hirata Corp | JP Morgan | (302) |
| (2.600) | GMO Financial Holdings Inc | JP Morgan | 209 | (38.700) | Hirogin Holdings Inc | JP Morgan | 6.023 |
| 700 | GMO internet Inc | Citibank | (542) | 100 | Hirose Electric Co Ltd | JP Morgan | 650 |
| 100 | GMO internet Inc | HSBC | 100 | (1.700) | HIS Co Ltd | Citibank | (1.433) |
| 1.400 | GMO internet Inc | JP Morgan | (257) | (900) | HIS Co Ltd | JP Morgan | (1.646) |
| 200 | GMO Payment Gateway Inc | Citibank | (23) | 1.000 | Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc | Citibank | (1.554) |
| (200) | GNI Group Ltd | Citibank | (70) | 300 | Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc | HSBC | (67) |
| (200) | GNI Group Ltd | HSBC | (308) | 1.600 | Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc | JP Morgan | (391) |
| (100) | GNI Group Ltd | JP Morgan | (153) | 1.100 | Hitachi Construction Machinery Co Ltd | Citibank | 625 |
| 1.300 | Goldcrest Co Ltd | Citibank | (5) | 200 | Hitachi Ltd | JP Morgan | 656 |
| 1.600 | Goldcrest Co Ltd | JP Morgan | 1.100 | (100) | Hitachi Metals Ltd | Citibank | (2) |
| (400) | Goldwin Inc | HSBC | (5.110) | (4.400) | Hitachi Metals Ltd | HSBC | (1.889) |
| (1.100) | GS Yuasa Corp | Citibank | 805 | (1.100) | Hitachi Metals Ltd | JP Morgan | (458) |
| (1.200) | GS Yuasa Corp | HSBC | 1.562 | (400) | Hitachi Transport System Ltd | JP Morgan | (117) |
| (4.400) | GS Yuasa Corp | JP Morgan | 5.789 | 300 | Hochiki Corp | Citibank | (143) |
| (700) | G-Tekt Corp | Citibank | 52 | 700 | Hochiki Corp | HSBC | 416 |
| (300) | G-Tekt Corp | HSBC | (56) | 900 | Hodogaya Chemical Co Ltd | Citibank | (712) |
| (800) | G-Tekt Corp | JP Morgan | (143) | 600 | Hodogaya Chemical Co Ltd | HSBC | 228 |
| (700) | GungHo Online Entertainment Inc | HSBC | 885 | 900 | Hodogaya Chemical Co Ltd | JP Morgan | 322 |
| (1.600) | GungHo Online Entertainment Inc | JP Morgan | 2.048 | (3.600) | Hogy Medical Co Ltd | Citibank | 1.959 |
| 900 | Gunma Bank Ltd | Citibank | (24) | (1.100) | Hogy Medical Co Ltd | HSBC | 851 |
| 13.400 | Gunma Bank Ltd | HSBC | (2.080) | (1.200) | Hogy Medical Co Ltd | JP Morgan | 1.192 |
| 500 | Gunma Bank Ltd | JP Morgan | (79) | (3.400) | Hokkaido Electric Power Co Inc | JP Morgan | 567 |
| (500) | H.U. Group Holdings Inc | Citibank | 122 | (400) | Hokkoku Financial Holdings Inc | Citibank | (283) |
| (500) | H.U. Group Holdings Inc | HSBC | 934 | (1.700) | Hokkoku Financial Holdings Inc | HSBC | 1.454 |
| (1.100) | H.U. Group Holdings Inc | JP Morgan | 2.075 | (1.500) | Hokuetsu Corp | Citibank | (41) |
| 1.200 | H2O Retailing Corp | Citibank | 478 | (1.400) | Hokuetsu Corp | HSBC | 644 |
| 400 | H2O Retailing Corp | JP Morgan | 184 | (400) | Hokuhoku Financial Group Inc | JP Morgan | 617 |
| (4.900) | Hachijuni Bank Ltd | HSBC | (78) | (4.000) | Hokuhoku Financial Group Inc | HSBC | 280 |
| (23.000) | Hachijuni Bank Ltd | JP Morgan | (303) | (18.100) | Hokuriku Electric Power Co | JP Morgan | 2.823 |
| 2.300 | Hakuhodo DY Holdings Inc | Citibank | 131 | (2.000) | Hokuto Corp | Citibank | 1.015 |
| (1.000) | Hakuto Co Ltd | Citibank | 62 | (800) | Hokuto Corp | HSBC | 716 |
| (1.200) | Hakuto Co Ltd | HSBC | 13 | (2.800) | Honda Motor Co Ltd | JP Morgan | 482 |
| (500) | Hakuto Co Ltd | JP Morgan | 14 | 100 | Horiba Ltd | HSBC | (2.657) |
| 300 | Halows Co Ltd | Citibank | (368) | (9) | Hoshino Resorts Inc (REIT) | Citibank | 102 |
| 100 | Halows Co Ltd | JP Morgan | 123 | (1) | Hoshino Resorts Inc (REIT) | HSBC | (932) |
| 1.900 | Hamamatsu Photonics KK | Citibank | 760 | (19) | Hoshino Resorts Inc (REIT) | JP Morgan | (348) |
| 500 | Hamamatsu Photonics KK | JP Morgan | 1.445 | (300) | Hoshizaki Corp | HSBC | (6.535) |
| (1.100) | Hankyu Hanshin Holdings Inc | JP Morgan | (329) | (300) | Hoshizaki Corp | JP Morgan | 293 |
| (6) | Hankyu Hanshin Inc (REIT) | Citibank | 41 | | | | 363 |
| (47) | Hankyu Hanshin Inc (REIT) | HSBC | (1.162) | | | | |
| (2) | Hankyu Hanshin Inc (REIT) | JP Morgan | (48) | | | | |
| (1.100) | Haseko Corp | Citibank | 74 | | | | |
| (4.000) | Haseko Corp | HSBC | 536 | | | | |
| 200 | HEALIOS KK | HSBC | (560) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return

Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-------------|---|--------------------------|---|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (10.400) | Hosiden Corp | Citibank | 976 | (6.100) | Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd | HSBC | (3.814) |
| (2.500) | Hosiden Corp | HSBC | 1.177 | 7.300 | Ishihara Sangyo Kaisha Ltd | Citibank | (982) |
| (3.600) | Hosiden Corp | JP Morgan | 1.723 | 800 | Ishihara Sangyo Kaisha Ltd | JP Morgan | (38) |
| 300 | Hosokawa Micron Corp | Citibank | 420 | (300) | Isuzu Motors Ltd | Citibank | 65 |
| 1.300 | Hosokawa Micron Corp | HSBC | 2.546 | (3.500) | Isuzu Motors Ltd | HSBC | 148 |
| 1.400 | Hosokawa Micron Corp | JP Morgan | 1.617 | (200) | Isuzu Motors Ltd | JP Morgan | 10 |
| (1.200) | House Foods Group Inc | HSBC | 2.377 | 500 | ITmedia Inc | Citibank | (111) |
| (600) | House Foods Group Inc | JP Morgan | 1.200 | 900 | ITmedia Inc | HSBC | 833 |
| 500 | Hoya Corp | Citibank | 1.058 | 200 | ITmedia Inc | JP Morgan | 116 |
| 400 | Hoya Corp | HSBC | 4.205 | 100 | Ito En Ltd | HSBC | 118 |
| (4.600) | HS Holdings Co Ltd | Citibank | (1.083) | 300 | Ito En Ltd | JP Morgan | 344 |
| (1.300) | HS Holdings Co Ltd | JP Morgan | (296) | (36) | Itochu Advance Logistics Investment Corp (REIT) | Citibank | (1.439) |
| (500) | Hulic Co Ltd | Citibank | 25 | (12) | Itochu Advance Logistics Investment Corp (REIT) | HSBC | (806) |
| (200) | Hulic Co Ltd | HSBC | (17) | (49) | Itochu Advance Logistics Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (3.188) |
| (800) | Hulic Co Ltd | JP Morgan | (64) | 700 | ITOCHU Corp | HSBC | 324 |
| (46) | Hulic Inc (REIT) | Citibank | (185) | 7.400 | ITOCHU Corp | JP Morgan | 9.280 |
| (20.500) | Hyakugo Bank Ltd | HSBC | 2.934 | 2.400 | Itochu Techno-Solutions Corp | Citibank | (780) |
| (34.600) | Hyakugo Bank Ltd | JP Morgan | 5.025 | 400 | Itochu Techno-Solutions Corp | HSBC | 872 |
| (600) | Ibiden Co Ltd | Citibank | 453 | 3.800 | Itochu Techno-Solutions Corp | JP Morgan | 8.216 |
| (1.200) | Ibiden Co Ltd | HSBC | (809) | 19.400 | Itoham Yonekyu Holdings Inc | Citibank | (2.780) |
| (100) | Ibiden Co Ltd | JP Morgan | (66) | 5.400 | Itoham Yonekyu Holdings Inc | HSBC | (13) |
| 3.500 | IBJ Inc | Citibank | (91) | 7.300 | Itoham Yonekyu Holdings Inc | JP Morgan | (47) |
| 1.800 | IBJ Inc | HSBC | 912 | 500 | Itokuro Inc | HSBC | (55) |
| 4.000 | IBJ Inc | JP Morgan | 2.009 | 400 | Itokuro Inc | JP Morgan | (45) |
| (800) | Ichibanya Co Ltd | JP Morgan | (810) | (200) | Iwatani Corp | Citibank | 208 |
| (24.000) | Ichigo Inc | Citibank | 1.110 | (200) | Iwatani Corp | HSBC | (402) |
| (2.200) | Ichigo Inc | HSBC | (287) | (2.100) | Iwatani Corp | JP Morgan | (4.159) |
| (9.500) | Ichigo Inc | JP Morgan | (1.222) | (3.000) | Iyo Bank Ltd | Citibank | 262 |
| (2.800) | Idemitsu Kosan Co Ltd | JP Morgan | 1.512 | (2.400) | Iyo Bank Ltd | HSBC | 43 |
| 3.300 | IDOM Inc | Citibank | (42) | (7.600) | Iyo Bank Ltd | JP Morgan | (173) |
| (300) | IHI Corp | Citibank | (199) | 1.000 | Izumi Co Ltd | HSBC | 212 |
| (300) | IHI Corp | HSBC | (1.586) | 2.200 | Izumi Co Ltd | JP Morgan | 239 |
| (100) | IHI Corp | JP Morgan | (527) | 1.800 | J Front Retailing Co Ltd | Citibank | 421 |
| 1.100 | I'll Inc | Citibank | (206) | 6.000 | J Front Retailing Co Ltd | HSBC | 2.533 |
| 100 | I'll Inc | HSBC | 111 | 1.600 | J Front Retailing Co Ltd | JP Morgan | 666 |
| 1.900 | I'll Inc | JP Morgan | 2.085 | (2.700) | J Trust Co Ltd | JP Morgan | (3.497) |
| (2.500) | Inabata & Co Ltd | Citibank | (398) | 2.500 | JAC Recruitment Co Ltd | Citibank | 908 |
| (600) | Inabata & Co Ltd | JP Morgan | (342) | 400 | JAC Recruitment Co Ltd | HSBC | 181 |
| (13) | Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT) | Citibank | (177) | 3.800 | JAC Recruitment Co Ltd | JP Morgan | 1.080 |
| (37) | Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT) | HSBC | (1.894) | (2.300) | Jaccs Co Ltd | Citibank | (762) |
| (65) | Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (3.252) | (200) | Jaccs Co Ltd | HSBC | (200) |
| (300) | Infomart Corp | Citibank | 30 | (2.600) | Jaccs Co Ltd | JP Morgan | (2.544) |
| (3.000) | Infomart Corp | JP Morgan | 62 | 700 | Jafco Co Ltd | HSBC | 271 |
| 200 | Information Services International-Dentsu Ltd | Citibank | (141) | (1.500) | Japan Airlines Co Ltd | Citibank | (918) |
| 700 | Information Services International-Dentsu Ltd | HSBC | 1.157 | (800) | Japan Airlines Co Ltd | HSBC | (1.139) |
| 100 | Information Services International-Dentsu Ltd | JP Morgan | 163 | (2.800) | Japan Airlines Co Ltd | JP Morgan | (3.948) |
| (6.500) | INFRONEER Holdings Inc | JP Morgan | 555 | (1.000) | Japan Airport Terminal Co Ltd | JP Morgan | 709 |
| 3.000 | Inpex Corp | Citibank | 3.590 | (2.800) | Japan Aviation Electronics Industry Ltd | HSBC | (2.935) |
| 400 | Insource Co Ltd | Citibank | 9 | (4.200) | Japan Aviation Electronics Industry Ltd | JP Morgan | (4.354) |
| 100 | Insource Co Ltd | HSBC | 87 | (6.300) | Japan Communications Inc | Citibank | 48 |
| 200 | Insource Co Ltd | JP Morgan | 161 | (9.200) | Japan Communications Inc | HSBC | (2.236) |
| 700 | Internet Initiative Japan Inc | JP Morgan | 4.430 | (1.600) | Japan Exchange Group Inc | HSBC | (2.085) |
| 300 | Inui Global Logistics Co Ltd | HSBC | (72) | (1.500) | Japan Exchange Group Inc | JP Morgan | (1.937) |
| 300 | Inui Global Logistics Co Ltd | JP Morgan | 481 | (77) | Japan Hotel Investment Corp (REIT) | Citibank | 395 |
| (47) | Invincible Investment Corp (REIT) | HSBC | 475 | (4) | Japan Hotel Investment Corp (REIT) | HSBC | 37 |
| (141) | Invincible Investment Corp (REIT) | JP Morgan | 1.465 | | | | |
| 600 | I-PEX Inc | JP Morgan | (136) | | | | |
| (2.200) | Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd | Citibank | (163) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-------------|---|--------------------------|---------------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (87) | Japan Hotel Investment Corp (REIT) | JP Morgan | 833 | (600) | Justsystems Corp | JP Morgan | 2.347 |
| 200 | Japan Lifeline Co Ltd | HSBC | (66) | (2.700) | Kadokawa Corp | JP Morgan | 1.794 |
| 1.000 | Japan Lifeline Co Ltd | JP Morgan | (336) | (2.400) | Kagome Co Ltd | Citibank | 2.295 |
| 2 | Japan Logistics Fund Inc (REIT) | JP Morgan | (38) | (1.200) | Kagome Co Ltd | HSBC | (1.234) |
| (1.000) | Japan Material Co Ltd | Citibank | 851 | (5.900) | Kagome Co Ltd | JP Morgan | (5.953) |
| (1.400) | Japan Material Co Ltd | HSBC | 892 | (4.100) | Kajima Corp | JP Morgan | 923 |
| 400 | Japan Medical Dynamic Marketing Inc | HSBC | 473 | 1.300 | Kakaku.com Inc | HSBC | 452 |
| 400 | Japan Medical Dynamic Marketing Inc | JP Morgan | 469 | 200 | Kakaku.com Inc | JP Morgan | (96) |
| (13) | Japan Metropolitan Fund Invest (REIT) | Citibank | (432) | (700) | Kaken Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 1.579 |
| (16) | Japan Metropolitan Fund Invest (REIT) | HSBC | (745) | 600 | Kamei Corp | Citibank | (110) |
| (7) | Japan Metropolitan Fund Invest (REIT) | JP Morgan | (321) | 1.500 | Kamei Corp | HSBC | 303 |
| (800) | Japan Post Bank Co Ltd | Citibank | 79 | 1.600 | Kamei Corp | JP Morgan | 312 |
| (2.000) | Japan Post Bank Co Ltd | HSBC | 201 | 3.000 | Kamigumi Co Ltd | Citibank | (1.270) |
| (3.800) | Japan Post Holdings Co Ltd | Citibank | (349) | 400 | Kamigumi Co Ltd | HSBC | 1.105 |
| (3.200) | Japan Post Holdings Co Ltd | HSBC | (197) | 6.200 | Kamigumi Co Ltd | JP Morgan | 17.045 |
| (400) | Japan Post Holdings Co Ltd | JP Morgan | (28) | 2.200 | Kanamoto Co Ltd | Citibank | (441) |
| (600) | Japan Post Insurance Co Ltd | Citibank | 314 | 400 | Kanamoto Co Ltd | HSBC | (78) |
| (1.300) | Japan Post Insurance Co Ltd | HSBC | 151 | 8.500 | Kanamoto Co Ltd | JP Morgan | (1.705) |
| (7.900) | Japan Post Insurance Co Ltd | JP Morgan | 4.244 | 5.300 | Kandenko Co Ltd | Citibank | (662) |
| 17 | Japan Prime Realty Investment Corp (REIT) | Citibank | (269) | 8.000 | Kandenko Co Ltd | HSBC | (705) |
| 12 | Japan Prime Realty Investment Corp (REIT) | HSBC | 1.968 | 5.100 | Kandenko Co Ltd | JP Morgan | (475) |
| (15) | Japan Real Estate Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (1.856) | 800 | Kaneka Corp | HSBC | (614) |
| (7.700) | Japan Securities Finance Co Ltd | JP Morgan | 4.195 | 2.200 | Kaneka Corp | JP Morgan | (1.735) |
| (1.600) | Japan Steel Works Ltd | JP Morgan | (3.082) | 3.000 | Kanematsu Corp | JP Morgan | (317) |
| 1.500 | Japan Wool Textile Co Ltd | HSBC | (385) | (400) | Kansai Paint Co Ltd | Citibank | (54) |
| 7.300 | Japan Wool Textile Co Ltd | JP Morgan | (1.919) | (400) | Kansai Paint Co Ltd | JP Morgan | (58) |
| 800 | JBCC Holdings Inc | HSBC | 956 | 600 | Kanto Denka Kogyo Co Ltd | Citibank | 18 |
| (500) | JCR Pharmaceuticals Co Ltd | Citibank | 844 | (1.100) | Kao Corp | Citibank | (730) |
| (800) | JCR Pharmaceuticals Co Ltd | HSBC | (626) | (100) | Kao Corp | HSBC | (125) |
| (1.100) | JCR Pharmaceuticals Co Ltd | JP Morgan | (845) | (900) | Kao Corp | JP Morgan | (1.119) |
| 1.100 | JCU Corp | Citibank | (1.046) | (500) | Katakura Industries Co Ltd | Citibank | 681 |
| 700 | JCU Corp | HSBC | 2.388 | (2.100) | Katakura Industries Co Ltd | JP Morgan | 5.051 |
| 1.100 | JCU Corp | JP Morgan | 3.730 | 200 | Katitas Co Ltd | Citibank | (178) |
| (4.700) | JDC Corp | Citibank | 847 | 200 | Katitas Co Ltd | HSBC | 182 |
| (1.800) | JDC Corp | HSBC | 307 | 600 | Katitas Co Ltd | JP Morgan | 539 |
| (200) | JDC Corp | JP Morgan | 31 | 700 | Kato Sangyo Co Ltd | Citibank | (269) |
| 300 | Jeol Ltd | HSBC | 1.093 | 400 | Kato Sangyo Co Ltd | HSBC | (513) |
| (200) | JFE Holdings Inc | Citibank | (60) | 3.100 | Kato Sangyo Co Ltd | JP Morgan | (4.041) |
| (400) | JFE Holdings Inc | HSBC | (391) | (1.600) | Kawasaki Heavy Industries Ltd | JP Morgan | (2.394) |
| (300) | JFE Holdings Inc | JP Morgan | (290) | 300 | Kawasaki Kisen Kaisha Ltd | Citibank | 517 |
| 2.500 | JGC Holdings Corp | Citibank | 1.927 | 100 | Kawasaki Kisen Kaisha Ltd | HSBC | 2.037 |
| 400 | JGC Holdings Corp | HSBC | 1.185 | (2.700) | KDDI Corp | Citibank | 2.242 |
| (300) | JIG-SAW Inc | JP Morgan | (496) | (1.500) | KDDI Corp | HSBC | (2.630) |
| 100 | JINS Holdings Inc | Citibank | (177) | (900) | KDDI Corp | JP Morgan | (1.554) |
| 700 | JINS Holdings Inc | HSBC | 139 | (2.700) | Keihan Holdings Co Ltd | JP Morgan | (1.902) |
| 1.200 | JINS Holdings Inc | JP Morgan | 207 | 600 | Keihanshin Building Co Ltd | JP Morgan | (97) |
| (200) | JSR Corp | Citibank | (486) | (1.700) | Keikyu Corp | Citibank | 229 |
| (3.300) | JSR Corp | HSBC | (14.825) | (600) | Keikyu Corp | HSBC | (268) |
| (1.200) | JSR Corp | JP Morgan | (5.769) | (2.500) | Keikyu Corp | JP Morgan | (1.096) |
| 1.100 | JTEKT Corp | HSBC | 474 | (500) | Keio Corp | JP Morgan | 1.573 |
| 200 | JTOWER Inc | Citibank | (444) | 1.500 | Keisei Electric Railway Co Ltd | Citibank | (1.093) |
| (200) | Juroku Financial Group Inc | JP Morgan | (56) | 100 | KEIWA Inc | Citibank | 88 |
| (800) | Justsystems Corp | HSBC | 3.103 | (1.600) | Keiyo Bank Ltd | Citibank | 43 |
| | | | | (7.000) | Keiyo Bank Ltd | HSBC | 2.136 |
| | | | | (12.300) | Keiyo Bank Ltd | JP Morgan | 3.791 |
| | | | | (13.100) | Keiyo Co Ltd | Citibank | (1.385) |
| | | | | (4.200) | Keiyo Co Ltd | HSBC | (424) |
| | | | | (8.000) | Keiyo Co Ltd | JP Morgan | (799) |
| | | | | (1) | Kenedix Office Investment Corp (REIT) | HSBC | 130 |
| | | | | (800) | Kewpie Corp | Citibank | 451 |
| | | | | (700) | Kewpie Corp | HSBC | 221 |
| | | | | (200) | Kewpie Corp | JP Morgan | 66 |
| | | | | 200 | Keyence Corp | JP Morgan | 3.078 |
| | | | | 400 | KH Neochem Co Ltd | Citibank | (266) |
| | | | | 2.100 | KH Neochem Co Ltd | JP Morgan | 1.229 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------|-------------|---|--------------------------|---------------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 500 | Kikkoman Corp | JP Morgan | (432) | 8.700 | Kuraray Co Ltd | HSBC | 1.838 |
| 500 | Kinden Corp | HSBC | 8 | 4.700 | Kuraray Co Ltd | JP Morgan | 962 |
| 2.400 | Kinden Corp | JP Morgan | 230 | (300) | Kurita Water Industries Ltd | HSBC | (382) |
| 200 | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | Citibank | (147) | (600) | Kurita Water Industries Ltd | JP Morgan | (914) |
| 200 | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | JP Morgan | 108 | (800) | Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd | JP Morgan | (1.103) |
| 1.600 | Kintetsu World Express Inc | Citibank | (387) | 1.900 | Kyocera Corp | Citibank | 326 |
| 2.800 | Kirin Holdings Co Ltd | JP Morgan | 2.155 | 700 | Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd | HSBC | 280 |
| (1.100) | Kisoji Co Ltd | Citibank | 227 | 1.800 | Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd | JP Morgan | 702 |
| (200) | Kisoji Co Ltd | HSBC | (5) | (3.500) | KYORIN Holdings Inc | Citibank | 2.094 |
| (200) | Kisoji Co Ltd | JP Morgan | (46) | (1.200) | KYORIN Holdings Inc | HSBC | 1.668 |
| (2.600) | Kissei Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 1.767 | (2.000) | KYORIN Holdings Inc | JP Morgan | 2.804 |
| (2.600) | Kissei Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | 16 | (1.000) | Kyoritsu Maintenance Co Ltd | JP Morgan | (2.058) |
| (500) | Kissei Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 11 | 300 | Kyowa Kirin Co Ltd | Citibank | (52) |
| (800) | Ki-Star Real Estate Co Ltd | Citibank | 865 | 200 | Kyowa Kirin Co Ltd | HSBC | 288 |
| (100) | Ki-Star Real Estate Co Ltd | HSBC | 244 | 500 | Kyowa Kirin Co Ltd | JP Morgan | 711 |
| (200) | Ki-Star Real Estate Co Ltd | JP Morgan | 495 | 300 | Kyudenko Corp | Citibank | (69) |
| 4.100 | Kitz Corp | HSBC | 664 | 800 | Kyudenko Corp | HSBC | (124) |
| (4.100) | Kiyo Bank Ltd | JP Morgan | 674 | 300 | Kyudenko Corp | JP Morgan | 93 |
| (800) | Koa Corp | Citibank | (84) | (37.000) | Kyushu Financial Group Inc | JP Morgan | 4.596 |
| (400) | Koa Corp | HSBC | 23 | 100 | Lacto Japan Co Ltd | JP Morgan | (1) |
| (500) | Koa Corp | JP Morgan | (302) | (15) | LaSalle Logiport (REIT) | Citibank | (154) |
| 1.700 | Koatsu Gas Kogyo Co Ltd | Citibank | 75 | (40) | LaSalle Logiport (REIT) | JP Morgan | (3.507) |
| 2.900 | Koatsu Gas Kogyo Co Ltd | JP Morgan | 163 | 100 | Lasertec Corp | Citibank | 632 |
| 100 | Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | (584) | (1.000) | LEC Inc | JP Morgan | 1.204 |
| 1.300 | Kobe Bussan Co Ltd | Citibank | 2.288 | (19.700) | Leopalace21 Corp | JP Morgan | (16.275) |
| 200 | Kobe Bussan Co Ltd | HSBC | 479 | 700 | Life Corp | Citibank | (186) |
| (800) | Kobe Steel Ltd | Citibank | 48 | 200 | Life Corp | HSBC | (49) |
| (2.300) | Kobe Steel Ltd | HSBC | (2.260) | 1.000 | Lifenet Insurance Co | HSBC | 602 |
| (1.900) | Kobe Steel Ltd | JP Morgan | (1.860) | 3.700 | Link And Motivation Inc | Citibank | (303) |
| (300) | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | Citibank | (49) | 5.300 | Link And Motivation Inc | JP Morgan | 1.373 |
| (300) | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | HSBC | (143) | 100 | Lintec Corp | Citibank | 47 |
| (500) | Kohnan Shoji Co Ltd | Citibank | 258 | 1.100 | Lintec Corp | HSBC | (215) |
| (700) | Kohnan Shoji Co Ltd | HSBC | (293) | 300 | Lintec Corp | JP Morgan | (63) |
| (2.100) | Kohnan Shoji Co Ltd | JP Morgan | (831) | 1.200 | Lion Corp | Citibank | 460 |
| (500) | Koito Manufacturing Co Ltd | JP Morgan | 67 | 6.600 | Lion Corp | HSBC | 5.436 |
| 1.000 | Kojima Co Ltd | Citibank | 31 | 2.200 | Lion Corp | JP Morgan | 1.794 |
| 1.600 | Kokuyo Co Ltd | Citibank | (516) | 200 | LITALICO Inc | Citibank | 189 |
| 2.500 | Kokuyo Co Ltd | HSBC | (1.162) | 700 | LITALICO Inc | JP Morgan | 1.009 |
| 800 | Kokuyo Co Ltd | JP Morgan | (380) | (1.200) | Lixil Corp | JP Morgan | 369 |
| (2.700) | Komatsu Ltd | Citibank | (291) | 900 | M&A Capital Partners Co Ltd | Citibank | 120 |
| (1.800) | Komatsu Ltd | HSBC | (867) | 400 | M&A Capital Partners Co Ltd | HSBC | 356 |
| (1.500) | Komatsu Ltd | JP Morgan | (1.808) | 1.000 | M&A Capital Partners Co Ltd | JP Morgan | 787 |
| 9.400 | KOMEDA Holdings Co Ltd | Citibank | (1.234) | 400 | M3 Inc | Citibank | 241 |
| (1.200) | Komeri Co Ltd | Citibank | 97 | 200 | Mabuchi Motor Co Ltd | HSBC | 143 |
| 300 | Konami Holdings Corp | JP Morgan | 2.995 | 800 | Mabuchi Motor Co Ltd | JP Morgan | 553 |
| (700) | Konica Minolta Inc | Citibank | 40 | 200 | Macnica Fuji Electronics Holdings Inc | Citibank | 47 |
| (2.600) | Konica Minolta Inc | HSBC | 200 | 100 | Macnica Fuji Electronics Holdings Inc | JP Morgan | 73 |
| 1.600 | Konishi Co Ltd | Citibank | 656 | 1.500 | Macromill Inc | Citibank | (316) |
| 7.600 | Konoike Transport Co Ltd | Citibank | 1.107 | 800 | Maeda Kosen Co Ltd | HSBC | 365 |
| 2.400 | Konoike Transport Co Ltd | HSBC | 549 | 500 | Maeda Kosen Co Ltd | JP Morgan | 220 |
| 4.200 | Konoike Transport Co Ltd | JP Morgan | 930 | 400 | Makino Milling Machine Co Ltd | Citibank | (36) |
| (100) | Kose Corp | HSBC | (29) | (400) | Makita Corp | Citibank | 362 |
| (700) | Kose Corp | JP Morgan | (154) | (200) | Makita Corp | JP Morgan | 410 |
| (300) | Koshidaka Holdings Co Ltd | Citibank | 112 | 300 | Management Solutions Co Ltd | JP Morgan | 1.147 |
| (800) | Koshidaka Holdings Co Ltd | HSBC | (20) | (800) | Mandom Corp | Citibank | (51) |
| (400) | Koshidaka Holdings Co Ltd | JP Morgan | (8) | (500) | Mandom Corp | JP Morgan | (500) |
| 300 | Kotobuki Spirits Co Ltd | JP Morgan | 783 | 3.700 | Mani Inc | Citibank | 162 |
| (700) | K's Holdings Corp | Citibank | 239 | 1.800 | Mani Inc | HSBC | 896 |
| (3.500) | K's Holdings Corp | HSBC | 1.543 | 4.500 | Mani Inc | JP Morgan | 2.200 |
| (500) | K's Holdings Corp | JP Morgan | 225 | | | | |
| (1.400) | Kubota Corp | Citibank | (1.211) | | | | |
| (4.400) | Kubota Corp | HSBC | (5.003) | | | | |
| (3.000) | Kubota Corp | JP Morgan | (2.743) | | | | |
| 7.900 | Kuraray Co Ltd | Citibank | (1.581) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|----------------------------------|-------------|---|--------------------------|--|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 1.200 | Marubeni Corp | Citibank | (101) | (600) | Mercari Inc | HSBC | (119) |
| 500 | Marubeni Corp | HSBC | (17) | (100) | Mercari Inc | JP Morgan | (19) |
| (1.800) | Maruha Nichiro Corp | Citibank | 2.242 | 300 | Midac Holdings Co Ltd | Citibank | 151 |
| (2.400) | Marui Group Co Ltd | JP Morgan | (3.481) | 600 | Midac Holdings Co Ltd | JP Morgan | 4.248 |
| (1.000) | Maruichi Steel Tube Ltd | Citibank | (736) | (6.100) | Mie Kotsu Group Holdings Inc | Citibank | 129 |
| (100) | Maruichi Steel Tube Ltd | HSBC | (167) | (3.100) | Mie Kotsu Group Holdings Inc | JP Morgan | (455) |
| 100 | Maruwa Co Ltd | HSBC | 202 | 400 | Milbon Co Ltd | Citibank | (188) |
| 100 | Maruwa Co Ltd | JP Morgan | 423 | 300 | Milbon Co Ltd | HSBC | 228 |
| 500 | Maruzen Showa Unyu Co Ltd | Citibank | 61 | 200 | Mimasu Semiconductor Industry Co Ltd | JP Morgan | 141 |
| 300 | Maruzen Showa Unyu Co Ltd | HSBC | (199) | (200) | MINEBEA MITSUMI Inc | Citibank | 37 |
| (2.700) | Matsui Securities Co Ltd | HSBC | (395) | 1.000 | Mirait Holdings Corp | Citibank | (391) |
| (19.100) | Matsui Securities Co Ltd | JP Morgan | (2.698) | 1.300 | Mirait Holdings Corp | HSBC | (1.953) |
| (900) | MatsukiyoCocokara & Co | Citibank | (717) | 800 | Mirait Holdings Corp | JP Morgan | (1.211) |
| (300) | MatsukiyoCocokara & Co | HSBC | (1.867) | 500 | MISUMI Group Inc | HSBC | 416 |
| (500) | MatsukiyoCocokara & Co | JP Morgan | (3.098) | (200) | Mitani Sekisan Co Ltd | HSBC | (573) |
| (1.600) | Matsuyafoods Holdings Co Ltd | JP Morgan | (710) | (600) | Mitani Sekisan Co Ltd | JP Morgan | (1.701) |
| 500 | Max Co Ltd | Citibank | (91) | (4.400) | Mitsubishi Chemical Holdings Corp | Citibank | 735 |
| 1.700 | Max Co Ltd | HSBC | 288 | (11.000) | Mitsubishi Chemical Holdings Corp | HSBC | 1.285 |
| 2.200 | Max Co Ltd | JP Morgan | 72 | (3.300) | Mitsubishi Chemical Holdings Corp | JP Morgan | 345 |
| 900 | Maxell Ltd | Citibank | 104 | 4.100 | Mitsubishi Corp | Citibank | 20 |
| 800 | Maxvalu Tokai Co Ltd | Citibank | (1) | 300 | Mitsubishi Corp | HSBC | 350 |
| 1.700 | Maxvalu Tokai Co Ltd | JP Morgan | 1.201 | (400) | Mitsubishi Electric Corp | Citibank | 75 |
| (5.200) | Mazda Motor Corp | JP Morgan | (4.068) | (3.900) | Mitsubishi Electric Corp | HSBC | (1.625) |
| 800 | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | Citibank | (1.061) | (800) | Mitsubishi Electric Corp | JP Morgan | (485) |
| 100 | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | HSBC | 21 | 4.600 | Mitsubishi Estate Co Ltd | HSBC | 2.929 |
| 200 | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | JP Morgan | 37 | 800 | Mitsubishi Estate Co Ltd | JP Morgan | 297 |
| (2.200) | MCJ Co Ltd | Citibank | (768) | (38) | Mitsubishi Estate Logistics Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (5.241) |
| (3.200) | MCJ Co Ltd | HSBC | (191) | (400) | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | Citibank | (146) |
| 6.100 | Mebuki Financial Group Inc | Citibank | (354) | (6.900) | Mitsubishi HC Capital Inc | JP Morgan | (1.789) |
| 6.400 | Mebuki Financial Group Inc | JP Morgan | (267) | 700 | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | Citibank | 17 |
| 400 | MEC Co Ltd | HSBC | 1.890 | 400 | Mitsubishi Logisnext Co Ltd | HSBC | 336 |
| 2.500 | MEC Co Ltd | JP Morgan | 11.567 | 300 | Mitsubishi Logisnext Co Ltd | JP Morgan | 251 |
| 100 | Media Do Co Ltd | Citibank | 16 | 4.700 | Mitsubishi Logistics Corp | JP Morgan | (2.209) |
| 1.200 | Media Do Co Ltd | JP Morgan | 1.963 | (500) | Mitsubishi Materials Corp | HSBC | 120 |
| 5.100 | Medical Data Vision Co Ltd | Citibank | 827 | (1.800) | Mitsubishi Materials Corp | JP Morgan | 26 |
| 1.200 | Medical Data Vision Co Ltd | HSBC | 431 | (400) | Mitsubishi Motors Corp | HSBC | (154) |
| 3.000 | Medical Data Vision Co Ltd | JP Morgan | 1.061 | (5.400) | Mitsubishi Motors Corp | JP Morgan | (2.066) |
| 800 | Medipal Holdings Corp | JP Morgan | 141 | 6.000 | Mitsubishi Pencil Co Ltd | Citibank | 1.120 |
| (200) | MedPeer Inc | Citibank | 285 | 3.900 | Mitsubishi Pencil Co Ltd | HSBC | 1.263 |
| (400) | MedPeer Inc | HSBC | 1.365 | 2.500 | Mitsubishi Pencil Co Ltd | JP Morgan | 789 |
| (200) | MedPeer Inc | JP Morgan | 686 | 1.400 | Mitsubishi Research Institute Inc | Citibank | (1.029) |
| 300 | Megachips Corp | JP Morgan | 899 | 500 | Mitsubishi Shokuhin Co Ltd | Citibank | (237) |
| 3.100 | Megmilk Snow Brand Co Ltd | Citibank | (1.528) | 100 | Mitsubishi Shokuhin Co Ltd | HSBC | (15) |
| 2.300 | Megmilk Snow Brand Co Ltd | HSBC | (3.043) | (15.400) | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | HSBC | 2.751 |
| 2.200 | Megmilk Snow Brand Co Ltd | JP Morgan | (2.937) | (29.700) | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | JP Morgan | 5.445 |
| 200 | MEIJI Holdings Co Ltd | HSBC | 9 | 7.200 | Mitsui & Co Ltd | Citibank | 4.256 |
| 2.400 | Meiko Network Japan Co Ltd | Citibank | 3 | 3.000 | Mitsui & Co Ltd | JP Morgan | (801) |
| 4.100 | Meiko Network Japan Co Ltd | HSBC | 819 | 100 | Mitsui Chemicals Inc | Citibank | 50 |
| 400 | Meiko Network Japan Co Ltd | JP Morgan | 78 | (900) | Mitsui DM Sugar Holdings Co Ltd | Citibank | 326 |
| 4.800 | Meisei Industrial Co Ltd | Citibank | 900 | (1.500) | Mitsui DM Sugar Holdings Co Ltd | HSBC | 320 |
| 4.400 | Meisei Industrial Co Ltd | HSBC | 2.051 | (2.200) | Mitsui DM Sugar Holdings Co Ltd | JP Morgan | 495 |
| 4.100 | Meisei Industrial Co Ltd | JP Morgan | 1.894 | 2.600 | Mitsui Fudosan Co Ltd | Citibank | 1.320 |
| 100 | Meitec Corp | Citibank | 25 | 800 | Mitsui Fudosan Co Ltd | JP Morgan | 768 |
| 400 | Meitec Corp | JP Morgan | 1.742 | | | | |
| 200 | Menicon Co Ltd | HSBC | 205 | | | | |
| 800 | Menicon Co Ltd | JP Morgan | 806 | | | | |
| (800) | Mercari Inc | Citibank | (296) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--|-------------|---|--------------------------|--|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (5) | Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT) | Citibank | (140) | (11.300) | Musashino Bank Ltd | JP Morgan | 3.475 |
| (8) | Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT) | HSBC | (1.443) | 400 | Nabtesco Corp | JP Morgan | 973 |
| (16) | Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT) | JP Morgan | (2.832) | 600 | Nachi-Fujikoshi Corp | Citibank | (215) |
| (100) | Mitsui High-Tec Inc | Citibank | 454 | (2.400) | Nafco Co Ltd | Citibank | 11 |
| 100 | Mitsui High-Tec Inc | Citibank | (454) | (800) | Nafco Co Ltd | HSBC | 229 |
| (100) | Mitsui High-Tec Inc | JP Morgan | (9) | (2.800) | Nafco Co Ltd | JP Morgan | 831 |
| (200) | Mitsui Mining & Smelting Co Ltd | Citibank | (3) | 3.200 | Nagase & Co Ltd | Citibank | 258 |
| (600) | Mitsui Mining & Smelting Co Ltd | HSBC | (1.040) | 500 | Nagase & Co Ltd | JP Morgan | 94 |
| (200) | Mitsui OSK Lines Ltd | JP Morgan | (290) | 800 | Nagoya Railroad Co Ltd | Citibank | (580) |
| 200 | Mitsui-Soko Holdings Co Ltd | HSBC | 375 | 1.500 | Nagoya Railroad Co Ltd | JP Morgan | (1.235) |
| 400 | Mitsui-Soko Holdings Co Ltd | JP Morgan | (45) | 300 | Nakanishi Inc | Citibank | 506 |
| (600) | Miura Co Ltd | Citibank | (464) | 200 | Nakanishi Inc | HSBC | 778 |
| (1.100) | Miura Co Ltd | HSBC | (1.244) | (2.000) | Nankai Electric Railway Co Ltd | Citibank | 2.000 |
| (5.600) | Miura Co Ltd | JP Morgan | (11.673) | (1.600) | Nankai Electric Railway Co Ltd | JP Morgan | 275 |
| (2.500) | Mixi Inc | Citibank | 112 | (1.500) | Nanto Bank Ltd | Citibank | 269 |
| (600) | Mixi Inc | HSBC | 130 | (1.400) | Nanto Bank Ltd | HSBC | 900 |
| (2.300) | Mixi Inc | JP Morgan | 1.648 | (8.900) | Nanto Bank Ltd | JP Morgan | 5.831 |
| (300) | Miyakoshi Holdings Inc | Citibank | 29 | 800 | NEC Corp | Citibank | (194) |
| (400) | Miyakoshi Holdings Inc | JP Morgan | (91) | 200 | NEC Corp | HSBC | (28) |
| (800) | Mizuho Financial Group Inc | HSBC | 17 | 700 | NEC Corp | JP Morgan | (771) |
| (4.600) | Mizuho Financial Group Inc | JP Morgan | 1.213 | 800 | NEC Networks & System Integration Corp | Citibank | (432) |
| 1.200 | Mizuno Corp | HSBC | 1.697 | 1.700 | NEC Networks & System Integration Corp | HSBC | 396 |
| 1.700 | Mizuno Corp | JP Morgan | 2.382 | 600 | NEC Networks & System Integration Corp | JP Morgan | 225 |
| 200 | Mochida Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | (411) | 400 | NET One Systems Co Ltd | Citibank | (50) |
| 100 | Mochida Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | (1) | 1.300 | NET One Systems Co Ltd | JP Morgan | 1.278 |
| (1.800) | Monex Group Inc | Citibank | (298) | (200) | Net Protections Holdings Inc | Citibank | 5 |
| (5.300) | Monex Group Inc | HSBC | 1.714 | (600) | Net Protections Holdings Inc | HSBC | (154) |
| (5.800) | Monex Group Inc | JP Morgan | 1.896 | 2.000 | Naturen Co Ltd | Citibank | (208) |
| (300) | Money Forward Inc | JP Morgan | (117) | 2.300 | Naturen Co Ltd | JP Morgan | 1.114 |
| 200 | Monogatari Corp | HSBC | 417 | (900) | Nexon Co Ltd | JP Morgan | (2.400) |
| 300 | Monogatari Corp | JP Morgan | 616 | 800 | Nextage Co Ltd ^{tr} | Citibank | — |
| 2.200 | MonotaRO Co Ltd | HSBC | (563) | 100 | NGK Insulators Ltd | Citibank | 45 |
| 32 | Mori Hills Investment Corp (REIT) | Citibank | 178 | 2.700 | NGK Spark Plug Co Ltd | Citibank | (782) |
| 30 | Mori Hills Investment Corp (REIT) | HSBC | 1.523 | 200 | NH Foods Ltd | JP Morgan | (101) |
| (100) | Morinaga & Co Ltd | Citibank | 26 | (2.000) | NHK Spring Co Ltd | Citibank | (62) |
| (500) | Morinaga & Co Ltd | HSBC | 218 | (400) | NHK Spring Co Ltd | HSBC | (274) |
| (900) | Morinaga & Co Ltd | JP Morgan | 415 | (6.800) | NHK Spring Co Ltd | JP Morgan | (4.628) |
| 700 | Morinaga Milk Industry Co Ltd | HSBC | (1.729) | 4.400 | Nichias Corp | Citibank | 1.066 |
| 2.100 | Morita Holdings Corp | Citibank | 21 | 400 | Nichiden Corp | Citibank | 107 |
| 1.100 | Morita Holdings Corp | JP Morgan | 89 | 100 | Nichiden Corp | JP Morgan | 52 |
| 3.000 | MOS Food Services Inc | Citibank | (935) | 1.100 | Nichiha Corp | Citibank | 1.030 |
| 1.600 | MOS Food Services Inc | HSBC | 1.020 | 100 | Nichiha Corp | HSBC | 92 |
| 2.700 | MOS Food Services Inc | JP Morgan | 1.569 | 1.000 | Nichiha Corp | JP Morgan | 910 |
| 1.900 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | Citibank | 789 | (400) | Nichi-iko Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 77 |
| 1.200 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | HSBC | 1.963 | 200 | Nichirei Corp | Citibank | (99) |
| 600 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | JP Morgan | 1.258 | 2.700 | Nichirei Corp | JP Morgan | (748) |
| 500 | MTG Co Ltd | Citibank | 68 | (400) | Nichirei Corp | JP Morgan | — |
| 300 | MTG Co Ltd | HSBC | (266) | 100 | Nidec Corp | Citibank | 148 |
| 700 | MTG Co Ltd | JP Morgan | (626) | 500 | Nidec Corp | HSBC | 2.232 |
| 2.000 | Murata Manufacturing Co Ltd | Citibank | (443) | (2.700) | Nifco Inc | HSBC | 475 |
| 200 | Murata Manufacturing Co Ltd | HSBC | 313 | 100 | Nihon Jyoho Create Co Ltd | Citibank | (57) |
| 300 | Murata Manufacturing Co Ltd | JP Morgan | 455 | 100 | Nihon Jyoho Create Co Ltd | HSBC | 196 |
| (800) | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd | Citibank | 23 | 300 | Nihon Jyoho Create Co Ltd | JP Morgan | 587 |
| | | | | 2.000 | Nihon Kohden Corp | JP Morgan | (706) |
| | | | | 1.400 | Nihon M&A Center Holdings Inc | Citibank | 827 |
| | | | | (2.000) | Nikon Holdings Co Ltd | JP Morgan | (761) |
| | | | | 2.800 | Nikon Corp | JP Morgan | 3.144 |
| | | | | 200 | Nintendo Co Ltd | JP Morgan | (2.852) |
| | | | | (1) | Nippon Accommodations Fund Inc (REIT) | Citibank | (137) |
| | | | | (3) | Nippon Accommodations Fund Inc (REIT) | HSBC | (852) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|------------------------------------|-------------|---|--------------------------|-------------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (12) | Nippon Building Fund Inc (REIT) | Citibank | 833 | 600 | Nippon Shokubai Co Ltd | JP Morgan | 493 |
| (4) | Nippon Building Fund Inc (REIT) | HSBC | (1.026) | (1.600) | Nippon Signal Company Ltd | Citibank | (15) |
| (11) | Nippon Building Fund Inc (REIT) | JP Morgan | (1.917) | (8.900) | Nippon Signal Company Ltd | HSBC | 399 |
| (300) | Nippon Carbon Co Ltd | Citibank | (44) | (10.000) | Nippon Signal Company Ltd | JP Morgan | 504 |
| (1.100) | Nippon Carbon Co Ltd | HSBC | 90 | 500 | Nippon Soda Co Ltd | Citibank | 219 |
| (500) | Nippon Carbon Co Ltd | JP Morgan | (284) | 800 | Nippon Soda Co Ltd | JP Morgan | 3.380 |
| (400) | Nippon Chemi-Con Corp | HSBC | 298 | 600 | Nippon Steel Corp | Citibank | 489 |
| (1.300) | Nippon Chemi-Con Corp | JP Morgan | 985 | (1.000) | Nippon Steel Trading Corp | HSBC | (1.553) |
| (4.600) | Nippon Coke & Engineering Co Ltd | Citibank | 337 | (300) | Nippon Steel Trading Corp | JP Morgan | (456) |
| (4.600) | Nippon Coke & Engineering Co Ltd | HSBC | 118 | 100 | Nippon Suisan Kaisha Ltd | Citibank | (15) |
| (4.600) | Nippon Coke & Engineering Co Ltd | JP Morgan | 46 | 13.500 | Nippon Suisan Kaisha Ltd | JP Morgan | (4.593) |
| (5.800) | Nippon Denko Co Ltd | HSBC | 155 | 500 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | Citibank | (150) |
| (1.100) | Nippon Denko Co Ltd | JP Morgan | (25) | 2.200 | Nippon Television Holdings Inc | HSBC | (140) |
| 300 | Nippon Densetsu Kogyo Co Ltd | JP Morgan | 61 | 2.700 | Nippon Television Holdings Inc | JP Morgan | (495) |
| (400) | Nippon Electric Glass Co Ltd | Citibank | (57) | (100) | Nippon Yakin Kogyo Co Ltd | HSBC | (106) |
| (1.200) | Nippon Electric Glass Co Ltd | JP Morgan | (301) | (300) | Nippon Yakin Kogyo Co Ltd | JP Morgan | (363) |
| 1.000 | Nippon Express Holdings Inc | Citibank | (493) | 200 | Nippon Yusen KK | HSBC | 2.010 |
| 500 | Nippon Express Holdings Inc | HSBC | 885 | 200 | Nippon Yusen KK | JP Morgan | 1.712 |
| 400 | Nippon Gas Co Ltd | HSBC | 155 | (1.900) | Nipro Corp | Citibank | 149 |
| (100) | Nippon Kanmai Co Ltd | Citibank | 28 | (12.000) | Nipro Corp | JP Morgan | (2.488) |
| (100) | Nippon Kanmai Co Ltd | JP Morgan | 133 | 800 | Nishimatsu Construction Co Ltd | HSBC | 2.150 |
| (8.600) | Nippon Kayaku Co Ltd | JP Morgan | (1.331) | 1.300 | Nishimatsuya Chain Co Ltd | Citibank | (1.084) |
| 1.500 | Nippon Koei Co Ltd | Citibank | 1.050 | (6.000) | Nishi-Nippon Financial Holdings Inc | Citibank | (406) |
| 100 | Nippon Koei Co Ltd | HSBC | 213 | (1.700) | Nishi-Nippon Financial Holdings Inc | HSBC | 336 |
| 300 | Nippon Koei Co Ltd | JP Morgan | 635 | (8.900) | Nishi-Nippon Financial Holdings Inc | JP Morgan | 1.802 |
| (700) | Nippon Light Metal Holdings Co Ltd | HSBC | 169 | (2.300) | Nishi-Nippon Railroad Co Ltd | JP Morgan | (3.209) |
| (900) | Nippon Light Metal Holdings Co Ltd | JP Morgan | 253 | (500) | Nissan Chemical Corp | Citibank | 436 |
| (3.100) | Nippon Paint Holdings Co Ltd | HSBC | 262 | (200) | Nissan Chemical Corp | HSBC | (55) |
| 1.300 | Nippon Paper Industries Co Ltd | Citibank | (288) | (100) | Nissan Chemical Corp | JP Morgan | 41 |
| 500 | Nippon Paper Industries Co Ltd | HSBC | (349) | 6.600 | Nissan Motor Co Ltd | Citibank | (114) |
| 7.400 | Nippon Paper Industries Co Ltd | JP Morgan | (5.220) | 4.700 | Nissan Motor Co Ltd | JP Morgan | (448) |
| 1.100 | Nippon Pillar Packing Co Ltd | Citibank | 601 | (100) | Nissei ASB Machine Co Ltd | Citibank | (186) |
| 100 | Nippon Pillar Packing Co Ltd | HSBC | 310 | (300) | Nissei ASB Machine Co Ltd | HSBC | (693) |
| 1.000 | Nippon Pillar Packing Co Ltd | JP Morgan | 3.089 | (200) | Nissei ASB Machine Co Ltd | JP Morgan | (458) |
| (10) | Nippon Prologis Inc (REIT) | Citibank | 1.165 | (800) | Nisshin Seifun Group Inc | Citibank | 362 |
| (5) | Nippon Prologis Inc (REIT) | HSBC | (63) | 800 | Nisshinbo Holdings Inc | Citibank | 112 |
| (28) | Nippon Prologis Inc (REIT) | JP Morgan | (294) | 300 | Nissin Foods Holdings Co Ltd | Citibank | (735) |
| (1.200) | Nippon Sanso Holdings Corp | Citibank | 26 | 600 | Nissin Foods Holdings Co Ltd | HSBC | (1.866) |
| (3.300) | Nippon Sanso Holdings Corp | HSBC | (742) | 900 | Nissin Foods Holdings Co Ltd | JP Morgan | (2.849) |
| (1.200) | Nippon Sanso Holdings Corp | JP Morgan | (1.131) | 100 | Nitori Holdings Co Ltd | Citibank | 296 |
| (100) | Nippon Sharyo Ltd | Citibank | 11 | 100 | Nitori Holdings Co Ltd | HSBC | 760 |
| (700) | Nippon Sharyo Ltd | HSBC | (373) | 400 | Nitori Holdings Co Ltd | JP Morgan | 3.008 |
| (6.000) | Nippon Sheet Glass Co Ltd | Citibank | (57) | 200 | Nittetsu Mining Co Ltd | Citibank | (211) |
| (7.200) | Nippon Sheet Glass Co Ltd | HSBC | (309) | 100 | Nittetsu Mining Co Ltd | JP Morgan | 79 |
| (100) | Nippon Shinyaku Co Ltd | Citibank | 37 | 300 | Nitto Boseki Co Ltd | Citibank | 655 |
| (200) | Nippon Shinyaku Co Ltd | HSBC | (154) | 300 | Nitto Boseki Co Ltd | HSBC | 569 |
| 1.000 | Nippon Shokubai Co Ltd | Citibank | 1.085 | 100 | Nitto Boseki Co Ltd | JP Morgan | 188 |
| 200 | Nippon Shokubai Co Ltd | HSBC | 171 | 500 | Nitto Denko Corp | JP Morgan | 1.875 |
| | | | | 3.600 | Nitto Kohki Co Ltd | Citibank | (1.203) |
| | | | | 2.500 | Nitto Kohki Co Ltd | HSBC | 445 |
| | | | | 1.000 | Nitto Kohki Co Ltd | JP Morgan | 169 |
| | | | | 1.000 | Nittoku Co Ltd | Citibank | 835 |
| | | | | 300 | Nittoku Co Ltd | HSBC | 1.082 |
| | | | | 1.000 | Nittoku Co Ltd | JP Morgan | 3.593 |
| | | | | (200) | Noevir Holdings Co Ltd | JP Morgan | (890) |
| | | | | (400) | NOF Corp | Citibank | (1.104) |
| | | | | (2.300) | NOF Corp | HSBC | (4.168) |
| | | | | (300) | NOF Corp | JP Morgan | (524) |
| | | | | (700) | Nohmi Bosai Ltd | Citibank | 91 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return

Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-------------|---|--------------------------|---|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (100) | Nohmi Bosai Ltd | JP Morgan | 164 | (300) | Okinawa Cellular Telephone Co | Citibank | 212 |
| 1.100 | NOK Corp | Citibank | 300 | (1.500) | Okinawa Cellular Telephone Co | HSBC | (2.810) |
| 1.600 | NOK Corp | HSBC | 572 | (2.400) | Okinawa Cellular Telephone Co | JP Morgan | (4.367) |
| 5.600 | NOK Corp | JP Morgan | 1.962 | (1.700) | Okinawa Electric Power Co Inc | HSBC | 510 |
| 700 | Nomura Co Ltd | HSBC | 318 | (200) | OKUMA Corp | HSBC | (821) |
| 2.400 | Nomura Co Ltd | JP Morgan | 1.079 | (1.300) | OKUMA Corp | JP Morgan | (1.747) |
| (11.000) | Nomura Holdings Inc | HSBC | (2.031) | 300 | Okumura Corp | HSBC | (544) |
| (13.700) | Nomura Holdings Inc | JP Morgan | (2.488) | 1.000 | Olympus Corp | JP Morgan | 3.668 |
| (200) | Nomura Micro Science Co Ltd | Citibank | 104 | 1.000 | Omron Corp | Citibank | (758) |
| (200) | Nomura Micro Science Co Ltd | JP Morgan | (926) | 1.200 | Omron Corp | JP Morgan | 2.812 |
| (500) | Nomura Real Estate Holdings Inc | Citibank | 222 | 1.100 | Onward Holdings Co Ltd | Citibank | 38 |
| 1 | Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT) | Citibank | 14 | 6.000 | Onward Holdings Co Ltd | JP Morgan | 669 |
| 11 | Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT) | JP Morgan | 400 | (800) | Open Door Inc | Citibank | (11) |
| 300 | Nomura Research Institute Ltd | Citibank | (46) | 400 | Open House Group Co Ltd | HSBC | 1.755 |
| 1.300 | Nomura Research Institute Ltd | HSBC | 3.119 | 700 | Open House Group Co Ltd | JP Morgan | 3.051 |
| 2.900 | Nomura Research Institute Ltd | JP Morgan | 6.899 | (700) | Optim Corp | HSBC | (163) |
| (200) | Noritsu Koki Co Ltd | Citibank | 5 | (300) | Optorun Co Ltd | Citibank | (208) |
| (100) | Noritsu Koki Co Ltd | HSBC | (176) | (900) | Optorun Co Ltd | HSBC | (1.152) |
| (900) | Noritsu Koki Co Ltd | JP Morgan | (1.706) | (5.100) | Optorun Co Ltd | JP Morgan | (5.550) |
| (19.700) | North Pacific Bank Ltd | Citibank | 351 | 300 | Oracle Corp Japan | Citibank | (1.239) |
| (4.800) | North Pacific Bank Ltd | HSBC | 175 | 100 | Oracle Corp Japan | HSBC | (217) |
| (4.800) | North Pacific Bank Ltd | JP Morgan | 521 | (65.100) | Orient Corp | JP Morgan | (283) |
| 200 | NS Solutions Corp | Citibank | (152) | 100 | Oriental Land Co Ltd | Citibank | 233 |
| (300) | NSK Ltd | Citibank | 29 | 200 | Oriental Land Co Ltd | HSBC | 3.077 |
| (1.800) | NSK Ltd | JP Morgan | (239) | 400 | Oriental Land Co Ltd | JP Morgan | 4.876 |
| (6.900) | NTN Corp | Citibank | (77) | (7.000) | ORIX Corp | JP Morgan | (6.400) |
| (9.100) | NTN Corp | HSBC | 315 | (60) | Orix JREIT Inc (REIT) | JP Morgan | (3.714) |
| (1.900) | NTN Corp | JP Morgan | 54 | 700 | Oro Co Ltd | Citibank | (250) |
| 3.400 | NTT Data Corp | Citibank | (1.088) | 500 | Oro Co Ltd | HSBC | 432 |
| 1.600 | NTT Data Corp | JP Morgan | (4.788) | 600 | Oro Co Ltd | JP Morgan | 511 |
| (10) | NTT UD Investment Corp (REIT) | Citibank | (119) | (800) | Osaka Gas Co Ltd | HSBC | (218) |
| (9) | NTT UD Investment Corp (REIT) | HSBC | (273) | 1.800 | Osaka Organic Chemical Industry Ltd | JP Morgan | 420 |
| (27) | NTT UD Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (794) | 2.500 | Osaka Soda Co Ltd | JP Morgan | (3.467) |
| 1.400 | Obara Group Inc | Citibank | 280 | 400 | OSAKA Titanium Technologies Co Ltd | Citibank | 1.082 |
| 400 | Obara Group Inc | HSBC | 345 | 700 | OSG Corp | Citibank | (232) |
| 2.700 | Obara Group Inc | JP Morgan | 2.280 | 900 | Otsuka Corp | Citibank | 777 |
| 4.600 | Obayashi Corp | Citibank | (178) | 2.300 | Otsuka Corp | HSBC | 2.558 |
| 8.900 | Obayashi Corp | JP Morgan | (650) | (900) | Otsuka Holdings Co Ltd | Citibank | 1.807 |
| (300) | OBIC Business Consultants Co Ltd | Citibank | (50) | 1.800 | Outsourcing Inc | HSBC | (1.696) |
| 400 | Obic Co Ltd | Citibank | (2.719) | 1.000 | Outsourcing Inc | JP Morgan | (950) |
| 300 | Obic Co Ltd | HSBC | 1.399 | 1.400 | Oyo Corp | Citibank | (318) |
| (500) | Odakyu Electric Railway Co Ltd | JP Morgan | 665 | 100 | Oyo Corp | HSBC | (126) |
| (600) | Ogaki Kyoritsu Bank Ltd | Citibank | 216 | 300 | Oyo Corp | JP Morgan | (382) |
| (200) | Ogaki Kyoritsu Bank Ltd | JP Morgan | 255 | (200) | Pacific Metals Co Ltd | HSBC | 1.001 |
| (4.300) | Oji Holdings Corp | Citibank | 120 | 200 | Pack Corp | Citibank | 161 |
| (23.800) | Oji Holdings Corp | JP Morgan | 5.252 | 200 | PALTAC Corp | HSBC | (238) |
| 800 | Okamura Corp | Citibank | (69) | (700) | Pan Pacific International Holdings Corp | Citibank | (1.167) |
| 6.500 | Okamura Corp | JP Morgan | (63) | (300) | Pan Pacific International Holdings Corp | JP Morgan | (3) |
| (1.200) | Okasan Securities Group Inc | Citibank | 41 | 2.900 | Panasonic Holdings Corp | JP Morgan | 1.047 |
| (1.300) | Okasan Securities Group Inc | HSBC | 43 | (1.500) | Park24 Co Ltd | HSBC | (2.316) |
| (800) | Okasan Securities Group Inc | JP Morgan | 28 | 600 | PC Depot Corp | Citibank | 153 |
| (5.500) | Oki Electric Industry Co Ltd | Citibank | 1.654 | 800 | PC Depot Corp | HSBC | 287 |
| (600) | Oki Electric Industry Co Ltd | HSBC | 53 | 200 | PC Depot Corp | JP Morgan | 71 |
| (2.000) | Oki Electric Industry Co Ltd | JP Morgan | 198 | (300) | Penta-Ocean Construction Co Ltd | HSBC | (52) |
| | | | | (7.100) | Penta-Ocean Construction Co Ltd | JP Morgan | (1.202) |
| | | | | (200) | PeptiDream Inc | Citibank | 221 |
| | | | | (300) | PeptiDream Inc | JP Morgan | 730 |
| | | | | 2.800 | Persol Holdings Co Ltd | Citibank | (2.208) |
| | | | | 1.000 | Persol Holdings Co Ltd | JP Morgan | 1.611 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return

Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|-----------------------------------|-------------|---|--------------------------|------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (200) | Pharma Foods International Co Ltd | HSBC | (45) | 1.400 | Rohto Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | (2.716) |
| (1.300) | Pharma Foods International Co Ltd | JP Morgan | (281) | 500 | Rohto Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | (20) |
| (700) | PHC Holdings Corp | Citibank | 643 | 100 | Rorze Corp | HSBC | 202 |
| (300) | PHC Holdings Corp | JP Morgan | 8 | 300 | Rorze Corp | JP Morgan | 1.905 |
| 1.000 | Pigeon Corp | JP Morgan | (1.691) | (400) | RS Technologies Co Ltd | HSBC | (1.019) |
| (300) | Pilot Corp | Citibank | (637) | (1.400) | RS Technologies Co Ltd | JP Morgan | (3.515) |
| (300) | Pilot Corp | JP Morgan | 60 | 300 | S Foods Inc | Citibank | (81) |
| 100 | Piolar Inc | Citibank | 336 | 700 | S Foods Inc | HSBC | 638 |
| (900) | PKSHA Technology Inc | Citibank | (477) | 1.700 | S Foods Inc | JP Morgan | 1.341 |
| (1.200) | PKSHA Technology Inc | JP Morgan | (3.762) | (700) | Saibu Gas Holdings Co Ltd | Citibank | 262 |
| (200) | Plenus Co Ltd | Citibank | 50 | (700) | Saibu Gas Holdings Co Ltd | HSBC | 623 |
| (900) | Plenus Co Ltd | JP Morgan | (302) | (3.700) | Saibu Gas Holdings Co Ltd | JP Morgan | 3.340 |
| 200 | Plus Alpha Consulting Co Ltd | JP Morgan | 77 | 900 | Saizeriya Co Ltd | HSBC | 601 |
| 7.000 | Pola Orbis Holdings Inc | Citibank | 1.019 | 100 | Saizeriya Co Ltd | JP Morgan | 66 |
| 900 | Pola Orbis Holdings Inc | JP Morgan | 981 | 300 | Sakai Moving Service Co Ltd | HSBC | (554) |
| 600 | PR Times Inc | Citibank | (169) | (1.600) | SAMTY Co Ltd | Citibank | 760 |
| 300 | PR Times Inc | JP Morgan | 286 | (1.600) | SAMTY Co Ltd | HSBC | 526 |
| (500) | Premier Anti-Aging Co Ltd | Citibank | (161) | (3.200) | SAMTY Co Ltd | JP Morgan | 1.052 |
| (100) | Premier Anti-Aging Co Ltd | JP Morgan | (200) | (3.200) | San-A Co Ltd | Citibank | 2.849 |
| 1.000 | Premium Group Co Ltd | Citibank | 589 | (900) | San-A Co Ltd | JP Morgan | 1.250 |
| 200 | Premium Group Co Ltd | HSBC | 682 | 1.700 | San-Ai Obbli Co Ltd | Citibank | (218) |
| 700 | Premium Group Co Ltd | JP Morgan | 2.372 | 1.400 | San-Ai Obbli Co Ltd | JP Morgan | 185 |
| 1.500 | Pressance Corp | Citibank | (45) | (100) | Sangetsu Corp | Citibank | 12 |
| 6.200 | Prestige International Inc | Citibank | (1.472) | (400) | Sangetsu Corp | JP Morgan | 62 |
| 3.300 | Prestige International Inc | HSBC | 1.156 | (1.300) | San-In Godo Bank Ltd | Citibank | 155 |
| 1.100 | Prestige International Inc | JP Morgan | 381 | (1.500) | San-In Godo Bank Ltd | HSBC | 96 |
| 2.100 | Proto Corp | Citibank | 4 | (7.300) | San-In Godo Bank Ltd | JP Morgan | 497 |
| 2.300 | Proto Corp | HSBC | (379) | 2.800 | Sankyo Co Ltd | Citibank | (810) |
| 4.400 | Proto Corp | JP Morgan | (821) | 2.300 | Sankyo Co Ltd | HSBC | (332) |
| 600 | Qol Holdings Co Ltd | Citibank | 69 | 1.400 | Sankyo Tateyama Inc | JP Morgan | (71) |
| 300 | Qol Holdings Co Ltd | HSBC | 464 | 2.100 | Sankyu Inc | Citibank | (540) |
| 1.000 | Qol Holdings Co Ltd | JP Morgan | 1.541 | 2.100 | Sankyu Inc | JP Morgan | (1.141) |
| (800) | Raccoon Holdings Inc | Citibank | 749 | (1.900) | Sanoh Industrial Co Ltd | Citibank | 64 |
| (100) | Raccoon Holdings Inc | HSBC | (24) | (2.700) | Sanoh Industrial Co Ltd | HSBC | 1.020 |
| (2.500) | Raccoon Holdings Inc | JP Morgan | (568) | (4.700) | Sanoh Industrial Co Ltd | JP Morgan | 1.796 |
| (1.100) | Rakus Co Ltd | JP Morgan | (2.610) | 300 | Sanrio Co Ltd | Citibank | 128 |
| 1.400 | Rakuten Group Inc | HSBC | (14) | (1.300) | Sansan Inc | Citibank | 1.621 |
| 200 | Recruit Holdings Co Ltd | Citibank | (371) | (1.700) | Sansan Inc | HSBC | 1.083 |
| 2.400 | Recruit Holdings Co Ltd | JP Morgan | 5.950 | (1.300) | Sansan Inc | JP Morgan | 837 |
| 400 | Relia Inc | Citibank | (43) | 8.200 | Santen Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | (1.241) |
| 800 | Relia Inc | JP Morgan | 36 | 4.300 | Sanwa Holdings Corp | Citibank | (678) |
| (500) | Relo Group Inc | HSBC | (1.107) | 2.100 | Sanwa Holdings Corp | JP Morgan | 1.123 |
| (1.600) | Relo Group Inc | JP Morgan | (3.523) | (100) | Sanyo Denki Co Ltd | HSBC | (73) |
| 300 | Renesas Electronics Corp | Citibank | 38 | 300 | Sanyo Special Steel Co Ltd | HSBC | 213 |
| (1.500) | Rengo Co Ltd | Citibank | 421 | 500 | Sanyo Special Steel Co Ltd | JP Morgan | 90 |
| (2.200) | Rengo Co Ltd | HSBC | 1.291 | (1.000) | Sapporo Holdings Ltd | Citibank | (452) |
| (2.300) | Rengo Co Ltd | JP Morgan | 1.361 | (500) | Sapporo Holdings Ltd | HSBC | (196) |
| (2.000) | RENOVA Inc | Citibank | 701 | (1.700) | Sapporo Holdings Ltd | JP Morgan | (882) |
| (400) | RENOVA Inc | JP Morgan | (1.068) | 2.000 | Sato Holdings Corp | Citibank | 822 |
| (36.100) | Resona Holdings Inc | HSBC | 18.980 | 4.400 | Sato Holdings Corp | JP Morgan | 3.617 |
| (5.400) | Resona Holdings Inc | JP Morgan | 2.857 | 1.000 | Sawai Group Holdings Co Ltd | JP Morgan | (2.083) |
| 2.100 | Resorttrust Inc | Citibank | (30) | 300 | SB Technology Corp | Citibank | (6) |
| 1.400 | Resorttrust Inc | HSBC | (87) | 300 | SB Technology Corp | HSBC | 205 |
| 1.700 | Resorttrust Inc | JP Morgan | 314 | 1.500 | SB Technology Corp | JP Morgan | 2.573 |
| (800) | Restar Holdings Corp | HSBC | (213) | 1.800 | SBI Holdings Inc | Citibank | (658) |
| 700 | Ricoh Co Ltd | JP Morgan | 270 | 3.400 | SBI Holdings Inc | HSBC | (5.905) |
| (400) | Ricoh Leasing Co Ltd | HSBC | (126) | 2.800 | SBI Holdings Inc | JP Morgan | (5.168) |
| (500) | Ricoh Leasing Co Ltd | JP Morgan | (147) | (100) | SBS Holdings Inc | HSBC | (64) |
| (200) | Riken Keiki Co Ltd | HSBC | (723) | (100) | SBS Holdings Inc | JP Morgan | (108) |
| (100) | Rinnai Corp | Citibank | (206) | (100) | SCREEN Holdings Co Ltd | JP Morgan | (1.144) |
| (200) | Rinnai Corp | HSBC | (210) | (1.400) | Scroll Corp | Citibank | (217) |
| (500) | Rinnai Corp | JP Morgan | (899) | (100) | Scroll Corp | HSBC | 2 |
| 17.000 | Riso Kyoiku Co Ltd | Citibank | (845) | (4.700) | Scroll Corp | JP Morgan | 118 |
| 4.100 | Riso Kyoiku Co Ltd | JP Morgan | (472) | 4.000 | SCSK Corp | Citibank | (1.884) |
| 700 | Rohm Co Ltd | Citibank | 2.559 | | | | |
| 100 | Rohm Co Ltd | JP Morgan | 1.170 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-------------|---|--------------------------|-----------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 100 | SCSK Corp | HSBC | 43 | 3.600 | Shin-Etsu Polymer Co Ltd | Citibank | 4 |
| (700) | Secom Co Ltd | HSBC | 2.799 | 100 | Shinko Electric Industries Co Ltd | HSBC | 6 |
| (1.000) | Secom Co Ltd | JP Morgan | 690 | (1.400) | Shinsei Bank Ltd | Citibank | 2.182 |
| 2.800 | Sega Sammy Holdings Inc | Citibank | (1.130) | (200) | Shinsei Bank Ltd | HSBC | 116 |
| 600 | Sega Sammy Holdings Inc | HSBC | 536 | (2.900) | Shinsei Bank Ltd | JP Morgan | 7.997 |
| 2.900 | Sega Sammy Holdings Inc | JP Morgan | 2.836 | 500 | Shionogi & Co Ltd | Citibank | (438) |
| 2.100 | Seibu Holdings Inc | Citibank | (978) | 500 | Shionogi & Co Ltd | JP Morgan | 299 |
| 300 | Seibu Holdings Inc | HSBC | 161 | (800) | Ship Healthcare Holdings Inc | Citibank | 15 |
| 100 | Seibu Holdings Inc | JP Morgan | (49) | (800) | Ship Healthcare Holdings Inc | HSBC | (394) |
| 400 | Seikagaku Corp | HSBC | (96) | (1.200) | Ship Healthcare Holdings Inc | JP Morgan | (1.392) |
| (700) | Seiko Epson Corp | Citibank | 66 | (400) | Shiseido Co Ltd | Citibank | (273) |
| (1.600) | Seiko Epson Corp | HSBC | (2.956) | (300) | Shiseido Co Ltd | JP Morgan | (430) |
| (2.300) | Seiko Epson Corp | JP Morgan | (3.896) | (29.300) | Shizuoka Bank Ltd | JP Morgan | 20.544 |
| 900 | Seino Holdings Co Ltd | Citibank | 77 | 500 | Shizuoka Gas Co Ltd | HSBC | (222) |
| 4.000 | Seino Holdings Co Ltd | HSBC | (1.197) | 1.300 | Shizuoka Gas Co Ltd | JP Morgan | (186) |
| 800 | Seino Holdings Co Ltd | JP Morgan | (68) | (600) | SHO-BOND Holdings Co Ltd | Citibank | (675) |
| 500 | Seiren Co Ltd | HSBC | (293) | (100) | SHO-BOND Holdings Co Ltd | HSBC | (374) |
| 1.400 | Seiren Co Ltd | JP Morgan | 305 | (1.400) | SHO-BOND Holdings Co Ltd | JP Morgan | (5.192) |
| 2.600 | Sekisui Chemical Co Ltd | Citibank | 1.609 | (200) | Shochiku Co Ltd | HSBC | (1.200) |
| 600 | Sekisui Chemical Co Ltd | HSBC | 589 | (800) | Shochiku Co Ltd | JP Morgan | (4.737) |
| 4.300 | Sekisui Chemical Co Ltd | JP Morgan | 4.173 | 3.000 | Shoei Co Ltd | Citibank | (5.112) |
| (15) | Sekisui House Inc (REIT) | Citibank | (120) | 1.200 | Shoei Co Ltd | JP Morgan | 1.164 |
| (15) | Sekisui House Inc (REIT) | HSBC | (377) | (1.000) | Shoei Foods Corp | Citibank | 466 |
| (57) | Sekisui House Inc (REIT) | JP Morgan | (1.404) | (200) | Shoei Foods Corp | JP Morgan | (255) |
| 7.100 | Sekisui House Ltd | Citibank | 1.958 | (3.800) | Showa Denko KK | Citibank | (2.135) |
| 6.200 | Sekisui House Ltd | HSBC | 4.225 | (1.200) | Showa Denko KK | HSBC | (531) |
| 6.900 | Sekisui House Ltd | JP Morgan | 4.163 | (400) | Showa Denko KK | JP Morgan | (171) |
| 2.400 | Sekisui Jushi Corp | Citibank | (479) | 2.400 | SIGMAXYZ Holdings Inc | Citibank | 285 |
| 2.800 | Sekisui Jushi Corp | HSBC | (797) | 200 | SIGMAXYZ Holdings Inc | HSBC | 53 |
| 2.700 | Sekisui Jushi Corp | JP Morgan | (1.206) | 1.500 | SIGMAXYZ Holdings Inc | JP Morgan | 1.107 |
| 1.200 | Sekisui Kasei Co Ltd | HSBC | (69) | 200 | Siix Corp | HSBC | 99 |
| 2.900 | Sekisui Kasei Co Ltd | JP Morgan | (174) | 3.000 | Siix Corp | JP Morgan | 1.832 |
| (21.100) | Senshu Ikeda Holdings Inc | Citibank | 629 | (700) | Simplex Holdings Inc | Citibank | 849 |
| (26.600) | Senshu Ikeda Holdings Inc | HSBC | 496 | (300) | Simplex Holdings Inc | HSBC | (214) |
| (45.300) | Senshu Ikeda Holdings Inc | JP Morgan | 846 | (100) | Simplex Holdings Inc | JP Morgan | (133) |
| (1.000) | Septeni Holdings Co Ltd | HSBC | 755 | 5.600 | Sintokogio Ltd | Citibank | (818) |
| 100 | Seria Co Ltd | JP Morgan | (196) | 7.500 | Sintokogio Ltd | HSBC | 355 |
| (4.000) | Seven Bank Ltd | HSBC | 22 | 6.600 | Sintokogio Ltd | JP Morgan | 285 |
| (13.900) | Seven Bank Ltd | JP Morgan | 98 | (12.300) | SKY Perfect JSAT Holdings Inc | Citibank | (622) |
| 3.500 | SG Holdings Co Ltd | Citibank | 90 | (9.400) | SKY Perfect JSAT Holdings Inc | HSBC | (1.030) |
| 400 | SG Holdings Co Ltd | HSBC | 32 | (800) | SKY Perfect JSAT Holdings Inc | JP Morgan | (85) |
| 900 | SG Holdings Co Ltd | JP Morgan | 59 | (8.500) | Skylark Holdings Co Ltd | JP Morgan | 1.343 |
| (600) | Sharp Corp | Citibank | 189 | 700 | Smaregi Inc | Citibank | (621) |
| (3.500) | Sharp Corp | HSBC | 343 | 400 | Smaregi Inc | HSBC | (66) |
| (4.400) | Sharp Corp | JP Morgan | 460 | 100 | Smaregi Inc | JP Morgan | (17) |
| 700 | Shibaura Electronics Co Ltd | Citibank | 1.825 | 1.000 | SMS Co Ltd | Citibank | (630) |
| 300 | Shibuya Corp | Citibank | (82) | 500 | SMS Co Ltd | HSBC | (139) |
| 300 | Shibuya Corp | HSBC | (64) | 1.200 | SMS Co Ltd | JP Morgan | 6 |
| (1.100) | Shiga Bank Ltd | Citibank | (3.002) | 300 | Snow Peak Inc | HSBC | 1.664 |
| (500) | Shiga Bank Ltd | HSBC | (1.220) | 6.600 | Sodick Co Ltd | Citibank | 1.724 |
| (100) | Shiga Bank Ltd | JP Morgan | (332) | 5.500 | Sodick Co Ltd | JP Morgan | 2.362 |
| 200 | Shikoku Chemicals Corp | Citibank | 15 | (3.300) | SoftBank Corp | HSBC | 201 |
| 800 | Shimadzu Corp | JP Morgan | 2.732 | (2.000) | SoftBank Corp | JP Morgan | 140 |
| 100 | Shimamura Co Ltd | Citibank | (641) | 500 | SoftBank Group Corp | JP Morgan | 1.429 |
| 100 | Shimamura Co Ltd | HSBC | (416) | 300 | Sohgo Security Services Co Ltd | Citibank | (33) |
| 400 | Shimamura Co Ltd | JP Morgan | (1.691) | 700 | Sohgo Security Services Co Ltd | HSBC | (53) |
| (100) | Shimano Inc | Citibank | (21) | | | | |
| 4.100 | Shin Nippon Air Technologies Co Ltd | HSBC | 2.729 | | | | |
| 2.100 | Shin Nippon Air Technologies Co Ltd | JP Morgan | 772 | | | | |
| (900) | Shin Nippon Biomedical Laboratories Ltd | Citibank | (528) | | | | |
| (300) | Shin Nippon Biomedical Laboratories Ltd | HSBC | (760) | | | | |
| (400) | Shin Nippon Biomedical Laboratories Ltd | JP Morgan | (969) | | | | |
| 400 | Shin-Etsu Chemical Co Ltd | JP Morgan | 1.698 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return

Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------------|-------------|---|--------------------------|---------------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 2.300 | Sohgo Security Services Co Ltd | JP Morgan | (610) | (300) | Sumitomo Osaka Cement Co Ltd | JP Morgan | 677 |
| 1.300 | Sojitz Corp | Citibank | 72 | (1.500) | Sumitomo Pharma Co Ltd | Citibank | 33 |
| 400 | Sojitz Corp | HSBC | 106 | (400) | Sumitomo Pharma Co Ltd | HSBC | 361 |
| 300 | Solasto Corp | Citibank | (129) | (100) | Sumitomo Realty & Development Co Ltd | Citibank | (112) |
| 1.000 | Solasto Corp | HSBC | (931) | (700) | Sumitomo Realty & Development Co Ltd | JP Morgan | (774) |
| (1.500) | Sompo Holdings Inc | JP Morgan | (6.988) | (2.600) | Sumitomo Rubber Industries Ltd | Citibank | 51 |
| 200 | Sony Corp | Citibank | 857 | (5.600) | Sumitomo Rubber Industries Ltd | HSBC | (411) |
| 300 | Sony Corp | HSBC | 3.308 | (8.100) | Sumitomo Rubber Industries Ltd | JP Morgan | (2.953) |
| 900 | Sony Corp | JP Morgan | 9.864 | 700 | Sumitomo Seika Chemicals Co Ltd | Citibank | (370) |
| (800) | Sotetsu Holdings Inc | Citibank | 375 | 700 | Sumitomo Seika Chemicals Co Ltd | HSBC | (524) |
| (3.100) | Sotetsu Holdings Inc | HSBC | (99) | 500 | Sumitomo Seika Chemicals Co Ltd | JP Morgan | (384) |
| (2.600) | Sotetsu Holdings Inc | JP Morgan | (47) | 2.400 | Sumitomo Warehouse Co Ltd | Citibank | (225) |
| (8.600) | Sourcenext Corp | JP Morgan | (4.821) | 4.100 | Sumitomo Warehouse Co Ltd | JP Morgan | 4.002 |
| 2.100 | S-Pool Inc | Citibank | (609) | 1.400 | Sun* Inc | Citibank | (286) |
| 3.200 | S-Pool Inc | JP Morgan | (353) | 200 | Sun* Inc | HSBC | (635) |
| 800 | Square Enix Holdings Co Ltd | Citibank | 485 | 500 | Sun* Inc | JP Morgan | (1.720) |
| (1.200) | Stanley Electric Co Ltd | Citibank | (528) | 100 | Sundrug Co Ltd | HSBC | (74) |
| (3.200) | Stanley Electric Co Ltd | HSBC | (2.645) | 1.100 | Sundrug Co Ltd | JP Morgan | (830) |
| (14) | Starts Proceed Investment Corp (REIT) | Citibank | (310) | (400) | Suntory Beverage & Food Ltd | HSBC | 796 |
| (21) | Starts Proceed Investment Corp (REIT) | HSBC | (1.318) | (1.200) | Suntory Beverage & Food Ltd | JP Morgan | 656 |
| (21) | Starts Proceed Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (1.287) | (29.700) | Suruga Bank Ltd | JP Morgan | 13.094 |
| 400 | Starzen Co Ltd | HSBC | 79 | (100) | Suzuken Co Ltd | HSBC | 305 |
| 1.600 | Starzen Co Ltd | JP Morgan | 296 | (300) | Suzuken Co Ltd | JP Morgan | 921 |
| 500 | Stella Chemifa Corp | Citibank | 659 | 1.000 | Suzuki Motor Corp | HSBC | (584) |
| 200 | Stella Chemifa Corp | HSBC | 215 | 1.200 | Suzuki Motor Corp | JP Morgan | (730) |
| 200 | Stella Chemifa Corp | JP Morgan | 166 | (1.800) | SymBio Pharmaceuticals Ltd | Citibank | 937 |
| 1.100 | Strike Co Ltd | Citibank | (1.694) | (1.000) | SymBio Pharmaceuticals Ltd | JP Morgan | (687) |
| 200 | Strike Co Ltd | HSBC | (30) | 500 | Systemex Corp | HSBC | 2.109 |
| 800 | Strike Co Ltd | JP Morgan | (139) | 2.900 | Systema Corp | Citibank | (935) |
| (1.600) | Subaru Corp | Citibank | (1.326) | 700 | Systema Corp | HSBC | (192) |
| (2.700) | Subaru Corp | JP Morgan | (4.316) | (1.500) | T Hasegawa Co Ltd | JP Morgan | 918 |
| 100 | Sugi Holdings Co Ltd | Citibank | 37 | (300) | Tadano Ltd | HSBC | (135) |
| 500 | Sugi Holdings Co Ltd | HSBC | 894 | (4.800) | Tadano Ltd | JP Morgan | (2.138) |
| 1.200 | Sugi Holdings Co Ltd | JP Morgan | 2.109 | 3.100 | Taiheiyo Cement Corp | Citibank | 101 |
| (600) | SUMCO Corp | Citibank | (372) | 300 | Taiheiyo Cement Corp | HSBC | (329) |
| (3.300) | SUMCO Corp | JP Morgan | (2.590) | 1.600 | Taiheiyo Cement Corp | JP Morgan | (1.773) |
| 300 | Sumitomo Bakelite Co Ltd | Citibank | 88 | 200 | Taikisha Ltd | Citibank | (62) |
| 5.800 | Sumitomo Chemical Co Ltd | HSBC | (1.636) | 200 | Taikisha Ltd | HSBC | (190) |
| 20.900 | Sumitomo Chemical Co Ltd | JP Morgan | (5.968) | 300 | Taikisha Ltd | JP Morgan | (291) |
| 1.900 | Sumitomo Corp | Citibank | (31) | (5.900) | Taiko Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 2.865 |
| 100 | Sumitomo Corp | HSBC | (135) | (6.600) | Taiko Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | (1.476) |
| 5.500 | Sumitomo Corp | JP Morgan | (7.484) | (1.100) | Taisei Corp | JP Morgan | (2.925) |
| (4.100) | Sumitomo Electric Industries Ltd | JP Morgan | (300) | (500) | Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd | JP Morgan | (12) |
| 2.100 | Sumitomo Forestry Co Ltd | HSBC | 1.201 | 600 | Taiyo Holdings Co Ltd | Citibank | 273 |
| 900 | Sumitomo Forestry Co Ltd | JP Morgan | 466 | 600 | Taiyo Holdings Co Ltd | HSBC | 686 |
| (1.600) | Sumitomo Heavy Industries Ltd | JP Morgan | (795) | 300 | Taiyo Holdings Co Ltd | JP Morgan | 337 |
| (400) | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | Citibank | 28 | (800) | Taiyo Yuden Co Ltd | HSBC | (969) |
| (900) | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | HSBC | 39 | (200) | Taiyo Yuden Co Ltd | JP Morgan | (298) |
| (1.200) | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | JP Morgan | 92 | (5.000) | Takara Bio Inc | HSBC | 3.927 |
| 800 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | HSBC | 246 | (700) | Takara Bio Inc | JP Morgan | 1.260 |
| 3.800 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | JP Morgan | 1.077 | 1.000 | Takara Holdings Inc | Citibank | 110 |
| 200 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | HSBC | (292) | | | | |
| 1.200 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | JP Morgan | (1.257) | | | | |
| (300) | Sumitomo Osaka Cement Co Ltd | Citibank | 238 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|-------------------------------------|-------------|---|--------------------------|---|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 7.500 | Takara Standard Co Ltd | Citibank | (744) | (5.000) | TOKAI Holdings Corp | Citibank | (133) |
| 8.800 | Takara Standard Co Ltd | JP Morgan | (3.562) | (3.700) | TOKAI Holdings Corp | HSBC | (479) |
| 1.900 | Takasago Thermal Engineering Co Ltd | Citibank | (599) | (1.800) | TOKAI Holdings Corp | JP Morgan | (224) |
| 500 | Takasago Thermal Engineering Co Ltd | JP Morgan | (80) | (39.600) | Tokai Tokyo Financial Holdings Inc | Citibank | (198) |
| (400) | Takashimaya Co Ltd | Citibank | (42) | (8.700) | Tokai Tokyo Financial Holdings Inc | HSBC | (112) |
| (5.800) | Takashimaya Co Ltd | JP Morgan | (2.682) | (3.500) | Tokai Tokyo Financial Holdings Inc | JP Morgan | (203) |
| (2.800) | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 3.145 | 100 | Token Corp | Citibank | (35) |
| (900) | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 420 | 900 | Tokio Marine Holdings Inc | Citibank | 656 |
| 900 | Takeuchi Manufacturing Co Ltd | Citibank | (98) | 1.100 | Tokio Marine Holdings Inc | JP Morgan | 4.657 |
| (300) | Taki Chemical Co Ltd | JP Morgan | 903 | (700) | Tokuyama Corp | HSBC | 270 |
| (1.200) | Takuma Co Ltd | Citibank | 112 | (400) | Tokuyama Corp | JP Morgan | 150 |
| (900) | Takuma Co Ltd | HSBC | 519 | 1.900 | Tokyo Century Corp | Citibank | 563 |
| (500) | Takuma Co Ltd | JP Morgan | 276 | 600 | Tokyo Century Corp | HSBC | 1.119 |
| (600) | Tama Home Co Ltd | Citibank | 1.234 | 1.100 | Tokyo Century Corp | JP Morgan | 2.024 |
| 200 | Tamron Co Ltd | Citibank | 36 | (17.000) | Tokyo Electric Power Co Holdings Inc | JP Morgan | 4.937 |
| 100 | Tamron Co Ltd | JP Morgan | 68 | 100 | Tokyo Electron Ltd | Citibank | (233) |
| (3.100) | Tamura Corp | Citibank | 253 | 300 | Tokyo Electron Ltd | HSBC | 12.802 |
| (1.100) | Tamura Corp | HSBC | (130) | 600 | Tokyo Gas Co Ltd | Citibank | (492) |
| (3.000) | Tamura Corp | JP Morgan | (346) | (1.300) | Tokyo Kiraboshi Financial Group Inc | Citibank | 433 |
| 4.700 | TBS Holdings Inc | Citibank | (685) | (900) | Tokyo Kiraboshi Financial Group Inc | HSBC | (1.182) |
| 600 | TBS Holdings Inc | HSBC | (273) | (600) | Tokyo Kiraboshi Financial Group Inc | JP Morgan | (640) |
| 1.500 | TBS Holdings Inc | JP Morgan | (351) | (400) | Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd | JP Morgan | (1.700) |
| (200) | TDK Corp | JP Morgan | (739) | 200 | Tokyo Seimitsu Co Ltd | JP Morgan | 373 |
| 600 | TechnoPro Holdings Inc | Citibank | (471) | 1.200 | Tokyo Steel Manufacturing Co Ltd | Citibank | 699 |
| 400 | TechnoPro Holdings Inc | HSBC | 152 | 1.600 | Tokyo Steel Manufacturing Co Ltd | JP Morgan | 1.650 |
| 300 | TechnoPro Holdings Inc | JP Morgan | 96 | 2.200 | Tokyo Tatemono Co Ltd | Citibank | (1.532) |
| (3.900) | Teijin Ltd | Citibank | 458 | 1.300 | Tokyo Tatemono Co Ltd | HSBC | (539) |
| (3.600) | Teijin Ltd | HSBC | 178 | 300 | Tokyo Tatemono Co Ltd | JP Morgan | (166) |
| 900 | Teikoku Sen-I Co Ltd | Citibank | 679 | (4.400) | Tokyu Corp | JP Morgan | 3.893 |
| 1.200 | Teikoku Sen-I Co Ltd | HSBC | 1.046 | (5.800) | Tokyu Fudosan Holdings Corp ^{††} | HSBC | — |
| 1.300 | Teikoku Sen-I Co Ltd | JP Morgan | 1.202 | (10.900) | Tokyu Fudosan Holdings Corp | JP Morgan | 45 |
| (1.800) | Tenma Corp | Citibank | (1.473) | (9.300) | TOMONY Holdings Inc | Citibank | 946 |
| (1.800) | Tenma Corp | HSBC | (943) | (11.500) | TOMONY Holdings Inc | HSBC | 2.017 |
| (8.200) | Tenma Corp | JP Morgan | (4.180) | (28.700) | TOMONY Holdings Inc | JP Morgan | 5.093 |
| 700 | Terumo Corp | JP Morgan | 2.481 | 1.200 | Tonami Holdings Co Ltd | Citibank | 103 |
| (400) | THK Co Ltd | JP Morgan | (172) | 600 | Tonami Holdings Co Ltd | HSBC | (151) |
| (500) | TIS Inc | Citibank | 1.090 | 500 | Tonami Holdings Co Ltd | JP Morgan | (137) |
| (600) | TIS Inc | HSBC | 229 | 1.200 | Topcon Corp | JP Morgan | 2.148 |
| (1.400) | TIS Inc | JP Morgan | 1.471 | (1.200) | Toppa Inc | HSBC | (2.619) |
| (600) | TKC Corp | Citibank | 367 | (1.600) | Toppa Inc | JP Morgan | (3.471) |
| (600) | TKC Corp | HSBC | 296 | 700 | Topre Corp | Citibank | 22 |
| (500) | TKC Corp | JP Morgan | 257 | 200 | Topre Corp | HSBC | (101) |
| (600) | TKP Corp | JP Morgan | (244) | 500 | Topre Corp | JP Morgan | (257) |
| (1.000) | Toa Corp | Citibank | 1.318 | 1.700 | Toray Industries Inc | Citibank | 177 |
| (1.600) | Toa Corp | JP Morgan | 5.422 | 400 | Toridoll Holdings Corp | HSBC | (73) |
| (400) | Toagosei Co Ltd | HSBC | 3 | (1.200) | Torii Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | 497 |
| (200) | Toagosei Co Ltd | JP Morgan | 3 | (100) | Toshiba Corp | Citibank | (99) |
| (900) | Tobu Railway Co Ltd | JP Morgan | 409 | (1.100) | Toshiba Corp | JP Morgan | (3.226) |
| (16.700) | Toda Corp | JP Morgan | 6.709 | (200) | Toshiba TEC Corp | HSBC | 398 |
| (100) | Toei Co Ltd | Citibank | (321) | (1.100) | Toshiba TEC Corp | JP Morgan | 2.221 |
| (500) | Toei Co Ltd | JP Morgan | (6.116) | 600 | Tosho Co Ltd | Citibank | (104) |
| (1.000) | Toho Co Ltd | HSBC | (2.176) | 1.200 | Tosho Co Ltd | HSBC | (292) |
| 200 | Toho Gas Co Ltd | Citibank | (239) | 500 | Tosho Co Ltd | JP Morgan | 153 |
| 900 | Toho Gas Co Ltd | HSBC | (1.177) | (600) | Tosoh Corp | HSBC | 67 |
| 800 | Toho Gas Co Ltd | JP Morgan | (1.157) | (2.900) | Tosoh Corp | JP Morgan | 1.535 |
| 1.300 | Toho Holdings Co Ltd | Citibank | (696) | 300 | TOTO Ltd | HSBC | 274 |
| 1.000 | Toho Holdings Co Ltd | HSBC | (1.238) | (1.700) | Towa Corp | Citibank | 347 |
| 1.200 | Toho Holdings Co Ltd | JP Morgan | (979) | (400) | Towa Corp | HSBC | 294 |
| 1.100 | Toho Titanium Co Ltd | JP Morgan | 6.503 | | | | |
| (2.600) | Tokai Carbon Co Ltd | Citibank | (1.292) | | | | |
| (7.300) | Tokai Carbon Co Ltd | JP Morgan | (3.518) | | | | |
| 5.000 | Tokai Corp | Citibank | (731) | | | | |
| 400 | Tokai Corp | HSBC | (77) | | | | |
| 3.600 | Tokai Corp | JP Morgan | (727) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return

Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|-------------------------------------|-------------|---|--------------------------|-------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (500) | Towa Corp | JP Morgan | 163 | (400) | Universal Entertainment Corp | HSBC | 977 |
| (400) | Towa Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 47 | (1.300) | Universal Entertainment Corp | JP Morgan | 3.194 |
| (100) | Towa Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 43 | 2.100 | Usen-Next Holdings Co Ltd | Citibank | (10) |
| (2.100) | Toyo Construction Co Ltd | HSBC | 719 | 800 | Usen-Next Holdings Co Ltd | HSBC | (20) |
| (5.000) | Toyo Construction Co Ltd | JP Morgan | 1.740 | 200 | User Local inc | Citibank | 29 |
| 400 | Toyo Gosei Co Ltd | HSBC | 1.501 | 1.400 | User Local inc | JP Morgan | 1.658 |
| 1.900 | Toyo Ink SC Holdings Co Ltd | Citibank | (651) | 3.100 | Ushio Inc | Citibank | 1.618 |
| 1.000 | Toyo Ink SC Holdings Co Ltd | JP Morgan | (326) | 300 | Ushio Inc | HSBC | 256 |
| (200) | Toyo Seikan Group Holdings Ltd | HSBC | (24) | (300) | USS Co Ltd | Citibank | 473 |
| (400) | Toyo Suisan Kaisha Ltd | Citibank | (291) | (1.600) | USS Co Ltd | HSBC | (2.597) |
| (900) | Toyo Suisan Kaisha Ltd | JP Morgan | (646) | (3.400) | USS Co Ltd | JP Morgan | (5.473) |
| 1.500 | Toyo Tire Corp | Citibank | (434) | 1.000 | Uzabase Inc | Citibank | 12 |
| 500 | Toyobo Co Ltd | Citibank | (212) | 600 | Uzabase Inc | JP Morgan | 261 |
| 1.600 | Toyobo Co Ltd | JP Morgan | (784) | 1.200 | ValueCommerce Co Ltd | Citibank | (1.704) |
| 2.200 | Toyoda Gosei Co Ltd | Citibank | 294 | 1.100 | ValueCommerce Co Ltd | JP Morgan | 932 |
| 1.900 | Toyoda Gosei Co Ltd | JP Morgan | 2.462 | (2.000) | V-Cube Inc | Citibank | 2.674 |
| 600 | Toyota Boshoku Corp | JP Morgan | 182 | (100) | V-Cube Inc | HSBC | 95 |
| (4.500) | Toyota Motor Corp | Citibank | (1.420) | (1.400) | V-Cube Inc | JP Morgan | 1.341 |
| (5.300) | Toyota Motor Corp | HSBC | 3.807 | 600 | Vector Inc | HSBC | (195) |
| (2.800) | Toyota Motor Corp | JP Morgan | 2.050 | 3.100 | Vector Inc | JP Morgan | (459) |
| 800 | Toyota Tsusho Corp | Citibank | 2.019 | 100 | Visional Inc | JP Morgan | (233) |
| 400 | Toyota Tsusho Corp | HSBC | 1.334 | 900 | VT Holdings Co Ltd | Citibank | (32) |
| 400 | Toyota Tsusho Corp | JP Morgan | 1.106 | 1.700 | VT Holdings Co Ltd | HSBC | 20 |
| 800 | TPR Co Ltd | Citibank | 193 | 7.900 | VT Holdings Co Ltd | JP Morgan | 63 |
| 200 | TPR Co Ltd | HSBC | 76 | 1.700 | Wacoal Holdings Corp | JP Morgan | 2.455 |
| 500 | Trancom Co Ltd | Citibank | (2.091) | 3.300 | Wakita & Co Ltd | Citibank | 187 |
| 300 | Trancom Co Ltd | JP Morgan | (1.030) | 3.300 | Wakita & Co Ltd | JP Morgan | 887 |
| 200 | Transcosmos Inc | Citibank | 253 | 1.900 | WDB Holdings Co Ltd | Citibank | (1.376) |
| 1.500 | Transcosmos Inc | JP Morgan | 4.052 | 400 | WDB Holdings Co Ltd | HSBC | (1.042) |
| (400) | TRE Holdings Corp | Citibank | (9) | 1.800 | Welcia Holdings Co Ltd | Citibank | (937) |
| (300) | TRE Holdings Corp | HSBC | (355) | 600 | Welcia Holdings Co Ltd | HSBC | 359 |
| 1.300 | Trend Micro Inc | Citibank | 366 | 400 | Welcia Holdings Co Ltd | JP Morgan | 233 |
| 1.700 | Trusco Nakayama Corp | Citibank | (987) | 100 | West Holdings Corp | Citibank | 259 |
| 500 | Trusco Nakayama Corp | HSBC | 200 | 100 | West Holdings Corp | JP Morgan | (269) |
| 3.300 | Trusco Nakayama Corp | JP Morgan | (1.683) | (700) | West Japan Railway Co | JP Morgan | 281 |
| 800 | TS Tech Co Ltd | Citibank | 145 | (2.000) | W-Scope Corp | JP Morgan | (3.993) |
| 300 | TS Tech Co Ltd | HSBC | (111) | 9.600 | Xebio Holdings Co Ltd | JP Morgan | (2.956) |
| 3.900 | TS Tech Co Ltd | JP Morgan | (1.475) | (400) | Yakult Honsha Co Ltd | Citibank | (159) |
| 5.400 | TSI Holdings Co Ltd | HSBC | 763 | (300) | Yakult Honsha Co Ltd | HSBC | (680) |
| 3.600 | TSI Holdings Co Ltd | JP Morgan | 502 | (300) | Yakult Honsha Co Ltd | JP Morgan | (990) |
| 500 | Tsubakimoto Chain Co | JP Morgan | 779 | 5.300 | Yamada Holdings Co Ltd | Citibank | (517) |
| (3.800) | Tsugami Corp | Citibank | 423 | 200 | Yamada Holdings Co Ltd | HSBC | (17) |
| (1.200) | Tsugami Corp | HSBC | (163) | (500) | Yamaguchi Financial Group Inc | Citibank | (47) |
| (1.400) | Tsugami Corp | JP Morgan | 106 | (2.500) | Yamaguchi Financial Group Inc | HSBC | 101 |
| 300 | Tsukishima Kikai Co Ltd | Citibank | 73 | (20.200) | Yamaguchi Financial Group Inc | JP Morgan | 905 |
| 4.900 | Tsukishima Kikai Co Ltd | JP Morgan | (3.424) | (200) | Yamaha Corp | HSBC | (141) |
| 400 | Tsumura & Co | JP Morgan | (747) | (700) | Yamaha Corp | JP Morgan | (675) |
| 700 | Tsuruha Holdings Inc | Citibank | 390 | (400) | Yamaha Motor Co Ltd | Citibank | (171) |
| 600 | Tsuruha Holdings Inc | JP Morgan | 3.219 | (800) | Yamaha Motor Co Ltd | HSBC | 271 |
| 3.900 | TV Asahi Holdings Corp | Citibank | (1.046) | (3.100) | Yamaha Motor Co Ltd | JP Morgan | 3.715 |
| 900 | TV Asahi Holdings Corp | HSBC | (161) | 2.400 | Yamaichi Electronics Co Ltd | Citibank | 426 |
| 200 | UACJ Corp ^{II} | JP Morgan | — | 400 | Yamaichi Electronics Co Ltd | HSBC | 669 |
| (100) | UBE Corp | Citibank | 36 | 500 | Yamaichi Electronics Co Ltd | JP Morgan | 535 |
| (2.000) | UBE Corp | JP Morgan | 978 | 900 | YA-MAN Ltd | Citibank | 312 |
| 200 | Uchida Yoko Co Ltd | Citibank | 299 | (3.700) | Yamato Holdings Co Ltd | Citibank | 3.273 |
| 100 | Uchida Yoko Co Ltd | JP Morgan | 275 | (2.100) | Yamato Holdings Co Ltd | HSBC | 3.038 |
| 900 | Unicharm Corp | Citibank | (475) | (1.600) | Yamato Holdings Co Ltd | JP Morgan | 2.339 |
| 2.300 | United Arrows Ltd | Citibank | 1.320 | 600 | Yamato Kogyo Co Ltd | Citibank | 367 |
| 800 | United Arrows Ltd | JP Morgan | 1.051 | 500 | Yamato Kogyo Co Ltd | JP Morgan | 535 |
| (26) | United Urban Investment Corp (REIT) | Citibank | 899 | 1.200 | Yamazaki Baking Co Ltd | Citibank | (919) |
| (3) | United Urban Investment Corp (REIT) | HSBC | (49) | 2.500 | Yamazaki Baking Co Ltd | JP Morgan | (2.663) |
| (69) | United Urban Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (1.075) | 2.700 | Yamazaki Baking Co Ltd | Citibank | 394 |
| | | | | 6.700 | Yamazen Corp | HSBC | 831 |
| | | | | 4.800 | Yamazen Corp | JP Morgan | (478) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------|--|-------------|---|-----------------------------|---|-------------|---|
| Philippinen Fortsetzung | | | | Singapur Fortsetzung | | | |
| 2.100 | Converge Information and Communications Technology Solutions Inc | HSBC | (42) | (51.300) | Frasers Logistics & Commercial Trust (REIT) | HSBC | 1.754 |
| 12.570 | International Container Terminal Services Inc | Citibank | 1.552 | 156.600 | Frasers Logistics & Commercial Trust (REIT) | JP Morgan | (7.658) |
| 8.340 | International Container Terminal Services Inc | HSBC | (449) | (288.400) | Frasers Logistics & Commercial Trust (REIT) | JP Morgan | 1.450 |
| 5.030 | International Container Terminal Services Inc | JP Morgan | (225) | (15.500) | Frencken Group Ltd | Citibank | (591) |
| (11.487) | JG Summit Holdings Inc | JP Morgan | (134) | (114.900) | Genting Singapore Ltd | Citibank | 703 |
| 3.000 | Metro Pacific Investments Corp | Citibank | (9) | (326.700) | Genting Singapore Ltd | HSBC | 8 |
| 11.000 | Metro Pacific Investments Corp | HSBC | (26) | (148.200) | Genting Singapore Ltd | JP Morgan | (271) |
| 95.000 | Metro Pacific Investments Corp | JP Morgan | (221) | 168.000 | Golden Agri-Resources Ltd | Citibank | 683 |
| (33.160) | Metropolitan Bank & Trust Co | JP Morgan | (1.399) | 193.900 | Golden Agri-Resources Ltd | JP Morgan | (2.146) |
| 100 | PLDT Inc | Citibank | (124) | (3.900) | Haw Par Corp Ltd | Citibank | (1.317) |
| 475 | PLDT Inc | HSBC | 470 | (3.700) | Haw Par Corp Ltd | JP Morgan | (1.191) |
| 385 | PLDT Inc | JP Morgan | 411 | (23.600) | Hongkong Land Holdings Ltd | JP Morgan | 1.888 |
| (6.445) | SM Investments Corp | JP Morgan | (1.817) | 447.900 | Hutchison Port Holdings Trust (Unit) | Citibank | 6.719 |
| (129.100) | SM Prime Holdings Inc | JP Morgan | (6.093) | 85.000 | Hutchison Port Holdings Trust (Unit) | HSBC | 425 |
| (1.010) | Universal Robina Corp | HSBC | 116 | 615.800 | Hutchison Port Holdings Trust (Unit) | JP Morgan | 3.079 |
| (10.610) | Universal Robina Corp | JP Morgan | 1.167 | (8.500) | iFAST Corp Ltd | Citibank | (619) |
| | | | (594) | (7.700) | iFAST Corp Ltd | HSBC | (1.078) |
| | | | | (4.700) | iFAST Corp Ltd | JP Morgan | (669) |
| | | | | (218.500) | Japfa Ltd | Citibank | (6.560) |
| | | | | 16.500 | Jiutian Chemical Group Ltd | Citibank | (45) |
| (43.700) | AEM Holdings Ltd | Citibank | (5.703) | 86.200 | Jiutian Chemical Group Ltd | JP Morgan | (62) |
| (500) | AEM Holdings Ltd | HSBC | 51 | 377.000 | Keppel (REIT) | Citibank | 3.389 |
| 180.300 | AIMS APAC (REIT) | Citibank | 1.682 | 362.900 | Keppel (REIT) | JP Morgan | (5.602) |
| (51.600) | Aztech Global Ltd | Citibank | (254) | (39.000) | Keppel Corp Ltd | HSBC | (8.547) |
| 1.400 | Best World International Ltd | JP Morgan | 39 | (176.400) | Keppel DC (REIT) | Citibank | (14.665) |
| (22.100) | CapitalLand China Trust (REIT) | Citibank | (682) | (14.600) | Keppel DC (REIT) | JP Morgan | (976) |
| (50.100) | CapitalLand China Trust (REIT) | HSBC | (1.716) | (81.500) | Manulife US (REIT) | Citibank | (408) |
| (99.300) | CapitalLand China Trust (REIT) | JP Morgan | (3.468) | (73.200) | Manulife US (REIT) | JP Morgan | — |
| 77.200 | CapitalLand Integrated Commercial Trust (REIT) | HSBC | (2.400) | 280.500 | Mapletree Commercial Trust (REIT) | JP Morgan | (10.344) |
| 266.400 | CapitalLand Integrated Commercial Trust (REIT) | JP Morgan | (6.143) | 70.700 | Mapletree Industrial Trust (REIT) | HSBC | 904 |
| (15.200) | Capitaland Investment Ltd | HSBC | (985) | 79.100 | Mapletree Industrial Trust (REIT) | JP Morgan | 1.129 |
| (88.800) | CDL Hospitality Trusts (Unit) | Citibank | 481 | (9.700) | Mapletree Industrial Trust (REIT) | JP Morgan | (544) |
| (3.300) | CDL Hospitality Trusts (Unit) | HSBC | 144 | 20.100 | Mapletree Logistics Trust (REIT) | HSBC | (217) |
| (11.900) | CDL Hospitality Trusts (Unit) | JP Morgan | 512 | 147.600 | Mapletree Logistics Trust (REIT) | JP Morgan | (1.443) |
| (6.200) | City Developments Ltd | JP Morgan | (1.348) | (1.655) | Maxeon Solar Technologies Ltd | Citibank | (1.473) |
| (72.400) | ComfortDelGro Corp Ltd | HSBC | 419 | (484) | Maxeon Solar Technologies Ltd | HSBC | (983) |
| (55.900) | ComfortDelGro Corp Ltd | JP Morgan | 274 | (5.121) | Maxeon Solar Technologies Ltd | JP Morgan | (10.396) |
| 200 | DBS Group Holdings Ltd | JP Morgan | (40) | (38.900) | Nanofilm Technologies International Ltd | Citibank | (1.278) |
| (1.900) | Eagle Hospitality Trust (Unit) | Citibank | 260 | (16.800) | Nanofilm Technologies International Ltd | HSBC | 385 |
| (15.200) | Eagle Hospitality Trust (Unit) | JP Morgan | 2.082 | (24.200) | Nanofilm Technologies International Ltd | JP Morgan | (1.035) |
| (59.500) | ESR-LOGOS (REIT) | Citibank | (516) | (12.900) | NetLink NBN Trust (Unit) | Citibank | 216 |
| (394.889) | ESR-LOGOS (REIT) | HSBC | (11.605) | 279.500 | NetLink NBN Trust (Unit) | JP Morgan | (1.886) |
| (124.867) | ESR-LOGOS (REIT) | JP Morgan | (3.280) | (9.600) | NetLink NBN Trust (Unit) | JP Morgan | (34) |
| (20.340) | Ezion Holdings Ltd | Citibank | — | (35.400) | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | JP Morgan | (3.564) |
| (5.400) | Ezion Holdings Ltd | HSBC | — | (500) | Parkway Life (REIT) | JP Morgan | (97) |
| (6.480) | Ezion Holdings Ltd | JP Morgan | — | 506.000 | Sasseur (REIT) | Citibank | (3.063) |
| 100.900 | First Resources Ltd | Citibank | (13.664) | 138.200 | Sasseur (REIT) | JP Morgan | 324 |
| 400 | First Resources Ltd | HSBC | (49) | (3.400) | SATS Ltd | Citibank | 399 |
| 43.100 | First Resources Ltd | JP Morgan | (5.223) | (68.300) | SATS Ltd | HSBC | 777 |
| 20.200 | Frasers Centrepoint Trust (REIT) | HSBC | 518 | (65.400) | SATS Ltd | JP Morgan | (2.187) |
| 97.500 | Frasers Centrepoint Trust (REIT) | JP Morgan | 2.634 | | | | |
| (20.700) | Frasers Logistics & Commercial Trust (REIT) | Citibank | (411) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|-------------|---|-----------------------------|---|-------------|---|
| Singapur Fortsetzung | | | | Südkorea Fortsetzung | | | |
| (2.900) | Sembcorp Industries Ltd | JP Morgan | (33) | (7.433) | Chabiotech Co Ltd | Citibank | (4.047) |
| 10.400 | Sheng Siong Group Ltd | JP Morgan | (165) | 1.834 | Cheil Worldwide Inc | HSBC | 1.980 |
| 11.900 | Singapore Airlines Ltd | HSBC | 3.092 | (263) | Chunbo Co Ltd | Citibank | 852 |
| 22.300 | Singapore Airlines Ltd | JP Morgan | 4.695 | (18) | Chunbo Co Ltd | JP Morgan | (197) |
| (2.500) | Singapore Exchange Ltd | HSBC | (75) | (4.479) | CJ CGV Co Ltd | Citibank | (2.827) |
| (16.300) | Singapore Exchange Ltd | JP Morgan | (1.793) | (14) | CJ CheilJedang Corp | HSBC | (305) |
| 81.600 | Singapore Post Ltd | Citibank | (512) | 43 | CJ Corp | HSBC | 152 |
| 250.800 | Singapore Post Ltd | JP Morgan | (7.047) | 817 | CJ Freshway Corp | JP Morgan | 615 |
| 20.900 | Singapore Technologies Engineering Ltd | HSBC | 941 | 566 | Com2uSCorp | HSBC | 588 |
| 53.600 | Singapore Technologies Engineering Ltd | JP Morgan | 2.543 | (71) | Com2uSCorp | JP Morgan | (266) |
| (52.300) | Singapore Telecommunications Ltd | HSBC | 4.528 | 5.002 | Cosmecca Korea Co Ltd | JP Morgan | 187 |
| (260.800) | Singapore Telecommunications Ltd | JP Morgan | 19.114 | (58) | Coway Co Ltd | Citibank | (76) |
| 32.700 | SunPower Group Ltd | Citibank | 20 | (1.325) | Coway Co Ltd | HSBC | (3.362) |
| 113.700 | Suntec (REIT) | Citibank | (3.854) | (1.677) | Coway Co Ltd | JP Morgan | (4.262) |
| 46.000 | Suntec (REIT) | HSBC | (1.449) | (5.851) | COWELL FASHION Co Ltd | Citibank | (1.258) |
| 383.600 | Suntec (REIT) | JP Morgan | (13.847) | (3.444) | Creative & Innovative System | Citibank | (1.530) |
| (268.900) | Thai Beverage PCL | Citibank | 701 | (209) | Creative & Innovative System | HSBC | (251) |
| (158.900) | Thai Beverage PCL | HSBC | (2.922) | (7.125) | CS Wind Corp | Citibank | (40.738) |
| (23.200) | Thai Beverage PCL | JP Morgan | (436) | (946) | CS Wind Corp | JP Morgan | (7.158) |
| (43.900) | UOL Group Ltd | HSBC | (16.527) | (564) | Daeduck Co Ltd | JP Morgan | — |
| (89.300) | UOL Group Ltd | JP Morgan | (22.032) | (1.449) | Daejoo Electronic Materials Co Ltd | Citibank | 9.229 |
| (1.200) | Venture Corp Ltd | Citibank | (521) | (37) | Daejoo Electronic Materials Co Ltd | JP Morgan | 123 |
| (28.700) | Venture Corp Ltd | HSBC | (14.293) | 32.885 | Daekyo Co Ltd | Citibank | 4.743 |
| (8.600) | Venture Corp Ltd | JP Morgan | (4.372) | 15.607 | Daesang Corp | Citibank | 4.772 |
| 25.100 | Wilmar International Ltd | HSBC | (978) | 154 | Daewon Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 70 |
| 32.200 | Wilmar International Ltd | JP Morgan | (1.167) | (1.733) | Daewoo Engineering & Construction Co Ltd | JP Morgan | (416) |
| (21.100) | Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd | Citibank | (413) | (333) | Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd | Citibank | (494) |
| (8.200) | Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd | HSBC | (289) | (351) | Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd | HSBC | (547) |
| (95.900) | Yanlord Land Group Ltd | Citibank | (3.650) | 747 | Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd | JP Morgan | (81) |
| (100.200) | Yanlord Land Group Ltd | HSBC | 4.530 | (270) | Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd | JP Morgan | (419) |
| | | | (171.319) | (176) | Daewoong Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | (1.005) |
| | | | | (1.342) | Dawonsys Co Ltd | Citibank | (763) |
| (1.353) | ABLBio Inc | Citibank | (1.523) | (914) | Dawonsys Co Ltd | HSBC | 249 |
| (114) | ABLBio Inc | HSBC | (123) | (283) | Dawonsys Co Ltd | JP Morgan | 77 |
| (693) | ABLBio Inc | JP Morgan | (1.230) | (528) | DB HiTek Co Ltd | JP Morgan | (2.923) |
| (517) | Ace Technologies Corp | Citibank | 52 | 3.125 | DB HiTek Co Ltd | JP Morgan | 17.301 |
| (90) | Ace Technologies Corp | JP Morgan | 21 | 1.012 | DB Insurance Co Ltd | Citibank | 1.125 |
| (19) | AfreecaTV Co Ltd | Citibank | (107) | 352 | Dentium Co Ltd | Citibank | 1.745 |
| 302 | AfreecaTV Co Ltd | JP Morgan | 2.017 | (34) | Devsisters Co Ltd | JP Morgan | 45 |
| (1.113) | Alteogen Inc | Citibank | (3.476) | 48.778 | DGB Financial Group Inc | HSBC | 723 |
| (212) | Alteogen Inc | HSBC | (1.351) | 4.131 | DGB Financial Group Inc | JP Morgan | 64 |
| (25) | Alteogen Inc | JP Morgan | (159) | (3.223) | DL E&C Co Ltd | HSBC | (1.922) |
| (837) | Amicogen Inc | Citibank | (352) | (1.978) | DL E&C Co Ltd | JP Morgan | (1.186) |
| 173 | Amorepacific Corp | JP Morgan | 596 | (326) | DL Holdings Co Ltd | Citibank | (2.514) |
| (87) | AMOREPACIFIC Group | JP Morgan | (132) | (20) | DL Holdings Co Ltd | HSBC | (143) |
| (3.866) | Ananti Inc | Citibank | (713) | (131) | DL Holdings Co Ltd | JP Morgan | (1.141) |
| (1.352) | Ananti Inc | JP Morgan | (364) | (2.888) | Dongjin Semichem Co Ltd | Citibank | 1.670 |
| 588 | Anterogen Co Ltd | JP Morgan | 600 | (76) | Dongjin Semichem Co Ltd | JP Morgan | (246) |
| (4.005) | BH Co Ltd | Citibank | (820) | (1.786) | Dongkook Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | (669) |
| 2.688 | BH Co Ltd | JP Morgan | 5.890 | (1.265) | Dongsuh Cos Inc | Citibank | (1.296) |
| (326) | Binex Co Ltd | JP Morgan | (83) | (777) | Dongsuh Cos Inc | JP Morgan | (1.660) |
| (120) | Bioneer Corp | Citibank | (111) | (358) | Dongwha Enterprise Co Ltd | Citibank | 198 |
| 27.732 | BNK Financial Group Inc | Citibank | 9.448 | (117) | Dongwha Enterprise Co Ltd | JP Morgan | (945) |
| 26.310 | BNK Financial Group Inc | JP Morgan | 7.854 | 1.557 | Dongwon Industries Co Ltd | Citibank | 5.094 |
| (5.308) | Boryung | Citibank | (889) | (755) | Dongwon Systems Corp | Citibank | (53) |
| (4.193) | Cafe24 Corp | Citibank | (2.013) | (176) | Doosan Bobcat Inc | HSBC | 299 |
| (1.162) | Cafe24 Corp | JP Morgan | 6 | 219 | Doosan Co Ltd | Citibank | 1.036 |
| (240) | Cellid Co Ltd | Citibank | 68 | | | | |
| (695) | Celltrion Healthcare Co Ltd | Citibank | 4.739 | | | | |
| (268) | Celltrion Healthcare Co Ltd | JP Morgan | (978) | | | | |
| 8 | Celltrion Inc | HSBC | 2 | | | | |
| (763) | Celltrion Pharm Inc | Citibank | 3.322 | | | | |
| (139) | Celltrion Pharm Inc | JP Morgan | (5) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|------------------------------------|-------------|---|-----------------------------|---|-------------|---|
| Südkorea Fortsetzung | | | | Südkorea Fortsetzung | | | |
| 176 | Doosan Co Ltd | HSBC | 1.036 | (66) | Hanwha Corp | JP Morgan | (111) |
| (1.699) | Doosan Enerbility Co Ltd | Citibank | (1.074) | (6.621) | Hanwha Life Insurance Co Ltd | Citibank | (1.450) |
| (1.820) | Doosan Enerbility Co Ltd | JP Morgan | (601) | (9.387) | Hanwha Life Insurance Co Ltd | HSBC | 454 |
| (3.691) | Doosan Fuel Cell Co Ltd | Citibank | (6.351) | (1.932) | Hanwha Life Insurance Co Ltd | JP Morgan | (25) |
| (502) | Doosan Fuel Cell Co Ltd | HSBC | (793) | (680) | Hanwha Solutions Corp | Citibank | (3.978) |
| (6.642) | Doosan Fuel Cell Co Ltd | JP Morgan | (12.583) | (230) | Hanwha Solutions Corp | HSBC | (1.582) |
| (3.502) | Doosan Tesna Inc | Citibank | 1.630 | (1.845) | Hanwha Solutions Corp | JP Morgan | (12.696) |
| (1.349) | Doosan Tesna Inc | JP Morgan | 906 | (1.519) | Hanwha Systems Co Ltd | Citibank | (712) |
| (1.041) | DoubleUGames Co Ltd | Citibank | (1.522) | (3.957) | Harim Holdings Co Ltd | Citibank | (1.709) |
| 515 | Douzone Bizon Co Ltd | JP Morgan | (33) | 303 | HD Hyundai Co Ltd | JP Morgan | 1.229 |
| (873) | Duk San Neolux Co Ltd | Citibank | 985 | 774 | HDC Hyundai Development Co-Engineering & Construction | HSBC | (36) |
| (39) | Duk San Neolux Co Ltd | JP Morgan | (53) | 5.013 | Hite Jinro Co Ltd | Citibank | 3.074 |
| (682) | Echo Marketing Inc | JP Morgan | 1.117 | (1.395) | HLB Inc | Citibank | 1.784 |
| (952) | Ecopro Co Ltd | Citibank | 464 | (360) | HLB Inc | JP Morgan | (4.905) |
| (48) | Ecopro Co Ltd | JP Morgan | 13 | (188) | HLB Life Science Co Ltd | JP Morgan | (931) |
| (82) | Ecopro HN Co Ltd | Citibank | (144) | (1.772) | HMM Co Ltd | Citibank | (2.105) |
| (23) | Ecopro HN Co Ltd | JP Morgan | (68) | (180) | HMM Co Ltd | HSBC | (568) |
| 155 | E-MART Inc | JP Morgan | (794) | (1.530) | HMM Co Ltd | JP Morgan | (4.696) |
| 2.540 | Enzychem Lifesciences Corp | Citibank | (2.801) | (1.200) | Hotel Shilla Co Ltd | Citibank | (5.209) |
| (1.534) | Eubiologics Co Ltd | Citibank | (525) | (1.058) | Hotel Shilla Co Ltd | JP Morgan | (3.099) |
| (522) | Eugene Technology Co Ltd | Citibank | 669 | 25 | Hugel Inc | Citibank | 59 |
| (87) | Eugene Technology Co Ltd | JP Morgan | (90) | (102) | HYBE Co Ltd | Citibank | (1.210) |
| 1.727 | Eutilex Co Ltd | JP Morgan | (502) | (24) | HYBE Co Ltd | HSBC | (45) |
| 703 | Eutilex Co Ltd (Right) | JP Morgan | 1.506 | (60) | HYBE Co Ltd | JP Morgan | (113) |
| 4.339 | Fila Holdings Corp | Citibank | 6.713 | 8.335 | Hy-Lok Corp | Citibank | 8.952 |
| 1.903 | Fila Holdings Corp | JP Morgan | 4.104 | (70) | Hyosung Advanced Materials Corp | Citibank | (2.712) |
| (5.793) | Fine Semitech Corp | Citibank | (1.220) | (44) | Hyosung Advanced Materials Corp | JP Morgan | (2.326) |
| (227) | Fine Semitech Corp | JP Morgan | 111 | (126) | Hyosung Corp | HSBC | (456) |
| 532 | Foosung Co Ltd | JP Morgan | 89 | (181) | Hyosung TNC Co Ltd | Citibank | (8.918) |
| (5.317) | GemVax & Kael Co Ltd | Citibank | (491) | (43) | Hyundai Bioscience Co Ltd | HSBC | (43) |
| (1.762) | GemVax & Kael Co Ltd | JP Morgan | (1.574) | 683 | Hyundai Construction Equipment Co Ltd | Citibank | 231 |
| (9.157) | Grand Korea Leisure Co Ltd | Citibank | (7.059) | (10.384) | Hyundai Doosan Infracore Co Ltd | Citibank | (1.487) |
| 543 | Grand Korea Leisure Co Ltd | HSBC | 440 | (2.186) | Hyundai Doosan Infracore Co Ltd | JP Morgan | (290) |
| (5.704) | Grand Korea Leisure Co Ltd | JP Morgan | (5.823) | 428 | Hyundai Electric & Energy System Co Ltd | Citibank | 334 |
| 395 | Green Cross Corp | HSBC | 6.528 | (703) | Hyundai Engineering & Construction Co Ltd | Citibank | (1.744) |
| 2.298 | Green Cross Holdings Corp | Citibank | 2.859 | (49) | Hyundai Engineering & Construction Co Ltd | JP Morgan | (46) |
| (1.359) | GS Engineering & Construction Corp | Citibank | (2.699) | 494 | Hyundai Glovis Co Ltd | Citibank | 4.723 |
| (1.136) | GS Engineering & Construction Corp | HSBC | (613) | 933 | Hyundai Heavy Industries Co Ltd | Citibank | 4.852 |
| (81) | GS Engineering & Construction Corp | JP Morgan | (44) | 12.626 | Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd | Citibank | 14.274 |
| 1.220 | Hana Financial Group Inc | HSBC | 3.329 | (777) | Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd | Citibank | (4.433) |
| (299) | Hana Materials Inc | Citibank | (849) | (281) | Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd | HSBC | (1.632) |
| (106) | Hana Tour Service Inc | JP Morgan | (130) | (105) | Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd | JP Morgan | (682) |
| (13) | Hana Tour Service Inc (Right) | JP Morgan | (168) | 494 | Hyundai Mobis Co Ltd | Citibank | 8.068 |
| (1.749) | Hanall Biopharma Co Ltd | Citibank | (725) | 377 | Hyundai Motor Co | JP Morgan | 3.171 |
| (473) | Hanall Biopharma Co Ltd | HSBC | (321) | (10.494) | Hyundai Rotem Co Ltd | Citibank | (11.361) |
| (1.496) | Hanall Biopharma Co Ltd | JP Morgan | (1.285) | (3.842) | Hyundai Rotem Co Ltd | JP Morgan | (4.310) |
| 4.710 | Handsome Co Ltd | HSBC | 10.936 | 1.446 | Hyundai Steel Co | Citibank | 2.050 |
| 4.572 | Handsome Co Ltd | JP Morgan | 6.051 | (204) | Hyundai Wia Corp | HSBC | (813) |
| 1.136 | Hanjin Transportation Co Ltd | Citibank | 100 | (107) | Hyundai Wia Corp | JP Morgan | (427) |
| 337 | Hankook Tire & Technology Co Ltd | Citibank | 405 | (56) | Iijin Materials Co Ltd | HSBC | (404) |
| (44) | Hanmi Pharm Co Ltd | HSBC | (466) | | | | |
| (114) | Hanmi Pharm Co Ltd | JP Morgan | (953) | | | | |
| 711 | Hanon Systems | HSBC | 525 | | | | |
| 4.896 | Hansae Co Ltd | JP Morgan | (314) | | | | |
| (223) | Hansol Chemical Co Ltd | Citibank | (924) | | | | |
| (151) | Hansol Chemical Co Ltd | HSBC | (3.366) | | | | |
| (132) | Hanssem Co Ltd | Citibank | (603) | | | | |
| (74) | Hanssem Co Ltd | JP Morgan | (458) | | | | |
| 1.920 | Hanwha Aerospace Co Ltd | Citibank | 4.505 | | | | |
| (892) | Hanwha Corp | Citibank | (1.182) | | | | |
| (247) | Hanwha Corp | HSBC | (414) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return

Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|---|-------------|---|-----------------------------|---|-------------|---|
| Südkorea Fortsetzung | | | | Südkorea Fortsetzung | | | |
| (140) | Ilijin Materials Co Ltd | JP Morgan | (1.010) | (4.926) | Kuk-il Paper Manufacturing Co Ltd | | (1.016) |
| 2.448 | Ilyang Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | 7.828 | (517) | Kumho Petrochemical Co Ltd | JP Morgan | (3.460) |
| 12.344 | InBody Co Ltd | Citibank | 17.590 | (47) | Kumho Petrochemical Co Ltd | Citibank | (730) |
| 20.112 | Industrial Bank of Korea | HSBC | 4.507 | (4.966) | Kumho Tire Co Inc | Citibank | (463) |
| 4.370 | Innocean Worldwide Inc | JP Morgan | 9.628 | (334) | Kumho Tire Co Inc | JP Morgan | (83) |
| (1.398) | Innox Advanced Materials Co Ltd | Citibank | 1.494 | 54 | Kyeryong Construction Industrial Co Ltd | HSBC | (26) |
| (28.173) | Insun ENT Co Ltd | Citibank | (7.121) | (1.576) | L&C Bio Co Ltd | Citibank | (3.749) |
| (14.795) | Insun ENT Co Ltd | JP Morgan | 1.120 | (116) | L&C Bio Co Ltd | HSBC | (174) |
| 6.561 | Interflex Co Ltd | HSBC | 2.934 | (44) | L&C Bio Co Ltd | JP Morgan | (66) |
| (8.301) | IS Dongseo Co Ltd | JP Morgan | (7.058) | (195) | L&F Co Ltd | Citibank | 1.741 |
| (5.626) | ITM Semiconductor Co Ltd | Citibank | (3.146) | (4.097) | LB Semicon Inc | Citibank | (443) |
| (221) | ITM Semiconductor Co Ltd | JP Morgan | (502) | (1.392) | LB Semicon Inc | JP Morgan | (248) |
| 2.710 | JB Financial Group Co Ltd | JP Morgan | 1.270 | 2.486 | LEENO Industrial Inc | JP Morgan | (14.585) |
| 112 | Jeil Pharmaceutical Co Ltd 'N' | JP Morgan | (19) | (3.176) | LegoChem Biosciences Inc | Citibank | (2.883) |
| 5.633 | Jeisys Medical Inc | JP Morgan | 3.935 | (293) | LegoChem Biosciences Inc | JP Morgan | (1.285) |
| 135 | Jeju Air Co Ltd | JP Morgan | 223 | 485 | LG Chem Ltd | Citibank | 20.970 |
| (2.007) | Jusung Engineering Co Ltd | HSBC | (1.070) | 6.140 | LG Display Co Ltd | HSBC | 4.421 |
| (2.933) | Jusung Engineering Co Ltd | JP Morgan | (1.568) | (242) | LG Electronics Inc | Citibank | (435) |
| 1.947 | JW Pharmaceutical Corp | HSBC | (577) | (54) | LG Electronics Inc | HSBC | 206 |
| (185) | Kakao Corp | JP Morgan | (500) | (111) | LG Innotek Co Ltd | Citibank | (2.312) |
| (1.184) | Kangwon Land Inc | Citibank | (1.787) | (135) | LG Innotek Co Ltd | HSBC | (6.832) |
| (2.572) | Kangwon Land Inc | HSBC | (6.436) | 10.777 | LG Uplus Corp | JP Morgan | 3.926 |
| (2.929) | Kangwon Land Inc | JP Morgan | (7.334) | (199) | Lotte Chemical Corp | HSBC | (2.905) |
| 1.395 | KB Financial Group Inc | Citibank | 3.759 | 853 | Lotte Chilsung Beverage Co Ltd | JP Morgan | 6.257 |
| (36) | KCC Corp | Citibank | (414) | (2.219) | Lotte Corp | Citibank | (2.912) |
| (16) | KCC Corp | HSBC | 26 | (564) | Lotte Corp | HSBC | (1.150) |
| (4) | KCC Corp | JP Morgan | 6 | (1.484) | Lotte Corp | JP Morgan | (3.028) |
| (842) | KEPCO Engineering & Construction Co Inc | Citibank | (266) | (27) | LOTTE Fine Chemical Co Ltd | HSBC | (140) |
| (336) | KEPCO Engineering & Construction Co Inc | JP Morgan | 2.344 | (561) | LOTTE Fine Chemical Co Ltd | JP Morgan | (2.910) |
| (3.156) | KEPCO Plant Service & Engineering Co Ltd | Citibank | (3.650) | 1.561 | Lotte Rental Co Ltd | Citibank | 1.556 |
| (86) | KEPCO Plant Service & Engineering Co Ltd | HSBC | 12 | 215 | Lotte Rental Co Ltd | HSBC | (689) |
| (3.311) | KEPCO Plant Service & Engineering Co Ltd | JP Morgan | 460 | 297 | Lotte Shopping Co Ltd | Citibank | 1.432 |
| (937) | Kia Corp | HSBC | (4.160) | (13.754) | Lotte Tour Development Co Ltd | Citibank | (20.205) |
| (846) | KIWOOM Securities Co Ltd | Citibank | (3.522) | (87) | Lotte Tour Development Co Ltd | HSBC | (102) |
| (310) | KIWOOM Securities Co Ltd | HSBC | (2.249) | (374) | Lotte Tour Development Co Ltd | JP Morgan | (438) |
| (202) | KIWOOM Securities Co Ltd | JP Morgan | (1.352) | 4.946 | LS Corp | JP Morgan | 44.925 |
| 2.222 | Koh Young Technology Inc | HSBC | (1.145) | 4.409 | LS Electric Co Ltd | Citibank | 11.536 |
| (2.785) | Kolmar BNH Co Ltd | Citibank | (4.557) | 588 | LX Hausys Ltd | JP Morgan | (692) |
| (422) | Kolmar BNH Co Ltd | HSBC | (206) | 139 | LX Semicon Co Ltd | JP Morgan | 449 |
| (175) | Kolmar BNH Co Ltd | JP Morgan | (86) | 1.720 | Maeil Dairies Co Ltd | JP Morgan | (1.189) |
| (702) | Kolmar Korea Co Ltd | Citibank | (751) | 1.063 | Mando Corp | HSBC | 3.366 |
| (130) | Kolmar Korea Co Ltd | HSBC | 36 | 367 | Mcnex Co Ltd | Citibank | (90) |
| (521) | Kolmar Korea Co Ltd | JP Morgan | (65) | 184 | MedPacto Inc | Citibank | 81 |
| (1.098) | Korea Aerospace Industries Ltd | Citibank | (3.475) | 1.031 | MegaStudyEdu Co Ltd | Citibank | 4.892 |
| (404) | Korea Aerospace Industries Ltd | HSBC | (1.670) | 154 | Meritz Fire & Marine Insurance Co Ltd | JP Morgan | (326) |
| 2.070 | Korea Gas Corp | Citibank | 5.255 | (6.733) | Meritz Securities Co Ltd | HSBC | 625 |
| (329) | Korea Investment Holdings Co Ltd | Citibank | (793) | (7.174) | Meritz Securities Co Ltd | JP Morgan | 664 |
| (101) | Korea Investment Holdings Co Ltd | JP Morgan | (304) | (295) | Mirae Asset Securities Co Ltd | Citibank | (86) |
| 501 | Korea Line Corp | JP Morgan | 176 | (1.584) | Mirae Asset Securities Co Ltd | HSBC | (787) |
| 2.124 | Korea Shipbuilding & Off-shore Engineering Co Ltd | HSBC | 9.379 | (852) | Myoung Shin Industrial Co Ltd | Citibank | (548) |
| 2.145 | Korean Air Lines Co Ltd | HSBC | 533 | (589) | Myoung Shin Industrial Co Ltd | JP Morgan | (998) |
| (127) | Krafton Inc | JP Morgan | (1.864) | 9.906 | Nasmedia Co Ltd | Citibank | 3.008 |
| 12.982 | KT Corp | JP Morgan | 30.906 | (4.237) | Naturecell Co Ltd | Citibank | (1.112) |
| (2.398) | KT&G Corp | HSBC | (9.100) | (596) | Naturecell Co Ltd | JP Morgan | (618) |
| (9.366) | Kuk-il Paper Manufacturing Co Ltd | Citibank | (830) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|-------------|---|-----------------------------|--|-------------|---|
| Südkorea Fortsetzung | | | | Südkorea Fortsetzung | | | |
| 209 | NAVER Corp | JP Morgan | 3.545 | 7.088 | Seah Besteel Holdings Corp | Citibank | 4.371 |
| 78 | NCSOFT Corp | Citibank | 607 | 783 | SeAH Steel Corp | JP Morgan | 1.772 |
| 1.911 | Neowiz | JP Morgan | 6.082 | (530) | Sebang Global Battery Co Ltd | Citibank | (567) |
| (7.194) | NEPES Corp | Citibank | (3.297) | (67) | Sebang Global Battery Co Ltd | HSBC | 239 |
| (918) | NEPES Corp | JP Morgan | (921) | (499) | Sebang Global Battery Co Ltd | JP Morgan | 1.774 |
| 175 | Netmarble Corp | HSBC | 500 | (43) | Seegene Inc | JP Morgan | (224) |
| 2.376 | NH Investment & Securities Co Ltd | JP Morgan | 1.348 | (4.659) | Seojin System Co Ltd | Citibank | (309) |
| 1.195 | NHN Corp | JP Morgan | (1.454) | (1.910) | Seojin System Co Ltd | JP Morgan | (796) |
| 487 | NHN KCP Corp | Citibank | 38 | (8.403) | Seoul Semiconductor Co Ltd | Citibank | (4.167) |
| 2.032 | Nice Information & Telecommunication Inc | Citibank | 1.087 | (182) | Seoul Semiconductor Co Ltd | JP Morgan | (75) |
| (1.369) | NKMax Co Ltd | Citibank | 771 | (1.020) | SFA Engineering Corp | Citibank | 116 |
| (361) | NKMax Co Ltd | JP Morgan | (327) | 5.678 | Shinhan Financial Group Co Ltd | Citibank | 10.695 |
| (530) | NongShim Co Ltd | Citibank | (1.873) | 729 | Shinsegae Food Co Ltd | JP Morgan | (1.062) |
| 750 | NongShim Co Ltd | Citibank | 2.788 | 668 | Shinsegae Inc | Citibank | 6.068 |
| (330) | NOVAREX Co Ltd | Citibank | (553) | 364 | Shinsegae Inc | JP Morgan | 6.573 |
| (90) | NOVAREX Co Ltd | JP Morgan | 148 | 3.831 | Shinsegae International Inc | JP Morgan | 10.822 |
| (286) | OCI Co Ltd | JP Morgan | (6.028) | 255 | SIMMTECH Co Ltd | HSBC | 214 |
| 1.661 | Optipharm Co Ltd | Citibank | 759 | (710) | SK Biopharmaceuticals Co Ltd | Citibank | (1.109) |
| (1.841) | Orion Holdings Corp | Citibank | (378) | (54) | SK Biopharmaceuticals Co Ltd | HSBC | (84) |
| (6.032) | Orion Holdings Corp | HSBC | (3.203) | (45) | SK Biopharmaceuticals Co Ltd | JP Morgan | (70) |
| (3.069) | Orion Holdings Corp | JP Morgan | (1.632) | (494) | SK Bioscience Co Ltd | Citibank | (2.122) |
| (937) | Oscotec Inc | Citibank | (508) | (186) | SK Bioscience Co Ltd | JP Morgan | (2.416) |
| 215 | Otogi Corp | Citibank | (242) | (10) | SK Chemicals Co Ltd | HSBC | (81) |
| 5.878 | Pan Ocean Co Ltd | HSBC | 3.675 | (26) | SK Chemicals Co Ltd | JP Morgan | (211) |
| 3.188 | Paradise Co Ltd | Citibank | 3.795 | 23 | SK Gas Ltd | JP Morgan | 24 |
| (777) | Paradise Co Ltd | Citibank | (925) | (368) | SK Hynix Inc | Citibank | 776 |
| (199) | Paradise Co Ltd | JP Morgan | (280) | (303) | SK IE Technology Co Ltd | Citibank | (2.571) |
| (1.463) | Park Systems Corp | Citibank | (8.304) | 310 | SK Inc | Citibank | 3.786 |
| (2.158) | People & Technology Inc | Citibank | (15.265) | 85 | SK Innovation Co Ltd | Citibank | (148) |
| (97) | People & Technology Inc | JP Morgan | (1.389) | 25.643 | SK Networks Co Ltd | Citibank | 3.180 |
| (38) | PI Advanced Materials Co Ltd | Citibank | (69) | (1.754) | SK Square Co Ltd | Citibank | (1.905) |
| (186) | PI Advanced Materials Co Ltd | JP Morgan | (379) | (442) | SK Square Co Ltd | HSBC | (992) |
| 1.218 | POSCO Holdings Inc | HSBC | 15.888 | 126 | SK Telecom Co Ltd | Citibank | 103 |
| (17.962) | Posco ICT Co Ltd | Citibank | (913) | (509) | SL Corp | JP Morgan | (2.102) |
| (4.679) | Posco ICT Co Ltd | JP Morgan | (1.196) | (388) | SM Entertainment Co Ltd | Citibank | (707) |
| 6.292 | Posco International Corp | Citibank | 6.215 | (73) | SM Entertainment Co Ltd | JP Morgan | (595) |
| (367) | PSK Inc | Citibank | 297 | 1.124 | S-Oil Corp | JP Morgan | 7.030 |
| 2.024 | Rayence Co Ltd | JP Morgan | 628 | (1.111) | Soulbrain Co Ltd | Citibank | (8.690) |
| (11.142) | RFHIC Corp | Citibank | (18.700) | (20) | Soulbrain Co Ltd | HSBC | (767) |
| (451) | RFHIC Corp | JP Morgan | (966) | 456 | SPC Samlip Co Ltd | JP Morgan | (1.510) |
| 287 | Rsupport Co Ltd | HSBC | 52 | (961) | ST Pharm Co Ltd | Citibank | (6.116) |
| (394) | Sam Chun Dang Pharm Co Ltd | Citibank | (708) | (43) | ST Pharm Co Ltd | JP Morgan | (466) |
| (476) | Sam Chun Dang Pharm Co Ltd | JP Morgan | (2.856) | (1.242) | Taeyoung Engineering & Construction Co Ltd | Citibank | — |
| (5.054) | SAM KANG M&T Co Ltd | Citibank | (5.931) | (2.247) | Taihan Electric Wire Co Ltd | Citibank | (130) |
| (191) | Samsung Biologics Co Ltd | Citibank | (6.999) | (1.498) | Taihan Electric Wire Co Ltd | JP Morgan | (90) |
| 97 | Samsung C&T Corp | HSBC | 884 | 227 | TES Co Ltd | HSBC | 76 |
| 13.080 | Samsung Card Co Ltd | JP Morgan | 19.884 | (450) | TES Co Ltd | JP Morgan | (150) |
| 4.654 | Samsung Electronics Co Ltd | JP Morgan | 12.111 | (9.051) | TK Chemical Corp | Citibank | (660) |
| 3.020 | Samsung Engineering Co Ltd | JP Morgan | (3.237) | 9.171 | TKG Huchems Co Ltd | HSBC | 4.161 |
| 319 | Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd | Citibank | 960 | (38) | Tokai Carbon Korea Co Ltd | Citibank | (129) |
| (7.670) | Samsung Heavy Industries Co Ltd | JP Morgan | (2.332) | (64) | Tokai Carbon Korea Co Ltd | JP Morgan | (51) |
| (175) | Samsung Securities Co Ltd | Citibank | (354) | 580 | Tokai Carbon Korea Co Ltd | JP Morgan | (242) |
| (608) | Samsung Securities Co Ltd | HSBC | (1.185) | (1.338) | TSE Co Ltd | Citibank | (6.113) |
| (725) | Samsung Securities Co Ltd | JP Morgan | (1.414) | (232) | Vaxcell-Bio Therapeutics Co Ltd | Citibank | (94) |
| 61 | Samyang Foods Co Ltd | JP Morgan | 300 | (15) | Vaxcell-Bio Therapeutics Co Ltd | JP Morgan | (64) |
| (151) | Samyang Holdings Corp | Citibank | (282) | 953 | Vieworks Co Ltd | JP Morgan | 1.176 |
| (1) | Samyang Holdings Corp | HSBC | (1) | (202) | Webzen Inc | Citibank | (65) |
| (209) | Samyang Holdings Corp | JP Morgan | (120) | (409) | Webzen Inc | JP Morgan | (378) |
| (824) | Sang-A Frontec Co Ltd | Citibank | (1.316) | | | | |
| (8.118) | Sangsangin Co Ltd | Citibank | (9.042) | | | | |
| (3.727) | Sangsangin Co Ltd | JP Morgan | (3.156) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|---|-------------|---|---------------------------|--|-------------|---|
| Taiwan Fortsetzung | | | | Taiwan Fortsetzung | | | |
| (2.000) | Chung-Hsin Electric & Machinery Manufacturing Corp | Citibank | (166) | 30.000 | Eva Airways Corp | HSBC | (46) |
| (105.000) | Chung-Hsin Electric & Machinery Manufacturing Corp | JP Morgan | (9.629) | 30.000 | Eva Airways Corp | JP Morgan | (129) |
| 1.000 | Chunghwa Precision Test Tech Co Ltd | Citibank | 662 | (9.000) | Evergreen International Storage & Transport Corp | Citibank | (838) |
| 1.000 | Chunghwa Precision Test Tech Co Ltd | HSBC | 1.810 | (1.000) | Evergreen International Storage & Transport Corp | JP Morgan | (95) |
| 4.000 | Chunghwa Telecom Co Ltd | HSBC | 696 | 13.000 | EVERGREEN Steel Corp | Citibank | (199) |
| 2.000 | Cleanaway Co Ltd | JP Morgan | 464 | 1.000 | EVERGREEN Steel Corp | HSBC | 115 |
| (39.000) | CMC Magnetics Corp | JP Morgan | (545) | 13.000 | EVERGREEN Steel Corp | JP Morgan | 1.435 |
| (18.000) | Compal Electronics Inc | Citibank | (773) | (50.000) | Everlight Electronics Co Ltd | Citibank | (1.299) |
| (96.000) | Compal Electronics Inc | JP Morgan | (3.371) | (3.000) | Everlight Electronics Co Ltd | HSBC | (406) |
| 168.000 | Compeq Manufacturing Co Ltd | Citibank | 1.825 | (82.000) | Everlight Electronics Co Ltd | JP Morgan | (11.010) |
| 20.000 | Compeq Manufacturing Co Ltd | HSBC | 4.629 | (18.000) | Excellence Opto Inc | Citibank | (806) |
| 108.000 | Compeq Manufacturing Co Ltd | JP Morgan | 24.646 | (5.000) | Excellence Opto Inc | JP Morgan | (587) |
| (7.000) | Continental Holdings Corp | JP Morgan | (41) | (12.000) | Far Eastern New Century Corp | Citibank | 111 |
| (48.000) | Co-Tech Development Corp | Citibank | (4.840) | (13.000) | Far Eastern New Century Corp | JP Morgan | (609) |
| (13.000) | Co-Tech Development Corp | JP Morgan | (750) | 11.000 | Far EasTone Telecommunications Co Ltd | Citibank | (25) |
| (114.000) | CSBC Corp Taiwan | Citibank | (2.897) | 10.000 | Far EasTone Telecommunications Co Ltd | HSBC | 771 |
| (27.000) | CSBC Corp Taiwan | JP Morgan | (41) | 157.000 | Far EasTone Telecommunications Co Ltd | JP Morgan | 11.136 |
| 36.000 | CTBC Financial Holding Co Ltd | Citibank | 2.743 | 11.000 | Faraday Technology Corp | Citibank | (4.482) |
| 10.000 | CTBC Financial Holding Co Ltd | HSBC | 178 | 1.000 | Faraday Technology Corp | HSBC | 1 |
| 50.000 | CTBC Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | 783 | 1.000 | Faraday Technology Corp | JP Morgan | (19) |
| 175.000 | CTCI Corp | Citibank | 23.676 | (20.000) | First Copper Technology Co Ltd | Citibank | (889) |
| 8.000 | CTCI Corp | HSBC | (102) | 132.000 | First Financial Holding Co Ltd | Citibank | 7.401 |
| 58.000 | CTCI Corp | JP Morgan | 3.848 | 16.000 | First Financial Holding Co Ltd | HSBC | 1.040 |
| (1.000) | Cub Elecparts Inc | Citibank | (222) | 173.000 | First Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | 10.896 |
| (2.000) | Cub Elecparts Inc | HSBC | (992) | (1.000) | Fitipower Integrated Technology Inc | Citibank | (246) |
| (4.000) | Cub Elecparts Inc | JP Morgan | (1.940) | (2.000) | Fittech Co Ltd | JP Morgan | (652) |
| 20.000 | Darwin Precisions Corp | Citibank | (21) | (1.000) | FLEXium Interconnect Inc | JP Morgan | (132) |
| 1.000 | Darwin Precisions Corp | HSBC | 21 | (3.000) | Formosa Chemicals & Fibre Corp | Citibank | (373) |
| 3.000 | Darwin Precisions Corp | JP Morgan | 60 | (14.000) | Formosa Chemicals & Fibre Corp | HSBC | (2.566) |
| (3.000) | Delta Electronics Inc | JP Morgan | (1.715) | (1.000) | Formosa Chemicals & Fibre Corp | JP Morgan | (177) |
| (38.000) | Dyaco International Inc | Citibank | (2.756) | (3.000) | Formosa Petrochemical Corp | Citibank | (424) |
| (1.000) | Dynamic Electronics Co Ltd | JP Morgan | (161) | (19.000) | Formosa Petrochemical Corp | JP Morgan | (5.500) |
| 7.000 | E Ink Holdings Inc | Citibank | 2.992 | 12.000 | Formosa Plastics Corp | Citibank | 872 |
| 4.000 | E Ink Holdings Inc | HSBC | 5.120 | 3.000 | Formosa Plastics Corp | HSBC | 416 |
| 6.000 | E Ink Holdings Inc | JP Morgan | 7.600 | 2.000 | Formosa Plastics Corp | JP Morgan | 261 |
| 101.000 | E.Sun Financial Holding Co Ltd | Citibank | 6.060 | 3.000 | Formosa Sumco Technology Corp | Citibank | 2.818 |
| 97.000 | E.Sun Financial Holding Co Ltd | HSBC | 2.171 | 1.000 | Formosa Sumco Technology Corp | HSBC | 2.151 |
| 15.916 | E.Sun Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | 318 | 7.000 | Formosa Sumco Technology Corp | JP Morgan | 14.467 |
| (4.000) | Eclat Textile Co Ltd | JP Morgan | (3.572) | 74.000 | Formosa Taffeta Co Ltd | Citibank | 3.636 |
| 5.000 | Elan Microelectronics Corp | Citibank | 1.275 | 17.000 | Formosa Taffeta Co Ltd | HSBC | 730 |
| 1.000 | Elite Material Co Ltd | Citibank | 380 | 52.000 | Formosa Taffeta Co Ltd | JP Morgan | 2.127 |
| (1.000) | Elite Material Co Ltd | Citibank | (380) | (50.000) | Foxconn Technology Co Ltd | Citibank | (3.240) |
| (6.000) | Elite Semiconductor Microelectronics Technology Inc | JP Morgan | (2.185) | (48.000) | Foxconn Technology Co Ltd | JP Morgan | 7.541 |
| 8.038 | Ennoconn Corp | Citibank | 2.184 | (1.000) | Foxsemicon Integrated Technology Inc | JP Morgan | (726) |
| 3.038 | Ennoconn Corp | HSBC | 2.422 | (6.353) | Fubon Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | 481 |
| 8.039 | Ennoconn Corp | JP Morgan | 5.901 | 3.000 | Fulgent Sun International Holding Co Ltd | Citibank | 772 |
| (4.000) | ENNOSTAR Inc | Citibank | (311) | | | | |
| (8.000) | ENNOSTAR Inc | HSBC | (2.148) | | | | |
| (38.500) | ENNOSTAR Inc | JP Morgan | (10.167) | | | | |
| (1.000) | Epileds Technologies Inc | JP Morgan | (59) | | | | |
| (17.305) | Episil Technologies Inc | JP Morgan | (12.201) | | | | |
| 42.000 | Eva Airways Corp | Citibank | 3.472 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--|-------------|---|---------------------------|---|-------------|---|
| Taiwan Fortsetzung | | | | Taiwan Fortsetzung | | | |
| 3.000 | Fulgent Sun International Holding Co Ltd | JP Morgan | 753 | 5.000 | Holtek Semiconductor Inc | Citibank | 599 |
| 1.000 | General Interface Solution Holding Ltd | Citibank | 252 | 12.000 | Holtek Semiconductor Inc | HSBC | 2.191 |
| 2.000 | General Interface Solution Holding Ltd | HSBC | 220 | 11.000 | Holtek Semiconductor Inc | JP Morgan | 2.421 |
| 10.000 | General Interface Solution Holding Ltd | JP Morgan | 1.031 | (35.000) | Holy Stone Enterprise Co Ltd | Citibank | (6.270) |
| (2.000) | Genius Electronic Optical Co Ltd | JP Morgan | (5.350) | (23.000) | Holy Stone Enterprise Co Ltd | JP Morgan | (2.083) |
| (64.000) | Getac Holdings Corp | Citibank | (3.960) | (44.000) | Hon Hai Precision Industry Co Ltd | Citibank | (10.868) |
| (4.000) | Getac Holdings Corp | HSBC | (86) | (2.000) | Hotai Motor Co Ltd | Citibank | (4.590) |
| (53.000) | Getac Holdings Corp | JP Morgan | (948) | (9.000) | Hotai Motor Co Ltd | JP Morgan | (28.605) |
| 19.000 | Giantplus Technology Co Ltd | Citibank | 83 | (66.000) | Hsin Kuang Steel Co Ltd | Citibank | (4.396) |
| (165.000) | Global Brands Manufacture Ltd | Citibank | (3.267) | (3.000) | Hsin Kuang Steel Co Ltd | HSBC | 691 |
| (1.000) | Global Brands Manufacture Ltd | HSBC | (87) | (9.000) | Hsin Kuang Steel Co Ltd | JP Morgan | 2.113 |
| (8.000) | Global Brands Manufacture Ltd | JP Morgan | (369) | (2.000) | HTC Corp | Citibank | (252) |
| (2.000) | Global Lighting Technologies Inc | Citibank | (138) | (34.000) | HTC Corp | JP Morgan | (6.280) |
| (1.000) | Global Lighting Technologies Inc | JP Morgan | (174) | 2.000 | Hu Lane Associate Inc | Citibank | 748 |
| 1.000 | Global Mixed Mode Technology Inc | Citibank | 323 | 2.000 | Hu Lane Associate Inc | HSBC | 25 |
| 3.000 | Global Mixed Mode Technology Inc | JP Morgan | 2.481 | 2.000 | Hu Lane Associate Inc | JP Morgan | 594 |
| (4.000) | Global PMX Co Ltd | Citibank | (1.372) | 66.848 | Hua Nan Financial Holdings Co Ltd | HSBC | 4.934 |
| 13.000 | Global Unichip Corp | Citibank | 1.464 | 268.916 | Hua Nan Financial Holdings Co Ltd | JP Morgan | 19.380 |
| 3.000 | Global Unichip Corp | HSBC | 10.168 | 17.000 | Huaku Development Co Ltd | Citibank | 1.053 |
| 9.000 | Global Unichip Corp | JP Morgan | 30.177 | 19.000 | Huaku Development Co Ltd | JP Morgan | 2.148 |
| 4.000 | Gloria Material Technology Corp | HSBC | 158 | (347.935) | IBF Financial Holdings Co Ltd | Citibank | (4.931) |
| 13.000 | Gold Circuit Electronics Ltd | Citibank | 468 | (77.000) | Innolux Corp | HSBC | (1.680) |
| 12.000 | Gold Circuit Electronics Ltd | HSBC | (67) | (156.000) | Innolux Corp | JP Morgan | (3.238) |
| 21.000 | Gold Circuit Electronics Ltd | JP Morgan | (254) | (14.000) | Inpaq Technology Co Ltd | Citibank | (2.589) |
| 35.000 | Gourmet Master Co Ltd | Citibank | 7.749 | (1.000) | Inpaq Technology Co Ltd | HSBC | (212) |
| 1.000 | Gourmet Master Co Ltd | HSBC | 272 | (1.000) | Inpaq Technology Co Ltd | JP Morgan | (180) |
| 19.000 | Gourmet Master Co Ltd | JP Morgan | 5.033 | (59.000) | International CSRC Investment Holdings Co | Citibank | (1.270) |
| (181.000) | Grand Pacific Petrochemical | Citibank | (5.198) | (45.000) | International CSRC Investment Holdings Co | JP Morgan | 859 |
| (36.000) | Grand Pacific Petrochemical | JP Morgan | (760) | (3.000) | International Games System Co Ltd | Citibank | (5.307) |
| (1.000) | Great Wall Enterprise Co Ltd | Citibank | (97) | 5.000 | Inventec Corp | Citibank | 123 |
| (11.000) | Great Wall Enterprise Co Ltd | JP Morgan | (44) | 9.000 | Inventec Corp | HSBC | 180 |
| (21.000) | Greatek Electronics Inc | Citibank | (1.398) | 31.000 | Inventec Corp | JP Morgan | 558 |
| (1.000) | Greatek Electronics Inc | HSBC | (141) | (1.000) | ITEQ Corp | Citibank | (260) |
| (16.000) | Greatek Electronics Inc | JP Morgan | (2.170) | (1.000) | ITEQ Corp | JP Morgan | (336) |
| 1.000 | Green World FinTech Service Co Ltd | Citibank | (148) | 4.000 | Jarlytec Co Ltd | Citibank | 442 |
| 1.000 | Green World FinTech Service Co Ltd | JP Morgan | 2.487 | 7.000 | Jarlytec Co Ltd | HSBC | 1.664 |
| (2.000) | Gudeng Precision Industrial Co Ltd | Citibank | (2.248) | 29.000 | Jarlytec Co Ltd | JP Morgan | 6.754 |
| (2.000) | Gudeng Precision Industrial Co Ltd | JP Morgan | (3.393) | (116.898) | Jih Sun Financial Holdings Co Ltd | Citibank | (399) |
| (15.000) | Hannstar Board Corp | Citibank | (456) | (2) | Jih Sun Financial Holdings Co Ltd | JP Morgan | — |
| (7.000) | Hannstar Board Corp | JP Morgan | (479) | (93.000) | Johnson Health Tech Co Ltd | Citibank | (4.039) |
| (12.000) | HannStar Display Corp | Citibank | (144) | (28.000) | Johnson Health Tech Co Ltd | JP Morgan | 282 |
| (135.000) | HannStar Display Corp | JP Morgan | (1.743) | (117.000) | Kenda Rubber Industrial Co Ltd | Citibank | (2.119) |
| (8.000) | Highwealth Construction Corp | HSBC | (299) | (81.000) | Kenda Rubber Industrial Co Ltd | JP Morgan | (3.147) |
| (27.000) | Highwealth Construction Corp | JP Morgan | (912) | (5.000) | Kerry TJ Logistics Co Ltd | Citibank | (250) |
| 3.060 | Hiwin Technologies Corp | Citibank | 1.406 | (6.000) | Kerry TJ Logistics Co Ltd | HSBC | (592) |
| 4.120 | Hiwin Technologies Corp | HSBC | (466) | 13.000 | Kindom Development Co Ltd | Citibank | 444 |
| 1.030 | Hiwin Technologies Corp | JP Morgan | (135) | 15.000 | Kindom Development Co Ltd | HSBC | 402 |
| | | | | 21.000 | Kindom Development Co Ltd | JP Morgan | 626 |
| | | | | 4.000 | King Slide Works Co Ltd | Citibank | 2.996 |
| | | | | 9.000 | King Slide Works Co Ltd | HSBC | 13.375 |
| | | | | 6.000 | King Slide Works Co Ltd | JP Morgan | 8.722 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return

Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|-------------------------------------|-------------|---|---------------------------|-----------------------------------|-------------|---|
| Taiwan Fortsetzung | | | | Taiwan Fortsetzung | | | |
| 138.000 | King Yuan Electronics Co Ltd | Citibank | 12.532 | (53.030) | Mercuries Life Insurance Co Ltd | Citibank | (318) |
| 63.000 | King Yuan Electronics Co Ltd | HSBC | 8.738 | (95.768) | Mercuries Life Insurance Co Ltd | JP Morgan | (978) |
| 363.000 | King Yuan Electronics Co Ltd | JP Morgan | 48.541 | (1.000) | Merida Industry Co Ltd | Citibank | (1.007) |
| 8.000 | Kinpo Electronics | Citibank | 225 | (5.000) | Merida Industry Co Ltd | JP Morgan | (5.964) |
| 2.000 | Kinpo Electronics | HSBC | 53 | (4.000) | Merry Electronics Co Ltd | Citibank | (592) |
| 44.000 | Kinpo Electronics | JP Morgan | 1.129 | (10.000) | Merry Electronics Co Ltd | JP Morgan | (998) |
| 25.000 | Kinsus Interconnect Technology Corp | Citibank | 5.982 | (33.615) | Microbio Co Ltd | JP Morgan | (4.113) |
| 8.000 | Kinsus Interconnect Technology Corp | HSBC | 3.464 | (4.000) | Micro-Star International Co Ltd | JP Morgan | (1.288) |
| 16.000 | Kinsus Interconnect Technology Corp | JP Morgan | 6.718 | 76.000 | Mitac Holdings Corp | Citibank | 2.499 |
| (12.000) | KMC Kuei Meng International Inc | Citibank | (2.834) | 85.000 | Mitac Holdings Corp | HSBC | 3.431 |
| (32.100) | Lien Hwa Industrial Holdings Corp | Citibank | (4.641) | 5.000 | Mitac Holdings Corp | JP Morgan | 191 |
| 900 | Lien Hwa Industrial Holdings Corp | JP Morgan | 173 | (19.000) | Mitac Holdings Corp | JP Morgan | (726) |
| (2.000) | Lingsen Precision Industries Ltd | Citibank | (60) | 1.000 | momo.com Inc | JP Morgan | 4.411 |
| (2.000) | Lingsen Precision Industries Ltd | JP Morgan | (80) | (4.000) | Motech Industries Inc | JP Morgan | (246) |
| (27.000) | Lite-On Technology Corp | JP Morgan | (757) | (50.000) | Nan Kang Rubber Tire Co Ltd | Citibank | (3.110) |
| 10.000 | Longchen Paper & Packaging Co Ltd | Citibank | 194 | (3.000) | Nan Kang Rubber Tire Co Ltd | HSBC | (346) |
| (39.000) | Longchen Paper & Packaging Co Ltd | Citibank | (756) | (4.000) | Nan Kang Rubber Tire Co Ltd | JP Morgan | (449) |
| 14.000 | Longchen Paper & Packaging Co Ltd | JP Morgan | (418) | (16.000) | Nan Ya Plastics Corp | Citibank | (2.619) |
| (29.000) | Longchen Paper & Packaging Co Ltd | JP Morgan | 221 | 5.000 | Nanya Technology Corp | Citibank | 299 |
| 3.000 | Lotes Co Ltd | Citibank | 2.556 | 3.000 | Nanya Technology Corp | HSBC | 340 |
| 9.000 | Lotes Co Ltd | HSBC | 19.609 | 14.000 | Nanya Technology Corp | JP Morgan | 1.516 |
| 4.000 | Lotes Co Ltd | JP Morgan | 8.481 | (37.000) | Nichidenbo Corp | Citibank | (2.270) |
| (1.000) | Lotus Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | (21) | (23.000) | Nichidenbo Corp | JP Morgan | (2.119) |
| 3.000 | Lotus Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 64 | (7.000) | Novatek Microelectronics Corp | JP Morgan | (8.772) |
| (3.000) | Lotus Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | (1.484) | (14.000) | O-Bank Co Ltd | Citibank | (171) |
| 2.000 | Lotus Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | 989 | (32.000) | O-Bank Co Ltd | JP Morgan | (388) |
| (1.000) | Macauto Industrial Co Ltd | Citibank | (67) | (2.000) | Oneness Biotech Co Ltd | JP Morgan | (256) |
| 152.000 | Macronix International Co Ltd | Citibank | 5.182 | (2.000) | OptoTech Corp | JP Morgan | (720) |
| 4.000 | Macronix International Co Ltd | HSBC | 388 | 30.000 | Oriental Union Chemical Corp | Citibank | 713 |
| 97.000 | Macronix International Co Ltd | JP Morgan | 9.133 | (1.000) | O-TA Precision Industry Co Ltd | Citibank | (360) |
| 19.600 | Makalot Industrial Co Ltd | Citibank | 5.999 | (2.000) | O-TA Precision Industry Co Ltd | JP Morgan | (718) |
| 3.300 | Makalot Industrial Co Ltd | HSBC | 261 | (4.000) | Pan Jit International Inc | HSBC | (778) |
| 17.251 | Makalot Industrial Co Ltd | JP Morgan | 4.774 | (3.000) | Pan Jit International Inc | JP Morgan | (580) |
| (1.000) | Marketech International Corp | JP Morgan | (404) | (1.000) | Pan-International Industrial Corp | JP Morgan | (195) |
| 1.000 | MediaTek Inc | HSBC | 3.854 | 1.000 | Parade Technologies Ltd | Citibank | 1.717 |
| (2.000) | Medigen Vaccine Biologics Corp | Citibank | (208) | (1.000) | PChome Online Inc | JP Morgan | (262) |
| (52) | Medigen Vaccine Biologics Corp | Citibank | (6) | 1.000 | Pegatron Corp | Citibank | 193 |
| (4.000) | Medigen Vaccine Biologics Corp | JP Morgan | (1.084) | 13.000 | Pegatron Corp | JP Morgan | 778 |
| (78) | Medigen Vaccine Biologics Corp | JP Morgan | (9) | 5.000 | Pegavision Corp | Citibank | 9.124 |
| (2.000) | Mega Financial Holding Co Ltd | Citibank | (158) | 1.000 | Pegavision Corp | HSBC | 2.170 |
| (97.000) | Mega Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | (5.320) | 2.000 | Pegavision Corp | JP Morgan | 4.278 |
| | | | | 6.000 | PharmaEngine Inc | Citibank | (201) |
| | | | | 1.000 | PharmaEngine Inc | HSBC | (278) |
| | | | | 6.000 | PharmaEngine Inc | JP Morgan | (1.705) |
| | | | | 1.000 | PharmaEssentia Corp | JP Morgan | 271 |
| | | | | 7.000 | Phison Electronics Corp | Citibank | 3.689 |
| | | | | 3.000 | Phison Electronics Corp | HSBC | 2.712 |
| | | | | 9.000 | Phison Electronics Corp | JP Morgan | 7.871 |
| | | | | (4.000) | Pixart Imaging Inc | Citibank | (794) |
| | | | | (1.000) | Pixart Imaging Inc | JP Morgan | (257) |
| | | | | (39.000) | Pou Chen Corp | Citibank | (3.478) |
| | | | | 19.000 | Powertech Technology Inc | Citibank | 2.250 |
| | | | | 3.000 | Powertech Technology Inc | HSBC | 711 |
| | | | | 21.000 | Powertech Technology Inc | JP Morgan | 4.823 |
| | | | | (10.000) | President Chain Store Corp | HSBC | (5.175) |
| | | | | (5.000) | President Chain Store Corp | JP Morgan | (2.483) |
| | | | | (117.440) | President Securities Corp | Citibank | (929) |
| | | | | (377.640) | President Securities Corp | JP Morgan | 11.772 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--|-------------|---|---------------------------|--|-------------|---|
| Taiwan Fortsetzung | | | | Taiwan Fortsetzung | | | |
| 204.000 | Primax Electronics Ltd | Citibank | 21.122 | (13.000) | Sino-American Silicon Products Inc | JP Morgan | (11.128) |
| 42.000 | Primax Electronics Ltd | HSBC | 11.219 | 4.000 | Sino-American Silicon Products Inc | JP Morgan | 1.821 |
| 56.000 | Primax Electronics Ltd | JP Morgan | 14.544 | (1.000) | Solar Applied Materials Technology Corp | Citibank | (48) |
| (91.000) | Qisda Corp | Citibank | (5.987) | (19.000) | Solar Applied Materials Technology Corp | JP Morgan | (471) |
| (34.000) | Qisda Corp | JP Morgan | (1.101) | (1.000) | Sonix Technology Co Ltd | HSBC | (166) |
| 8.000 | Quanta Computer Inc | Citibank | 1.548 | (2.000) | Sonix Technology Co Ltd | JP Morgan | (320) |
| 2.000 | Quanta Computer Inc | HSBC | (222) | (1.000) | Speed Tech Corp | JP Morgan | (401) |
| 20.000 | Quanta Computer Inc | JP Morgan | (2.356) | (19.000) | Sunny Friend Environmental Technology Co Ltd | JP Morgan | 3.087 |
| (31.000) | Radiant Opto-Electronics Corp | Citibank | (2.765) | (45.000) | Sunplus Technology Co Ltd | Citibank | (2.823) |
| 4.000 | Radiant Opto-Electronics Corp | Citibank | 357 | (2.000) | Sunplus Technology Co Ltd | HSBC | (298) |
| 3.000 | Radiant Opto-Electronics Corp | HSBC | 516 | (14.000) | Sunplus Technology Co Ltd | JP Morgan | (1.879) |
| (4.000) | Radiant Opto-Electronics Corp | JP Morgan | (656) | (27.000) | Sunrex Technology Corp | Citibank | (2.250) |
| 7.000 | Radiant Opto-Electronics Corp | JP Morgan | 1.148 | (17.000) | Sunrex Technology Corp | JP Morgan | (1.804) |
| (3.000) | RDC Semiconductor Co Ltd | JP Morgan | (3.161) | (9.000) | Supreme Electronics Co Ltd (504) | JP Morgan | (570) |
| 2.000 | Realtek Semiconductor Corp | Citibank | 1.595 | (1.000) | Supreme Electronics Co Ltd (Pref) | JP Morgan | (24) |
| 4.000 | Realtek Semiconductor Corp | HSBC | 6.472 | (4.000) | Syncmold Enterprise Corp | Citibank | (33) |
| 6.000 | Realtek Semiconductor Corp | JP Morgan | 9.517 | (37.000) | Syncmold Enterprise Corp | JP Morgan | 159 |
| 82.000 | Roo Hsing Co Ltd | Citibank | (47) | (25.000) | Synnex Technology International Corp | Citibank | 2.322 |
| 5.000 | Roo Hsing Co Ltd | HSBC | 109 | (12.000) | Synnex Technology International Corp | HSBC | 2.555 |
| 8.000 | Roo Hsing Co Ltd | JP Morgan | 171 | (12.000) | Synnex Technology International Corp | JP Morgan | 1.297 |
| (70.376) | Ruentex Development Co Ltd | JP Morgan | (11.491) | (12.000) | T3EX Global Holdings Corp | Citibank | (4.751) |
| (3.000) | Ruentex Industries Ltd | HSBC | 380 | (1.000) | T3EX Global Holdings Corp | JP Morgan | (539) |
| (24.400) | Ruentex Industries Ltd | JP Morgan | 3.265 | 6.000 | TA Chen Stainless Pipe | Citibank | (94) |
| (1.000) | San Fu Chemical Co Ltd | HSBC | (1.215) | 6.000 | TA Chen Stainless Pipe | HSBC | 159 |
| (74.000) | Sanyang Motor Co Ltd | Citibank | (8.354) | 4.000 | TA Chen Stainless Pipe | JP Morgan | 92 |
| (121.000) | Sanyang Motor Co Ltd | JP Morgan | (20.021) | (21.000) | TA-I Technology Co Ltd | Citibank | (1.517) |
| (3.000) | SDI Corp | Citibank | (1.329) | (9.000) | TA-I Technology Co Ltd | JP Morgan | (1.170) |
| (3.000) | Sensortek Technology Corp | Citibank | (1.919) | 9.000 | TaiDoc Technology Corp | Citibank | 1.389 |
| 39.000 | Sercomm Corp | Citibank | 2.014 | 1.000 | TaiDoc Technology Corp | HSBC | 325 |
| 1.000 | Sercomm Corp | HSBC | 245 | 1.000 | TaiDoc Technology Corp | JP Morgan | (107) |
| 100.000 | Sercomm Corp | JP Morgan | 23.923 | (35.000) | Taiflex Scientific Co Ltd | Citibank | (1.500) |
| (18.000) | Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd | Citibank | (1.208) | (17.000) | Taiflex Scientific Co Ltd | JP Morgan | (2.389) |
| (170.000) | Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd | JP Morgan | (26.863) | 21.000 | Taigen Biopharmaceuticals Holdings Ltd | HSBC | 494 |
| (2.000) | Shih Wei Navigation Co Ltd | JP Morgan | (44) | (43.000) | Tainan Spinning Co Ltd | Citibank | (1.037) |
| 40.000 | Shin Kong Financial Holding Co Ltd | Citibank | 729 | (32.000) | Tainan Spinning Co Ltd | JP Morgan | (1.464) |
| 4.000 | Shin Kong Financial Holding Co Ltd | HSBC | 55 | (87.132) | Taishin Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | (1.487) |
| 273.000 | Shin Kong Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | 3.587 | 43.000 | TaiSol Electronics Co Ltd | Citibank | 3.644 |
| (17.000) | Shin Zu Shing Co Ltd | Citibank | (2.448) | 8.000 | TaiSol Electronics Co Ltd | HSBC | 1.052 |
| (7.000) | Shin Zu Shing Co Ltd | JP Morgan | (1.002) | 15.000 | TaiSol Electronics Co Ltd | JP Morgan | 1.923 |
| (33.000) | Shinkong Synthetic Fibers Corp | Citibank | (832) | (26.000) | Taita Chemical Co Ltd | Citibank | (1.101) |
| (15.000) | Shinkong Synthetic Fibers Corp | HSBC | (657) | (4.000) | Taita Chemical Co Ltd | JP Morgan | (198) |
| (130.000) | Shinkong Synthetic Fibers Corp | JP Morgan | (2.520) | (13.000) | TAI-TECH Advanced Electronics Co Ltd | Citibank | (1.841) |
| 5.000 | Simplo Technology Co Ltd | Citibank | 3.739 | 128.000 | Taiwan Business Bank | Citibank | 2.170 |
| 6.000 | Simplo Technology Co Ltd | HSBC | 3.478 | 1.408 | Taiwan Business Bank | HSBC | 45 |
| 16.000 | Simplo Technology Co Ltd | JP Morgan | 9.323 | 8.828 | Taiwan Business Bank | JP Morgan | 276 |
| (1.000) | Sinbon Electronics Co Ltd | Citibank | (78) | (137.000) | Taiwan Cement Corp | Citibank | (10.515) |
| (3.000) | Sinbon Electronics Co Ltd | JP Morgan | (1.706) | (157.000) | Taiwan Cement Corp | HSBC | 3.080 |
| (13.000) | Sino-American Silicon Products Inc | Citibank | (5.941) | (108.000) | Taiwan Cement Corp | JP Morgan | 2.492 |
| 4.000 | Sino-American Silicon Products Inc | Citibank | 1.828 | (4.000) | Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | (322) |
| 2.000 | Sino-American Silicon Products Inc | HSBC | 1.159 | 10.000 | Taiwan Fertilizer Co Ltd | Citibank | 517 |
| | | | | 28.000 | Taiwan Fertilizer Co Ltd | HSBC | 2.150 |
| | | | | (21.000) | Taiwan Fertilizer Co Ltd | JP Morgan | 155 |
| | | | | 6.000 | Taiwan Fertilizer Co Ltd | JP Morgan | 353 |
| | | | | (51.000) | Taiwan Glass Industry Corp | Citibank | (3.560) |
| | | | | (85.000) | Taiwan Glass Industry Corp | HSBC | (5.345) |
| | | | | (112.000) | Taiwan Glass Industry Corp | JP Morgan | (6.854) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return

Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|---|-------------|---|---------------------------|---|-------------|---|
| Taiwan Fortsetzung | | | | Taiwan Fortsetzung | | | |
| (14.000) | Taiwan High Speed Rail Corp | JP Morgan | (25) | (7.000) | Tung Thih Electronic Co Ltd | JP Morgan | (8.747) |
| 64.000 | Taiwan Hon Chuan Enterprise Co Ltd | Citibank | 6.118 | (25.000) | TXC Corp | Citibank | (4.884) |
| 1.000 | Taiwan Hon Chuan Enterprise Co Ltd | HSBC | 83 | (2.000) | TXC Corp | JP Morgan | (613) |
| 35.000 | Taiwan Hon Chuan Enterprise Co Ltd | JP Morgan | 2.703 | (13.000) | U-Ming Marine Transport Corp | Citibank | 479 |
| (35.000) | Taiwan Mask Corp | Citibank | (14.445) | (1.000) | U-Ming Marine Transport Corp | HSBC | 88 |
| (5.000) | Taiwan Mask Corp | HSBC | (3.706) | (15.000) | U-Ming Marine Transport Corp | JP Morgan | 1.330 |
| (6.000) | Taiwan Mask Corp | JP Morgan | (4.412) | 1.000 | Unimicron Technology Corp | Citibank | 132 |
| (6.000) | Taiwan Paiho Ltd | Citibank | (606) | 4.000 | Unimicron Technology Corp | HSBC | 1.330 |
| 1.000 | Taiwan Secom Co Ltd | JP Morgan | 219 | 8.000 | Unimicron Technology Corp | JP Morgan | 2.529 |
| 3.000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | Citibank | 4.404 | (50.000) | Union Bank Of Taiwan | Citibank | (1.020) |
| 5.000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | HSBC | 9.078 | (79.000) | Union Bank Of Taiwan | JP Morgan | (895) |
| 12.000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | JP Morgan | 21.300 | 1.000 | Uni-President Enterprises Corp | JP Morgan | 82 |
| 34.000 | Taiwan Styrene Monomer | Citibank | 600 | (10.000) | United Integrated Services Co Ltd | Citibank | (1.418) |
| 3.000 | Taiwan Styrene Monomer | HSBC | 45 | (2.000) | United Integrated Services Co Ltd | JP Morgan | (511) |
| 5.000 | Taiwan Styrene Monomer | JP Morgan | 69 | 9.000 | United Microelectronics Corp | Citibank | 654 |
| (10.000) | Taiwan TEA Corp | Citibank | (300) | 7.000 | United Microelectronics Corp | HSBC | 1.126 |
| (8.000) | Taiwan TEA Corp | JP Morgan | (358) | 1.000 | United Microelectronics Corp | JP Morgan | 157 |
| 21.000 | Taiwan Union Technology Corp | Citibank | 2.112 | 2.000 | Universal Vision Biotechnology Co Ltd | Citibank | 392 |
| 5.000 | Taiwan Union Technology Corp | HSBC | 710 | 2.000 | Universal Vision Biotechnology Co Ltd | HSBC | 2.318 |
| 1.000 | Taiwan Union Technology Corp | JP Morgan | 136 | 1.000 | Universal Vision Biotechnology Co Ltd | JP Morgan | 1.141 |
| (1.000) | Tatung Co Ltd | Citibank | (23) | 19.000 | Userjoy Technology Co Ltd | Citibank | 1.637 |
| (10.000) | Tatung Co Ltd | JP Morgan | (748) | 7.000 | Userjoy Technology Co Ltd | HSBC | 1.228 |
| (26.000) | TCI Co Ltd | Citibank | (9.856) | 11.350 | Userjoy Technology Co Ltd | JP Morgan | 1.922 |
| (2.000) | TCI Co Ltd | HSBC | (534) | (102.000) | USI Corp | Citibank | (1.800) |
| (3.000) | TCI Co Ltd | JP Morgan | (765) | (69.000) | USI Corp | JP Morgan | (3.551) |
| 14.000 | Test Research Inc | Citibank | 1.026 | (3.000) | UVAT Technology Co Ltd | Citibank | (275) |
| 8.000 | Test Research Inc | HSBC | 1.929 | 3.000 | Vanguard International Semiconductor Corp | Citibank | 273 |
| 36.000 | Test Research Inc | JP Morgan | 8.509 | 1.000 | Vanguard International Semiconductor Corp | HSBC | 342 |
| (103.000) | Ting Sin Co Ltd | Citibank | 381 | 24.000 | Vanguard International Semiconductor Corp | JP Morgan | 8.024 |
| 151.000 | Ton Yi Industrial Corp | Citibank | 1.698 | (2.000) | Viking Tech Corp | Citibank | (491) |
| 8.000 | Ton Yi Industrial Corp | HSBC | 365 | (17.000) | Wafer Works Corp | HSBC | (4.148) |
| 9.000 | Ton Yi Industrial Corp | JP Morgan | 400 | (51.000) | Walsin Lihwa Corp | Citibank | (15.093) |
| 4.000 | Tong Hsing Electronic Industries Ltd | Citibank | 1.588 | (97.000) | Walsin Lihwa Corp | JP Morgan | (30.610) |
| 3.000 | Tong Hsing Electronic Industries Ltd | JP Morgan | 2.811 | 33.000 | Wei Chuan Foods Corp | Citibank | 700 |
| 27.000 | Tong Yang Industry Co Ltd | Citibank | 1.753 | 9.000 | Wei Chuan Foods Corp | HSBC | (54) |
| 23.000 | Tong Yang Industry Co Ltd | HSBC | 2.305 | 41.000 | Wei Chuan Foods Corp | JP Morgan | (313) |
| 131.000 | Tong Yang Industry Co Ltd | JP Morgan | 35.722 | (27.000) | Weltrend Semiconductor | Citibank | (3.687) |
| 3.000 | Topco Scientific Co Ltd | JP Morgan | 1.092 | (1.000) | Win Semiconductors Corp | Citibank | (983) |
| 44.000 | Topoint Technology Co Ltd | Citibank | 1.569 | (2.000) | Win Semiconductors Corp | JP Morgan | (2.466) |
| 26.000 | Topoint Technology Co Ltd | HSBC | 1.890 | (15.000) | Winbond Electronics Corp | Citibank | (608) |
| 17.000 | Topoint Technology Co Ltd | JP Morgan | 1.192 | (18.000) | Winbond Electronics Corp | JP Morgan | (1.676) |
| (48.000) | Transcend Information Inc | Citibank | (3.367) | 9.000 | Wisdom Marine Lines Co Ltd | Citibank | 669 |
| (18.000) | Transcend Information Inc | JP Morgan | (1.476) | 1.000 | Wisdom Marine Lines Co Ltd | HSBC | (15) |
| (22.000) | Tripod Technology Corp | Citibank | (1.402) | 11.000 | Wisdom Marine Lines Co Ltd | JP Morgan | (255) |
| (10.000) | Tripod Technology Corp | HSBC | (770) | 125.000 | Wistron Corp | Citibank | 5.833 |
| (46.000) | Tripod Technology Corp | JP Morgan | (375) | 44.000 | Wistron Corp | HSBC | 2.086 |
| (79.000) | TSEC Corp | Citibank | (1.098) | 72.000 | Wistron Corp | JP Morgan | 3.258 |
| (5.000) | TSEC Corp | HSBC | 138 | (9.000) | Wistron NeWeb Corp | Citibank | (738) |
| (15.000) | TSEC Corp | JP Morgan | 196 | 1.000 | Wistron NeWeb Corp | Citibank | 82 |
| (5.000) | TSRC Corp | HSBC | (168) | 5.000 | Wistron NeWeb Corp | HSBC | 575 |
| (6.000) | TSRC Corp | JP Morgan | (187) | (9.000) | Wistron NeWeb Corp | JP Morgan | (991) |
| 8.000 | TTY Biopharm Co Ltd | Citibank | 625 | 8.000 | Wistron NeWeb Corp | JP Morgan | 881 |
| 4.000 | TTY Biopharm Co Ltd | HSBC | 192 | | | | |
| 9.000 | TTY Biopharm Co Ltd | JP Morgan | 612 | | | | |
| (13.000) | Tung Ho Steel Enterprise Corp | HSBC | (3.450) | | | | |
| (29.000) | Tung Ho Steel Enterprise Corp | JP Morgan | (6.351) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|-------------|---|
| Taiwan Fortsetzung | | | | Thailand Fortsetzung | | | |
| (54.000) | WPG Holdings Ltd | Citibank | 3.496 | 8.400 | Bumrungrad Hospital PCL | Citibank | (182) |
| (4.000) | WPG Holdings Ltd | JP Morgan | (134) | 700 | Bumrungrad Hospital PCL | HSBC | 283 |
| 118.000 | WT Microelectronics Co Ltd | Citibank | 17.702 | 4.400 | Bumrungrad Hospital PCL | JP Morgan | 1.616 |
| 18.000 | WT Microelectronics Co Ltd | HSBC | 6.041 | (2.900) | Carabao Group PCL 'F' | Citibank | (157) |
| 64.000 | WT Microelectronics Co Ltd | JP Morgan | 21.143 | (3.200) | Central Pattana PCL | Citibank | (109) |
| (3.000) | XinTec Inc | HSBC | (1.783) | (74.300) | Central Pattana PCL | HSBC | (9.105) |
| (17.000) | XinTec Inc | JP Morgan | (9.925) | (58.100) | Central Pattana PCL | JP Morgan | (6.303) |
| (5.401) | Yageo Corp | JP Morgan | (2.852) | (142.700) | Central Plaza Hotel PCL | Citibank | (6.020) |
| (1.000) | Yang Ming Marine Transport Corp | JP Morgan | (44) | (56.500) | Central Retail Corp PCL | Citibank | (29.674) |
| 26.000 | YC INOX Co Ltd | Citibank | 245 | (21.800) | Central Retail Corp PCL | JP Morgan | 233 |
| (2.000) | YC INOX Co Ltd | Citibank | (19) | (540.900) | CH Karnchang PCL | Citibank | (9.038) |
| 11.000 | YC INOX Co Ltd | HSBC | 340 | (142.000) | Charoen Pokphand Foods PCL | Citibank | (2.967) |
| 5.000 | YC INOX Co Ltd | JP Morgan | 142 | (2.600) | Charoen Pokphand Foods PCL | HSBC | (225) |
| (14.000) | YC INOX Co Ltd | JP Morgan | (399) | (50.200) | Charoen Pokphand Foods PCL | JP Morgan | (4.080) |
| (51.000) | YFY Inc | Citibank | (4.114) | (219.000) | CK Power PCL | Citibank | 1.010 |
| (77.000) | YFY Inc | JP Morgan | 2.980 | (5.500) | CK Power PCL | JP Morgan | (43) |
| (10.000) | Yieh Phui Enterprise Co Ltd | Citibank | (193) | (74.600) | CP ALL PCL | Citibank | (1.982) |
| (1.000) | Yieh Phui Enterprise Co Ltd | HSBC | (46) | (1.800) | CP ALL PCL | JP Morgan | (130) |
| (36.000) | Yieh Phui Enterprise Co Ltd | JP Morgan | (1.594) | (2.200) | Delta Electronics Thailand PCL | HSBC | (1.144) |
| (438.000) | Yuanta Financial Holding Co Ltd | Citibank | (14.036) | (134.600) | Esso Thailand PCL | Citibank | (2.504) |
| (54.000) | Yuanta Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | 179 | 371.100 | GFPT PCL | Citibank | 8.436 |
| (1.000) | Yulon Motor Co Ltd | Citibank | (110) | 8.200 | GFPT PCL | HSBC | 514 |
| (17.000) | Yulon Motor Co Ltd | JP Morgan | (3.870) | 74.300 | GFPT PCL | JP Morgan | 895 |
| (3.000) | ZongTai Real Estate Development Co Ltd | Citibank | (191) | 500 | Hana Microelectronics PCL | Citibank | 25 |
| (5.000) | ZongTai Real Estate Development Co Ltd | JP Morgan | (483) | (37.500) | Hana Microelectronics PCL | Citibank | (2.143) |
| | | | 184.647 | 4.500 | Hana Microelectronics PCL | JP Morgan | 480 |
| | | | | (900) | Hana Microelectronics PCL | JP Morgan | (3) |
| | | | | 230.100 | Home Product Center PCL | Citibank | 534 |
| | | | | 36.700 | Home Product Center PCL | HSBC | 712 |
| | | | | 74.800 | Home Product Center PCL | JP Morgan | 1.203 |
| | | | | 55.500 | Indorama Ventures PCL | Citibank | (111) |
| | | | | 42.700 | Indorama Ventures PCL | HSBC | 7.486 |
| | | | | 58.500 | Indorama Ventures PCL | JP Morgan | 9.664 |
| | | | | (33.500) | Intouch Holdings PCL 'F' | HSBC | (1.767) |
| | | | | (17.100) | Intouch Holdings PCL 'F' | JP Morgan | (494) |
| | | | | (374.800) | IRPC PCL | Citibank | (1.263) |
| | | | | (78.900) | IRPC PCL | JP Morgan | (120) |
| | | | | (634.200) | Italian-Thai Development PCL | Citibank | (1.619) |
| | | | | (22.800) | Italian-Thai Development PCL | JP Morgan | 115 |
| | | | | 95.700 | Jasmine International PCL | Citibank | 322 |
| | | | | 195.900 | Jasmine International PCL | HSBC | 1.134 |
| | | | | 203.700 | Jasmine International PCL | JP Morgan | 1.022 |
| | | | | (92.300) | KCE Electronics PCL | Citibank | (7.856) |
| | | | | (6.500) | KCE Electronics PCL | JP Morgan | (1.322) |
| | | | | 221.400 | Kiatnakin Phatra Bank PCL | Citibank | 10.633 |
| | | | | 190.200 | Kiatnakin Phatra Bank PCL | JP Morgan | 15.086 |
| | | | | (6.900) | Krung Thai Bank PCL | Citibank | (58) |
| | | | | 343.900 | Land & Houses PCL Reg | Citibank | 378 |
| | | | | 427.600 | Land & Houses PCL Reg | HSBC | 4.365 |
| | | | | 402.200 | Land & Houses PCL Reg | JP Morgan | 3.296 |
| | | | | (962.600) | LPN Development PCL | Citibank | (4.887) |
| | | | | (86.100) | Major Cineplex Group PCL | Citibank | (1.613) |
| | | | | (2.200) | Major Cineplex Group PCL | JP Morgan | (35) |
| | | | | 38.800 | Minor International PCL | Citibank | 796 |
| | | | | (400) | Minor International PCL | HSBC | (9) |
| | | | | (441) | Minor International PCL | HSBC | (10) |
| | | | | 10.619 | Minor International PCL | HSBC | 507 |
| | | | | (43) | Minor International PCL | JP Morgan | (2) |
| | | | | (48) | Minor International PCL | JP Morgan | (3) |
| | | | | 17.100 | Minor International PCL | JP Morgan | 684 |
| | | | | 80.769 | Ngern Tid Lor PCL | JP Morgan | (2.664) |
| | | | | 4.100 | Osotspa PCL | Citibank | (36) |
| | | | | 3.500 | Osotspa PCL | HSBC | 218 |
| | | | | 5.600 | Osotspa PCL | JP Morgan | 305 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------|---|---|---------------------------------------|-------------|---|
| Thailand Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 78.500 | Precious Shipping PCL | Citibank | (2.820) | 1.195 | Canaan Inc ADR | JP Morgan | 1.024 |
| 9.700 | Precious Shipping PCL | HSBC | 148 | 3.977 | Cango Inc ADR | Citibank | (2.704) |
| 93.700 | Precious Shipping PCL | JP Morgan | 1.008 | (760) | Chindata Group Holdings Ltd ADR | HSBC | (1.421) |
| (17.700) | PTT Global Chemical PCL | Citibank | (354) | (706) | Chindata Group Holdings Ltd ADR | JP Morgan | (1.320) |
| (44.900) | PTT Global Chemical PCL | JP Morgan | 759 | 1.743 | Cloopen Group Holding Ltd ADR | Citibank | 220 |
| (2.500) | PTT Oil & Retail Business PCL | Citibank | (70) | (3.292) | Coufang LLC 'A' | JP Morgan | (14.781) |
| (2.900) | PTT Oil & Retail Business PCL | HSBC | (236) | 302 | Dada Nexus Ltd ADR | JP Morgan | 368 |
| (218.800) | Quality Houses PCL | Citibank | 276 | (183) | Daqo New Energy Corp ADR | JP Morgan | (1.925) |
| (31.800) | Quality Houses PCL | JP Morgan | (81) | 420 | DiDi Global Inc ADR | HSBC | 208 |
| (91.200) | Regional Container Lines PCL | Citibank | (73.087) | 3.797 | DingDong Cayman Ltd ADR | Citibank | 1.933 |
| (16.900) | Regional Container Lines PCL | JP Morgan | (1.313) | 3.624 | DingDong Cayman Ltd ADR | JP Morgan | 752 |
| 146.000 | Rojana Industrial Park PCL | JP Morgan | 6.428 | (1.931) | Dr Reddy's Laboratories Ltd ADR | JP Morgan | (10.162) |
| 13.520 | RS PCL | Citibank | 3 | 1.924 | EQONEX Ltd | HSBC | (808) |
| 280 | RS PCL | HSBC | (3) | 148 | Fanhua Inc ADR | Citibank | (65) |
| 2.040 | RS PCL | JP Morgan | (25) | 2.026 | Fanhua Inc ADR | HSBC | — |
| (4.671.700) | Sansiri PCL | Citibank | (7.986) | 667 | Fanhua Inc ADR | JP Morgan | — |
| (137.100) | Sansiri PCL | JP Morgan | 64 | 320 | Full Truck Alliance Co Ltd ADR | JP Morgan | 239 |
| 9.000 | SCB X PCL | Citibank | (436) | (318) | Futu Holdings Ltd ADR | Citibank | (687) |
| 20.200 | SCB X PCL | JP Morgan | 2.663 | 2.204 | Genpact Ltd | JP Morgan | 9.499 |
| (1.700) | SCG Packaging PCL | Citibank | (71) | 9.315 | Grab Holdings Ltd 'A' | HSBC | (1.211) |
| (35.400) | Siam Cement PCL Reg | Citibank | (6.717) | 2.173 | Gracell Biotechnologies Inc ADR | Citibank | 304 |
| (6.900) | Siam Cement PCL Reg | JP Morgan | (2.271) | 838 | Gracell Biotechnologies Inc ADR | HSBC | 578 |
| (4.052) | Siam Makro PCL | Citibank | (83) | 839 | HDFC Bank Ltd ADR | Citibank | 3.104 |
| (182.050) | Sri Trang Agro-Industry PCL | Citibank | (5.678) | (7.534) | Himax Technologies Inc ADR | Citibank | (1.582) |
| (128.500) | Sri Trang Agro-Industry PCL | JP Morgan | (14.543) | 73 | Huazhu Group Ltd ADR | Citibank | 347 |
| (400) | Srisawad Corp PCL | Citibank | (55) | 984 | Huazhu Group Ltd ADR | HSBC | 4.560 |
| (1.600) | Srisawad Corp PCL | JP Morgan | (300) | 681 | Huazhu Group Ltd ADR | JP Morgan | 4.589 |
| 113.700 | Supalai PCL | Citibank | (759) | 568 | HUTCHMED China Ltd ADR | Citibank | 239 |
| 38.100 | Supalai PCL | HSBC | (181) | 919 | HUTCHMED China Ltd ADR | HSBC | 438 |
| 104.100 | Supalai PCL | JP Morgan | (995) | 691 | HUTCHMED China Ltd ADR | JP Morgan | 428 |
| 17.700 | Thai Union Group PCL 'F' | Citibank | 298 | 236 | HUYA Inc ADR | JP Morgan | 229 |
| 29.100 | Thai Union Group PCL 'F' | HSBC | 671 | 785 | I-Mab ADR | Citibank | (1.455) |
| 335.100 | Thai Union Group PCL 'F' | JP Morgan | 6.444 | 298 | I-Mab ADR | HSBC | (614) |
| (183.300) | Thai Vegetable Oil PCL | Citibank | (1.099) | 2.149 | I-Mab ADR | JP Morgan | (4.727) |
| 131.900 | Thanachart Capital PCL | Citibank | 4.611 | 618 | Infosys Ltd ADR | Citibank | (12) |
| 56.100 | Thanachart Capital PCL | JP Morgan | 1.863 | 1.290 | iQIYI Inc ADR | Citibank | 52 |
| (38.300) | Thoresen Thai Agencies PCL | Citibank | 464 | (1.444) | JinkoSolar Holding Co Ltd ADR | Citibank | (6.455) |
| 165.900 | Tisco Financial Group PCL | Citibank | 7.878 | (6) | JinkoSolar Holding Co Ltd ADR | HSBC | (87) |
| 177.900 | Tisco Financial Group PCL | JP Morgan | 14.618 | 495 | JOYY Inc ADR | JP Morgan | 3.091 |
| 385.800 | TMBThanachart Bank PCL | Citibank | 206 | 193 | Legend Biotech Corp ADR | HSBC | 1.751 |
| 3.858 | TMBThanachart Bank PCL | Citibank | 36 | 91 | Legend Biotech Corp ADR | JP Morgan | 825 |
| 1.841.000 | TMBThanachart Bank PCL | JP Morgan | (833) | (155) | Li Auto Inc ADR | HSBC | (925) |
| 18.410 | TMBThanachart Bank PCL | JP Morgan | 172 | (1.226) | Li Auto Inc ADR | JP Morgan | (7.319) |
| (1.512.000) | True Corp PCL | Citibank | 3.810 | (669) | MakeMyTrip Ltd | HSBC | (3.713) |
| (383.500) | TTW PCL | Citibank | 171 | (2.101) | MakeMyTrip Ltd | JP Morgan | (11.661) |
| (14.700) | TTW PCL | JP Morgan | (59) | 894 | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | JP Morgan | 840 |
| | | | (104.522) | 1.686 | MINISO Group Holding Ltd ADR | JP Morgan | 237 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | 2.968 | Missfresh Ltd ADR | Citibank | (145) |
| (1.422) | 360 DigiTech Inc ADR | HSBC | (3.726) | 1.877 | Missfresh Ltd ADR | HSBC | (246) |
| 497 | Atlas Corp Marshall Islands | Citibank | 179 | 10.896 | Missfresh Ltd ADR | JP Morgan | (1.426) |
| 1.123 | Atlas Corp Marshall Islands | HSBC | 517 | (43) | NetEase Inc ADR | HSBC | (390) |
| 94 | Autohome Inc ADR | HSBC | 894 | (358) | NetEase Inc ADR | JP Morgan | (3.881) |
| 408 | Azure Power Global Ltd | Citibank | 416 | 181 | Noah Holdings Ltd ADR | Citibank | 206 |
| 529 | Azure Power Global Ltd | HSBC | 1.243 | 254 | Noah Holdings Ltd ADR | HSBC | 470 |
| 500 | Azure Power Global Ltd | JP Morgan | 1.295 | 152 | PetroChina Co Ltd ADR | Citibank | 606 |
| 315 | Baozun Inc ADR | Citibank | 299 | 145 | PetroChina Co Ltd ADR | HSBC | 921 |
| 83 | BeiGene Ltd ADR | HSBC | 1.242 | | | | |
| 158 | BeiGene Ltd ADR | JP Morgan | 1.167 | | | | |
| 6.815 | Beyondspring Inc | Citibank | 68 | | | | |
| 2.047 | Beyondspring Inc | JP Morgan | (389) | | | | |
| (66.000) | Bosideng International Holdings Ltd | Citibank | (1.187) | | | | |
| 2.449 | Canaan Inc ADR | HSBC | 1.648 | | | | |
| (648) | Canaan Inc ADR | JP Morgan | (505) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|---------------------------------------|-------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 293 | PetroChina Co Ltd ADR | JP Morgan | 1.411 |
| 620 | Pinduoduo Inc ADR | Citibank | 6.423 |
| 615 | Pinduoduo Inc ADR | JP Morgan | 9.754 |
| (832) | ReneSola Ltd ADR | Citibank | (183) |
| (1.911) | ReneSola Ltd ADR | HSBC | (1.261) |
| (1.941) | ReneSola Ltd ADR | JP Morgan | (1.662) |
| (25) | Silicon Motion Technology Corp ADR | Citibank | (19) |
| (175) | Silicon Motion Technology Corp ADR | JP Morgan | 359 |
| 35 | TAL Education Group ADR | JP Morgan | 30 |
| (617) | TDCX Inc ADR | Citibank | 1.917 |
| (1.929) | TDCX Inc ADR | HSBC | 2.547 |
| (1.173) | TDCX Inc ADR | JP Morgan | 1.561 |
| 309 | Tencent Music Entertainment Group ADR | JP Morgan | 20 |
| 358 | Trip.com Group Ltd ADR | JP Morgan | 823 |
| 2.966 | Vnet Group Inc ADR | Citibank | 445 |
| 383 | Vnet Group Inc ADR | JP Morgan | (50) |
| 210 | WNS Holdings Ltd ADR | Citibank | 137 |
| 1.388 | WNS Holdings Ltd ADR | JP Morgan | (14) |
| (743) | XPeng Inc ADR | HSBC | (2.452) |
| (169) | XPeng Inc ADR | JP Morgan | (558) |
| 648 | Youdao Inc ADR | JP Morgan | (718) |
| (613) | Yum China Holdings Inc | HSBC | (3.530) |
| (515) | Yum China Holdings Inc | JP Morgan | (4.177) |
| (270) | ZTO Express Cayman Inc ADR | HSBC | (409) |
| (341) | ZTO Express Cayman Inc ADR | JP Morgan | (520) |
| | | | (28.629) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 162.024.112) | | | 10.106 |
| * Wertpapier unter Vorbehalt einer Anpassung an die beizulegenden Zeitwerte gemäß Anmerkung 2 (a). | | | |
| ** Beträge mit einem Wert unter EUR 0,5 wurden auf null abgerundet. | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Netto(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|---|---------------|---|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (32) | USD | MSCI China A 50 Connect Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 1.835.840 | (63.240) |
| Gesamt | | | | | (63.240) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 861.423 | USD | 913.283 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 10.075 |
| USD | 64.612 | EUR | 61.082 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (864) |
| | | | | | | 9.211 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 8.353.654 | USD | 10.334.272 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 182.155 |
| USD | 794.674 | GBP | 641.875 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (13.381) |
| | | | | | | 168.774 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 12.313.317) | | | | | | 177.985 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 74,88 |
| Staatsanleihen | 10,19 |
| Industrie | 4,73 |
| Zyklische Konsumgüter | 4,24 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 1,57 |
| Technologie | 0,90 |
| Grundstoffe | 0,66 |
| Kommunikation | 0,07 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 97,24 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 2,76 |
| | 100,00 |

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|-------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Frankreich Fortsetzung | | | |
| STAMMAKTIE | | | | 47.476 | Veolia Environnement SA | 1.236.275 | 0,11 |
| | | | | 13.138 | Worldline SA | 499.375 | 0,05 |
| | | | | 13.591.540 | | | |
| | | | | Deutschland | | | |
| | | | | 6.072 | Evonik Industries AG | 151.375 | 0,01 |
| | | | | 16.097 | Infineon Technologies AG | 465.847 | 0,04 |
| | | | | 61.061 | Nordex SE [^] | 671.366 | 0,06 |
| | | | | 2.162 | Rational AG | 1.308.010 | 0,11 |
| | | | | 4.321 | Siemens AG Reg | 529.063 | 0,05 |
| | | | | 15.006 | SMA Solar Technology AG [^] | 662.665 | 0,06 |
| | | | | 5.850 | Software AG | 185.796 | 0,02 |
| | | | | 21.792 | Symrise AG | 2.239.128 | 0,20 |
| | | | | 6.213.250 | | | |
| | | | | Irland | | | |
| | | | | 1.431 | Eaton Corp Plc | 185.145 | 0,02 |
| | | | | 14.946.720 | Greencoast Renewables Plc | 17.188.728 | 1,52 |
| | | | | 30.811 | Kingspan Group Plc (traded in Ireland) | 2.366.285 | 0,21 |
| | | | | 9.790 | Kingspan Group Plc (traded in United Kingdom) | 752.460 | 0,07 |
| | | | | 48.949 | Origin Enterprises Plc | 219.536 | 0,02 |
| | | | | 17.434 | Pentair Plc | 816.489 | 0,07 |
| | | | | 6.573 | Seagate Technology Holdings Plc | 519.520 | 0,04 |
| | | | | 19.821 | Smurfit Kappa Group Plc | 748.441 | 0,07 |
| | | | | 22.796.604 | | | |
| | | | | Israel | | | |
| | | | | 72.732 | ICL Group Ltd | 754.395 | 0,07 |
| | | | | 754.395 | | | |
| | | | | Italien | | | |
| | | | | 17.181 | Enel SpA | 103.842 | 0,01 |
| | | | | 65.186 | Terna Rete Elettrica Nazionale SpA | 514.317 | 0,04 |
| | | | | 618.159 | | | |
| | | | | Japan | | | |
| | | | | 219.800 | ENEOS Holdings Inc | 831.282 | 0,07 |
| | | | | 800 | Fujitsu Ltd | 112.299 | 0,01 |
| | | | | 17.000 | Idemitsu Kosan Co Ltd | 431.751 | 0,04 |
| | | | | 10.700 | Kubota Corp | 184.324 | 0,02 |
| | | | | 48.100 | Oji Holdings Corp [^] | 197.899 | 0,02 |
| | | | | 7.400 | Omron Corp | 398.752 | 0,03 |
| | | | | 59.800 | Renesas Electronics Corp | 661.306 | 0,06 |
| | | | | 12.600 | Sumitomo Forestry Co Ltd | 181.031 | 0,01 |
| | | | | 6.400 | Yaskawa Electric Corp [^] | 208.285 | 0,02 |
| | | | | 3.206.929 | | | |
| | | | | Niederlande | | | |
| | | | | 206 | Adyen NV | 298.123 | 0,03 |
| | | | | 14.396 | ASML Holding NV | 7.716.256 | 0,68 |
| | | | | 16.837 | CNH Industrial NV (traded in Italy) | 233.529 | 0,02 |
| | | | | 105.692 | CNH Industrial NV (traded in United States) | 1.473.029 | 0,13 |
| | | | | 5.650 | Corbion NV | 190.405 | 0,02 |
| | | | | 15.899 | Ferrari NV | 2.884.079 | 0,26 |
| | | | | 3.367 | Iveco Group NV | 19.950 | 0,00 |
| | | | | 3.326 | Koninklijke DSM NV | 523.180 | 0,05 |
| | | | | 6.491 | Koninklijke Philips NV [^] | 155.719 | 0,01 |
| | | | | 16.999 | Koninklijke Vopak NV [^] | 453.873 | 0,04 |
| | | | | 3.646 | NXP Semiconductors NV | 645.848 | 0,06 |
| | | | | 16.461 | STMicroelectronics NV | 612.102 | 0,05 |
| | | | | 15.206.093 | | | |
| | | | | Norwegen | | | |
| | | | | 25.484 | Equinor ASA | 912.520 | 0,08 |
| | | | | 45.982 | Leroy Seafood Group ASA | 336.743 | 0,03 |
| | | | | 48.946 | Mowi ASA | 1.189.324 | 0,11 |
| | | | | 1.189.324 | | | |
| | | | | Australien | | | |
| 90.579 | Costa Group Holdings Ltd | 192.277 | 0,02 | | | | |
| 223.836 | Santos Ltd | 1.229.091 | 0,11 | | | | |
| 12.908 | Woodside Energy Group Ltd | 257.236 | 0,02 | | | | |
| | | | | 1.678.604 | | | |
| | | | | Österreich | | | |
| 37.545 | ams-OSRAM AG [^] | 429.255 | 0,04 | | | | |
| 4.367 | ANDRITZ AG [^] | 188.305 | 0,02 | | | | |
| 10.790 | S&T AG | 172.424 | 0,01 | | | | |
| 2.488 | Verbund AG [^] | 230.513 | 0,02 | | | | |
| | | | | 1.020.497 | | | |
| | | | | Belgien | | | |
| 4.125 | Umicore SA [^] | 170.734 | 0,02 | | | | |
| | | | | 170.734 | | | |
| | | | | Bermuda | | | |
| 13.241 | Bunge Ltd | 1.462.474 | 0,13 | | | | |
| 51.000 | Digital China Holdings Ltd | 22.452 | 0,00 | | | | |
| | | | | 1.484.926 | | | |
| | | | | Brasilien | | | |
| 38.538 | Klabin SA (Unit) | 169.602 | 0,01 | | | | |
| 38.064 | SLC Agricola SA | 411.292 | 0,04 | | | | |
| 67.785 | Suzano SA | 714.408 | 0,06 | | | | |
| | | | | 1.295.302 | | | |
| | | | | Kanada | | | |
| 7.076 | Brookfield Infrastructure Corp 'A' [^] | 467.496 | 0,04 | | | | |
| 10.102 | Cameco Corp | 231.047 | 0,02 | | | | |
| 8.145 | Canfor Corp | 160.920 | 0,01 | | | | |
| 15.141 | Nutrien Ltd | 1.381.269 | 0,12 | | | | |
| 34.828 | Pembina Pipeline Corp | 1.310.898 | 0,12 | | | | |
| 8.644 | Sierra Wireless Inc | 179.053 | 0,02 | | | | |
| 121.089 | Western Forest Products Inc | 168.009 | 0,02 | | | | |
| | | | | 3.898.692 | | | |
| | | | | Kaimaninseln | | | |
| 4.176 | Ambarella Inc | 332.209 | 0,03 | | | | |
| | | | | 332.209 | | | |
| | | | | Curaçao | | | |
| 51.300 | Schlumberger NV | 2.200.932 | 0,19 | | | | |
| | | | | 2.200.932 | | | |
| | | | | Dänemark | | | |
| 51.253 | Novo Nordisk A/S 'B' | 5.288.724 | 0,47 | | | | |
| 3.599 | Novozymes A/S 'B' [^] | 212.802 | 0,02 | | | | |
| 5.541 | Orsted A/S | 584.057 | 0,05 | | | | |
| 2.104 | ROCKWOOL A/S 'B' | 545.671 | 0,05 | | | | |
| 25.718 | Vestas Wind Systems A/S | 612.065 | 0,05 | | | | |
| | | | | 7.243.319 | | | |
| | | | | Finnland | | | |
| 40.270 | Kone Oyj 'B' | 1.912.020 | 0,17 | | | | |
| 34.774 | Neste Oyj | 1.485.197 | 0,13 | | | | |
| 49.633 | Stora Enso Oyj 'R' | 894.138 | 0,08 | | | | |
| 27.544 | UPM-Kymmene Oyj | 908.677 | 0,08 | | | | |
| | | | | 5.200.032 | | | |
| | | | | Frankreich | | | |
| 2.362 | Hermes International | 2.621.820 | 0,23 | | | | |
| 7.643 | L'Oreal SA | 2.511.108 | 0,22 | | | | |
| 7.257 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 4.333.880 | 0,38 | | | | |
| 5.267 | Sartorius Stedim Biotech | 1.691.234 | 0,15 | | | | |
| 5.408 | Schneider Electric SE | 697.848 | 0,06 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------------------|--|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| Norwegen Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 21.504 | Nordic Semiconductor ASA | 393.010 | 0,03 | 666 | Alphabet Inc 'A' | 1.414.525 | 0,13 |
| 17.496 | Norway Royal Salmon ASA | 441.287 | 0,04 | 411 | Amazon.com Inc | 922.401 | 0,08 |
| 5.050 | Salmar ASA | 349.020 | 0,03 | 3.659 | Ameresco Inc 'A' | 200.566 | 0,02 |
| 43.206 | TOMRA Systems ASA | 820.058 | 0,07 | 5.858 | American Water Works Co Inc | 827.092 | 0,07 |
| | | 4.441.962 | 0,39 | 8.183 | Analog Devices Inc | 1.286.364 | 0,11 |
| Portugal | | | | 8.296 | ANSYS Inc | 2.016.286 | 0,18 |
| 39.454 | Galp Energia SGPS SA | 483.706 | 0,04 | 12.780 | Apple Inc | 1.775.660 | 0,16 |
| | | 483.706 | 0,04 | 17.321 | Archer-Daniels-Midland Co | 1.468.465 | 0,13 |
| Südkorea | | | | 5.410 | Arista Networks Inc | 516.532 | 0,05 |
| 174 | Samsung Electronics Co Ltd GDR [^] | 217.896 | 0,02 | 1.845 | Aspen Technology Inc | 333.245 | 0,03 |
| | | 217.896 | 0,02 | 2.120 | Badger Meter Inc | 156.618 | 0,01 |
| Spanien | | | | 2.468 | Block Inc | 201.610 | 0,02 |
| 15.754 | EDP Renovaveis SA | 359.821 | 0,03 | 8.610 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | 690.086 | 0,06 |
| 12.238 | Iberdrola SA | 135.046 | 0,01 | 2.476 | Broadcom Inc | 1.340.865 | 0,12 |
| 30.885 | Siemens Gamesa Renewable Energy SA | 554.695 | 0,05 | 4.784 | Cadence Design Systems Inc | 686.529 | 0,06 |
| | | 1.049.562 | 0,09 | 9.064 | California Water Service Group | 454.110 | 0,04 |
| Schweden | | | | 23.628 | CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT) | 260.046 | 0,02 |
| 106.037 | Assa Abloy AB 'B' | 2.430.182 | 0,22 | 13.781 | CECO Environmental Corp | 80.531 | 0,01 |
| 245.680 | Hexagon AB 'B' | 2.787.147 | 0,25 | 6.621 | CEVA Inc | 222.935 | 0,02 |
| 17.488 | Holmen AB 'B' | 836.295 | 0,07 | 11.257 | Cheniere Energy Inc | 1.437.218 | 0,13 |
| 6.055 | Lundin Energy AB [^] | 273.265 | 0,02 | 26.363 | Cisco Systems Inc | 1.108.661 | 0,10 |
| 134.601 | Nibe Industrier AB 'B' | 1.092.914 | 0,10 | 74.114 | CommScope Holding Co Inc | 519.576 | 0,05 |
| 65.201 | Svenska Cellulosa AB SCA 'B' | 1.100.190 | 0,10 | 100.375 | Conduent Inc | 496.604 | 0,04 |
| 34.302 | Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | 259.178 | 0,02 | 28.012 | Corteva Inc | 1.637.444 | 0,15 |
| | | 8.779.171 | 0,78 | 9.773 | Curtiss-Wright Corp [^] | 1.295.282 | 0,11 |
| Schweiz | | | | 2.433 | Darling Ingredients Inc | 181.853 | 0,02 |
| 20.528 | ABB Ltd Reg | 587.344 | 0,05 | 7.489 | Deere & Co | 2.501.204 | 0,22 |
| 4.694 | Lonza Group AG Reg | 2.638.541 | 0,23 | 259 | Dexcom Inc | 72.034 | 0,01 |
| 27.750 | Nestle SA Reg | 3.161.865 | 0,28 | 6.598 | Digi International Inc | 136.117 | 0,01 |
| 58 | SGS SA Reg | 134.431 | 0,01 | 18.594 | Donaldson Co Inc | 907.439 | 0,08 |
| 36.193 | SIG Combibloc Group AG [^] | 738.067 | 0,07 | 1.352 | Dover Corp | 169.005 | 0,02 |
| 1.904 | TE Connectivity Ltd | 229.973 | 0,02 | 4.734 | Ecolab Inc | 724.341 | 0,06 |
| 639 | VAT Group AG | 176.856 | 0,02 | 2.928 | Emerson Electric Co | 242.330 | 0,02 |
| | | 7.667.077 | 0,68 | 2.085 | EnerSys | 131.805 | 0,01 |
| Taiwan | | | | 21.214 | EOG Resources Inc | 2.712.224 | 0,24 |
| 5.739 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 510.550 | 0,05 | 21.923 | Essential Utilities Inc | 946.705 | 0,08 |
| | | 510.550 | 0,05 | 39.122 | Evoqua Water Technologies Corp | 1.299.745 | 0,12 |
| Großbritannien | | | | 2.842 | F5 Inc | 432.541 | 0,04 |
| 332.750 | Auto Trader Group Plc | 2.308.121 | 0,20 | 1.400 | Fair Isaac Corp | 535.235 | 0,05 |
| 104.091 | Biffa Plc | 393.588 | 0,03 | 10.694 | First Solar Inc [^] | 704.881 | 0,06 |
| 778.040 | BP Plc | 3.974.887 | 0,35 | 2.066 | Fortinet Inc | 567.275 | 0,05 |
| 4.728 | Halma Plc | 123.986 | 0,01 | 2.430 | General Electric Co | 177.591 | 0,02 |
| 21.223 | Johnson Matthey Plc | 526.832 | 0,05 | 1.321 | Global Water Resources Inc | 17.683 | 0,00 |
| 48.594 | London Stock Exchange Group Plc | 4.231.699 | 0,37 | 55.540 | Graphic Packaging Holding Co | 1.154.091 | 0,10 |
| 7.850 | Pennon Group Plc [^] | 92.446 | 0,01 | 23.428 | Hain Celestial Group Inc | 576.269 | 0,05 |
| 62.257 | RELX Plc | 1.667.030 | 0,15 | 69.906 | Halliburton Co | 2.642.888 | 0,23 |
| 25.163 | Spirax-Sarco Engineering Plc | 3.127.627 | 0,28 | 3.871 | Hershey Co | 765.022 | 0,07 |
| 70.820 | Spirent Communications Plc | 193.298 | 0,02 | 25.662 | Hexcel Corp [^] | 1.376.226 | 0,12 |
| 9.006 | SSE Plc | 187.750 | 0,02 | 41.629 | Howmet Aerospace Inc | 1.390.030 | 0,12 |
| 13.758 | United Utilities Group Plc | 171.248 | 0,02 | 17.047 | Intel Corp | 706.864 | 0,06 |
| | | 16.998.512 | 1,51 | 7.438 | International Business Machines Corp | 964.007 | 0,09 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | 1.577 | Intuit Inc | 610.132 | 0,05 |
| 2.884 | A O Smith Corp | 161.854 | 0,01 | 20.327 | Juniper Networks Inc | 582.154 | 0,05 |
| 18.338 | A10 Networks Inc | 263.793 | 0,02 | 34.516 | Kaman Corp | 1.166.697 | 0,10 |
| 32.460 | AAR Corp [^] | 1.461.117 | 0,13 | 118.420 | Kinder Morgan Inc | 2.176.607 | 0,19 |
| 1.684 | Adobe Inc | 654.705 | 0,06 | 5.574 | Lindsay Corp | 655.612 | 0,06 |
| 14.910 | Advanced Micro Devices Inc | 1.417.720 | 0,13 | 8.152 | Marvell Technology Inc | 450.120 | 0,04 |
| 3.420 | AECOM | 222.998 | 0,02 | 2.526 | Masimo Corp | 331.133 | 0,03 |
| 15.563 | AeroVironment Inc [^] | 1.335.985 | 0,12 | 2.971 | MasTec Inc | 231.828 | 0,02 |
| 12.781 | AGCO Corp | 1.528.709 | 0,14 | 10.999 | Mastercard Inc 'A' | 3.674.411 | 0,33 |
| | | | | 41.820 | Maxar Technologies Inc [^] | 1.165.690 | 0,10 |
| | | | | 4.385 | Meta Platforms Inc 'A' | 792.636 | 0,07 |
| | | | | 9.498 | Microchip Technology Inc | 644.135 | 0,06 |
| | | | | 10.423 | Micron Technology Inc | 718.445 | 0,06 |
| | | | | 8.259 | Microsoft Corp | 2.096.032 | 0,19 |
| | | | | 23.972 | Mosaic Co | 1.401.957 | 0,12 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Jersey | | | |
| 6.336 | NetApp Inc | 425.554 | 0,04 | EUR 16.261.248 | Blackstone Loan Financing Ltd | 12.277.242 | 1,09 |
| 5.356 | NVIDIA Corp | 933.557 | 0,08 | GBP 18.065.000 | Foresight Solar Fund Ltd | 25.248.611 | 2,24 |
| 7.143 | Occidental Petroleum Corp | 462.153 | 0,04 | | | 37.525.853 | 3,33 |
| 5.526 | ON Semiconductor Corp | 313.015 | 0,03 | Großbritannien | | | |
| 10.260 | Oracle Corp | 688.821 | 0,06 | GBP 1.055.354 | BlackRock Frontiers Investment Trust Plc [~] | 1.607.870 | 0,14 |
| 5.459 | Packaging Corp of America | 801.486 | 0,07 | GBP 4.582.376 | Schroder UK Public Private | 1.212.987 | 0,11 |
| 1.414 | Palo Alto Networks Inc | 663.646 | 0,06 | GBP 2.252.650 | Scottish Mortgage Investment Trust Plc | 21.376.422 | 1,89 |
| 6.369 | Pioneer Natural Resources Co | 1.652.462 | 0,15 | | | 24.197.279 | 2,14 |
| 4.927 | PTC Inc | 535.956 | 0,05 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | | |
| 4.241 | Qorvo Inc | 442.410 | 0,04 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| 5.388 | QUALCOMM Inc | 720.345 | 0,06 | | | 158.917.285 | 14,08 |
| 2.416 | Quanta Services Inc [^] | 268.382 | 0,02 | Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| 31.395 | Rambus Inc | 735.603 | 0,07 | OPTIONSSCHEINE | | | |
| 18.764 | Rayonier Inc (REIT) [^] | 722.009 | 0,06 | Frankreich | | | |
| 9.724 | Republic Services Inc | 1.214.899 | 0,11 | 10.931 | Fermentalg (Wts 15/12/2023) | — | 0,00 |
| 22.273 | Resideo Technologies Inc | 491.098 | 0,04 | | | — | 0,00 |
| 890 | Rockwell Automation Inc | 177.128 | 0,02 | Gesamt Optionsscheine | | | |
| 7.944 | S&P Global Inc [^] | 2.591.617 | 0,23 | Gesamt sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| 39.930 | Sabre Corp | 279.929 | 0,02 | | | 0 | 0,00 |
| 3.491 | salesforce.com Inc | 522.192 | 0,05 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| 4.730 | Silicon Laboratories Inc | 658.602 | 0,06 | Luxemburg | | | |
| 4.347 | Skyworks Solutions Inc | 441.781 | 0,04 | 2.438.000 | BlackRock Global Funds - Emerging Markets Equity Income Fund X2 (USD) [~] | 37.870.080 | 3,35 |
| 1.916 | Splunk Inc | 183.435 | 0,02 | 4.667.920 | BlackRock Global Funds - Euro Corporate Bond Fund X2 (EUR) [~] | 84.769.427 | 7,51 |
| 10.901 | Sunrun Inc | 265.796 | 0,02 | 1.494.747 | BlackRock Global Funds - Euro Short Duration Bond Fund X2 (EUR) [~] | 25.126.697 | 2,23 |
| 8.611 | Tetra Tech Inc | 1.084.926 | 0,10 | 10.899.265 | BlackRock Global Funds - Global Corporate Bond Fund X2 (EUR) Hedged [~] | 151.717.769 | 13,44 |
| 3.597 | Texas Instruments Inc | 593.518 | 0,05 | 1.607.019 | BlackRock Global Funds - Global High Yield Bond Fund I2 (EUR) Hedged (Acc) [~] | 16.809.419 | 1,49 |
| 14.964 | Trimble Inc | 950.572 | 0,08 | 189.640 | BlackRock Strategic Funds - BlackRock Systematic ESG World Equity Fund X2 (GBP) [~] | 54.342.150 | 4,81 |
| 59.007 | Triumph Group Inc | 842.760 | 0,07 | 56.373 | Schroder ISF Frontier Markets Equity 'I' | 11.781.950 | 1,04 |
| 39.439 | Vectrus Inc | 1.318.745 | 0,12 | | | 382.417.492 | 33,87 |
| 45.745 | Velodyne Lidar Inc | 72.167 | 0,01 | Irland | | | |
| 19.682 | VeriSign Inc | 3.206.995 | 0,28 | 1.901.748 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc) [~] | 186.834.163 | 16,55 |
| 3.542 | Visa Inc 'A' [^] | 701.523 | 0,06 | 150.241 | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund (Dist) [~] | 17.671.778 | 1,56 |
| 6.552 | Vivint Smart Home Inc | 36.453 | 0,00 | 432.426 | BlackRock ICS Ultra Short Bond Fund (Acc) [~] | 47.348.170 | 4,19 |
| 4.575 | VMware Inc 'A' | 547.078 | 0,05 | | | | |
| 71.389 | Vuzix Corp [^] | 433.166 | 0,04 | | | | |
| 1.319 | Waste Management Inc | 195.169 | 0,02 | | | | |
| 8.513 | Watts Water Technologies Inc 'A' | 1.039.679 | 0,09 | | | | |
| 23.437 | Westrock Co | 1.060.873 | 0,09 | | | | |
| 26.067 | Weyerhaeuser Co (REIT) | 961.650 | 0,09 | | | | |
| 33.713 | Williams Cos Inc | 1.166.305 | 0,10 | | | | |
| 10.365 | Xylem Inc | 815.170 | 0,07 | | | | |
| 1.350 | Zebra Technologies Corp 'A' | 426.190 | 0,04 | | | | |
| | | 98.773.941 | 8,75 | | | | |
| Gesamt Stammaktien | | 225.834.594 | 20,00 | | | | |
| BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | | | | | |
| Guernsey | | | | | | | |
| GBP 17.093.271 | Bluefield Solar Income Fund Ltd | 26.142.770 | 2,31 | | | | |
| USD 5.475.882 | Schiehallion Fund Ltd 'C' | 4.140.457 | 0,37 | | | | |
| GBP 982.098 | SME Credit Realisation Fund Ltd | 1.097.644 | 0,10 | | | | |
| GBP 4.164.849 | Starwood European Real Estate Finance Ltd | 4.654.853 | 0,41 | | | | |
| | | 36.035.724 | 3,19 | | | | |
| Irland | | | | | | | |
| EUR 152.122 | iShares EUR High Yield Corp Bond UCITS ETF ^{-^} | 14.074.327 | 1,25 | | | | |
| EUR 1.990.000 | iShares EUR Ultrashort Bond ESG UCITS ETF 'D' [~] | 9.935.871 | 0,88 | | | | |
| USD 661.805 | iShares Physical Gold ETC [~] | 22.173.945 | 1,96 | | | | |
| USD 169.964 | iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF (Dist) ^{-^} | 14.974.286 | 1,33 | | | | |
| | | 61.158.429 | 5,42 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|
| Irland Fortsetzung | | | |
| 104.926 | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Dist)* | 9.795.587 | 0,87 |
| 1.435.860 | iShares Developed World Index Fund (Acc)* | 54.621.550 | 4,84 |
| | | 316.271.248 | 28,01 |
| Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 698.688.740 | 61,88 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 1.083.440.619 | 95,96 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 45.555.212 | 4,04 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 1.128.995.831 | 100,00 |

^ Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier.
* Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9.

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|---|----------------|---|----------------------------------|--------------------|---|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| ILS | EUR 1.632.000 | Fund receives Fixed 2,495% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Goldman Sachs | 15/4/2052 | 23.266 | 23.266 |
| ILS | EUR 1.182.028 | Fund receives Fixed 2,508% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Goldman Sachs | 15/4/2052 | 22.204 | 22.204 |
| ILS | EUR 1.652.000 | Fund receives Fixed 2,535% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Goldman Sachs | 15/4/2052 | 47.583 | 47.583 |
| ILS | EUR 1.520.000 | Fund receives Fixed 2,580% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Goldman Sachs | 15/3/2052 | 47.770 | 47.770 |
| ILS | EUR 2.632.560 | Fund receives Fixed 2,560% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | UBS | 15/4/2052 | 99.982 | 99.982 |
| ILS | EUR 3.300.000 | Fund receives Fixed 2,585% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | UBS | 15/4/2052 | 155.825 | 155.825 |
| TRS | USD 12.434.614 | Fund receives US Rates Vol Strategy Index and pays Fixed 0,300% | Bank of America Merrill Lynch | 12/10/2022 | 52.194 | 52.194 |
| TRS | USD 7.510.998 | Fund receives Volatility Carry Strategy Index and pays Fixed 0,530% | Barclays Bank | 18/11/2022 | 30.957 | 30.957 |
| TRS | USD 7.296.426 | Fund receives Volatility Carry Strategy Index and pays Fixed 0,530% | Barclays Bank | 18/11/2022 | 30.073 | 30.073 |
| TRS | USD 6.652.571 | Fund receives Volatility Carry Strategy Index and pays Fixed 0,530% | Barclays Bank | 18/11/2022 | 27.419 | 27.419 |
| TRS | USD 46.201.745 | Fund receives Global Brands Basket Index and pays 12 Month SOFR | Citibank | 2/9/2022 | (6.003.419) | (6.003.419) |
| TRS | USD 13.163.820 | Fund receives GS LCTR Agriculture Basket Index and pays 3 Month SOFR | Goldman Sachs | 11/4/2023 | (441.881) | (441.881) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 81.169.861) | | | | | (5.908.027) | (5.908.027) |

ILS: Inflationsgebundene Swaps
TRS: Gesamtertrag-Swaps

| Anzahl der Kontrakte | Vertrags- währung | Kontrakte/ Bezeichnung | Verfalls- datum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|-------------------------------------|----------------------|--|--------------------|--|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| 209 | AUD | Australian 10 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 17.104.933 | (1.257.443) |
| 177 | USD | E-mini Consumer Staples Select Sector Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 12.337.541 | 547.234 |
| 103 | USD | E-Mini Health Care Select Sector Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 12.813.826 | 347.099 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|---------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (135) | USD | E-mini Industrial Select Sector Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 11.989.639 | 380.080 |
| (207) | USD | E-Mini S&P 500 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 39.914.531 | (660.671) |
| 198 | USD | E-mini Utilities Select Sector Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 13.834.587 | 815.289 |
| 145 | EUR | Euro Bund Futures June 2022 | Juni 2022 | 21.977.650 | (2.218.500) |
| (2.178) | EUR | EURO STOXX 50 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 82.415.520 | (1.282.808) |
| (218) | GBP | FTSE 100 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 19.454.666 | (1.332.906) |
| (152) | USD | Materials Select Sector Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 12.869.453 | (607.291) |
| (456) | USD | MSCI Emerging Markets Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 22.630.798 | 4.966 |
| Gesamt | | | | | (5.264.951) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|---------------|---------|----------------|-------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 23.600.000 | GBP | 20.071.800 | Deutsche Bank | 27/7/2022 | 41.384 |
| EUR | 101.500.000 | GBP | 85.079.838 | Toronto Dominion Bank | 27/7/2022 | 1.640.335 |
| EUR | 28.800.000 | SEK | 300.121.920 | JP Morgan | 27/7/2022 | 198.784 |
| EUR | 252.994.000 | USD | 276.037.705 | Toronto Dominion Bank | 27/7/2022 | (3.934.884) |
| JPY | 1.553.193.600 | GBP | 9.600.000 | BNP Paribas | 27/7/2022 | (3.800) |
| SGD | 54.389.200 | USD | 40.000.000 | HSBC | 27/7/2022 | (306.027) |
| USD | 17.500.000 | JPY | 2.189.402.250 | Royal Bank of Canada | 27/7/2022 | 410.835 |
| USD | 13.360.000 | KRW | 16.449.232.800 | HSBC | 27/7/2022 | 101.687 |
| USD | 23.800.000 | MXN | 488.267.710 | Morgan Stanley | 27/7/2022 | (656.119) |
| USD | 40.000.000 | SGD | 54.514.000 | Morgan Stanley | 27/7/2022 | 221.300 |
| USD | 69.600.000 | TWD | 2.016.312.000 | Standard Chartered Bank | 27/7/2022 | (342.732) |
| | | | | | | (2.629.237) |

| Auf CAD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|---|-------|-----|-------|-----------------------------------|-----------|-----|
| CAD | 8.757 | EUR | 6.438 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 21 |
| EUR | 131 | CAD | 180 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (2) |
| | | | | | | 19 |

| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|---|---------------|-----|-------------|-----------------------------------|-----------|--------|
| EUR | 1.301.249 | JPY | 179.226.945 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 928 |
| JPY | 4.383.274.555 | EUR | 31.776.159 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 25.211 |
| | | | | | | 26.139 |

| Auf SEK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|---|-------------|-----|------------|-----------------------------------|-----------|---------|
| EUR | 832.533 | SEK | 8.775.574 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (4.569) |
| SEK | 174.855.304 | EUR | 16.682.932 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (3.487) |
| | | | | | | (8.056) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|-------|---------|----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 104 | USD | 109 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 2 |
| USD | 5.541 | EUR | 5.226 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (57) |
| | | | | | | (55) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 862.309.091) | | | | | | (2.611.190) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 70,54 |
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 5,42 |
| Industrie | 4,41 |
| Technologie | 3,45 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 2,97 |
| Energie | 2,53 |
| Finanzen | 2,45 |
| Kommunikation | 1,29 |
| Grundstoffe | 1,26 |
| Zyklische Konsumgüter | 1,07 |
| Versorger | 0,57 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 95,96 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 4,04 |
| <hr/> | |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in GBP | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in GBP | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|---------------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | | | |
| STAMMAKTIE | | | | | | | |
| Jersey | | | | | | | |
| 6.153.434 | Breedon Group Plc | 4.375.091 | 0,73 | | | | |
| | | 4.375.091 | 0,73 | | | | |
| Großbritannien | | | | | | | |
| 575.087 | CVS Group Plc | 10.242.299 | 1,71 | | | | |
| 345.460 | Ergomed Plc | 3.910.607 | 0,65 | | | | |
| 1.391.380 | Gamma Communications Plc | 16.724.388 | 2,79 | | | | |
| 500.400 | GB Group Plc | 2.777.220 | 0,47 | | | | |
| 392.825 | Impax Asset Management Group Plc | 3.189.739 | 0,53 | | | | |
| 2.547.423 | Learning Technologies Group Plc | 3.385.525 | 0,57 | | | | |
| 33.742 | London Stock Exchange Group Plc | 2.510.405 | 0,42 | | | | |
| 14.195.342 | SigmaRoc Plc | 9.289.432 | 1,55 | | | | |
| 195.403 | Watches of Switzerland Group Plc | 1.873.915 | 0,31 | | | | |
| 425.323 | YouGov Plc | 5.473.907 | 0,91 | | | | |
| | | 59.377.437 | 9,91 | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | | |
| 2.925.201 | Boku Inc | 3.115.339 | 0,52 | | | | |
| 45.988 | Microsoft Corp | 9.894.229 | 1,65 | | | | |
| 53.551 | Nasdaq Inc | 6.596.355 | 1,10 | | | | |
| 29.503 | Qualtrics International Inc 'A' | 336.769 | 0,05 | | | | |
| | | 19.942.692 | 3,32 | | | | |
| Gesamt Stammaktien | | 83.695.220 | 13,96 | | | | |
| EINLAGENZERTIFIKATE | | | | | | | |
| Belgien | | | | | | | |
| GBP 38.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp 5/7/2022 (Zero Coupon) | 37.957.299 | 6,33 | | | | |
| | | 37.957.299 | 6,33 | | | | |
| Finnland | | | | | | | |
| GBP 2.000.000 | Nordea Bank Abp 23/8/2022 (Zero Coupon) | 1.993.994 | 0,33 | | | | |
| | | 1.993.994 | 0,33 | | | | |
| Japan | | | | | | | |
| GBP 15.000.000 | Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp 6/7/2022 (Zero Coupon) | 14.983.034 | 2,50 | | | | |
| GBP 8.000.000 | Mizuho Bank Ltd FRN 17/6/2022 | 8.000.000 | 1,34 | | | | |
| GBP 5.000.000 | Mizuho Bank Ltd FRN 1/7/2022 | 5.000.000 | 0,84 | | | | |
| GBP 6.000.000 | Norinchukin Bank 6/6/2022 (Zero Coupon) | 5.998.804 | 1,00 | | | | |
| GBP 21.000.000 | Norinchukin Bank 9/6/2022 (Zero Coupon) | 20.994.024 | 3,50 | | | | |
| GBP 6.000.000 | Norinchukin Bank 24/6/2022 (Zero Coupon) | 5.995.733 | 1,00 | | | | |
| GBP 19.000.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 10/8/2022 (Zero Coupon) | 18.953.079 | 3,16 | | | | |
| | | 79.924.674 | 13,34 | | | | |
| Niederlande | | | | | | | |
| GBP 9.000.000 | ABN Amro Bank NV FRN 9/8/2022 | 9.000.980 | 1,50 | | | | |
| GBP 10.000.000 | ABN Amro Bank NV FRN 10/8/2022 | 10.000.948 | 1,67 | | | | |
| | | 19.001.928 | 3,17 | | | | |
| | | | | Großbritannien | | | |
| GBP 27.000.000 | National Australia Bank Ltd FRN 6/6/2022 | 27.000.000 | 4,51 | | | | |
| GBP 5.000.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd FRN 11/8/2022 | 5.000.000 | 0,83 | | | | |
| | | 32.000.000 | 5,34 | | | | |
| | | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| GBP 16.000.000 | Bank Of America NA 3/8/2022 (Zero Coupon) | 15.965.963 | 2,67 | | | | |
| | | 15.965.963 | 2,67 | | | | |
| Gesamt Einlagenzertifikate | | 186.843.858 | 31,18 | | | | |
| | | | | KURZFRISTIGE TITEL | | | |
| | | | | Belgien | | | |
| GBP 18.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp 10/8/2022 (Zero Coupon) | 17.955.549 | 3,00 | | | | |
| | | 17.955.549 | 3,00 | | | | |
| | | | | Dänemark | | | |
| GBP 6.000.000 | Jyske Bank A/S 8/6/2022 (Zero Coupon) | 5.998.965 | 1,00 | | | | |
| GBP 19.000.000 | Jyske Bank A/S 16/6/2022 (Zero Coupon) | 18.992.705 | 3,17 | | | | |
| | | 24.991.670 | 4,17 | | | | |
| | | | | Finnland | | | |
| GBP 27.000.000 | Kuntarahoitus Oyj 11/7/2022 (Zero Coupon) | 26.970.167 | 4,50 | | | | |
| | | 26.970.167 | 4,50 | | | | |
| | | | | Frankreich | | | |
| GBP 27.000.000 | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 9/6/2022 (Zero Coupon) | 26.994.554 | 4,50 | | | | |
| GBP 7.000.000 | Antalis SA 1/6/2022 (Zero Coupon) | 7.000.000 | 1,17 | | | | |
| GBP 7.000.000 | Antalis SA 1/6/2022 (Zero Coupon) | 6.998.698 | 1,17 | | | | |
| GBP 10.000.000 | BPCE SA RegS 17/6/2022 (Zero Coupon) | 9.995.405 | 1,67 | | | | |
| GBP 15.000.000 | Managed and Enhanced Tap Magenta Funding 6/7/2022 (Zero Coupon) | 14.984.605 | 2,50 | | | | |
| GBP 9.000.000 | Managed and Enhanced Tap Magenta Funding ST SA 6/6/2022 (Zero Coupon) | 8.998.707 | 1,50 | | | | |
| | | 74.971.969 | 12,51 | | | | |
| | | | | Irland | | | |
| GBP 7.000.000 | Matchpoint Finance Plc 9/6/2022 (Zero Coupon) | 6.998.436 | 1,17 | | | | |
| GBP 7.000.000 | Matchpoint Finance Plc 13/6/2022 (Zero Coupon) | 6.997.678 | 1,17 | | | | |
| GBP 17.000.000 | Matchpoint Finance Plc 6/7/2022 (Zero Coupon) | 16.983.947 | 2,83 | | | | |
| GBP 17.000.000 | Matchpoint Finance Plc RegS 6/6/2022 (Zero Coupon) | 16.997.696 | 2,84 | | | | |
| | | 47.977.757 | 8,01 | | | | |
| | | | | Luxemburg | | | |
| GBP 8.000.000 | Albion Capital Corp SA 20/6/2022 (Zero Coupon) | 7.995.714 | 1,33 | | | | |
| GBP 1.000.000 | Albion Capital Corp SA 20/6/2022 (Zero Coupon) | 999.470 | 0,17 | | | | |
| GBP 10.000.000 | Albion Capital Corp SA 27/6/2022 (Zero Coupon) | 9.992.314 | 1,67 | | | | |
| | | 18.987.498 | 3,17 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in GBP | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|
| Niederlande | | | |
| GBP 5.000.000 | ABN Amro Bank NV 11/7/2022 (Zero Coupon) | 4.993.983 | 0,83 |
| GBP 9.000.000 | PACCAR Financial Europe BV 8/6/2022 (Zero Coupon) | 8.998.275 | 1,50 |
| GBP 3.000.000 | Toyota Motor Finance 25/7/2022 (Zero Coupon) | 2.994.933 | 0,50 |
| GBP 10.000.000 | Toyota Motor Finance 3/8/2022 (Zero Coupon) | 9.979.508 | 1,67 |
| | | 26.966.699 | 4,50 |
| Schweden | | | |
| GBP 20.000.000 | Svenska Handelsbanken AB 9/9/2022 (Zero Coupon) | 19.928.806 | 3,32 |
| | | 19.928.806 | 3,32 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| GBP 8.000.000 | Nieuw Amsterdam Receivables Corp 9/6/2022 (Zero Coupon) | 7.998.283 | 1,33 |
| | | 7.998.283 | 1,33 |
| Gesamt kurzfristige Titel | | 266.748.398 | 44,51 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 537.287.476 | 89,65 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| ANLEIHEN | | | |
| Japan | | | |
| GBP 6.000.000 | Norinchukin Bank 6/7/2022 (Zero Coupon) | 5.994.433 | 1,00 |
| | | 5.994.433 | 1,00 |
| Gesamt Anleihen | | 5.994.433 | 1,00 |
| Gesamt sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | 5.994.433 | 1,00 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Irland | | | |
| 578.203 | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund (Dist) [~] | 57.810.371 | 9,65 |
| | | 57.810.371 | 9,65 |
| Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 57.810.371 | 9,65 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 601.092.280 | 100,30 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | | (1.794.407) | (0,30) |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (GBP) | | 599.297.873 | 100,00 |
| [~] Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9. | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP |
|-------------------------------------|--|---------------|---|-----------------------------------|--|---------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (1.520.460) | Civitas Social Housing Plc (REIT) | HSBC | 10.126 |
| Australien | | | | 537.847 | Compass Group Plc | JP Morgan | 326.153 |
| 43.403 | Xero Ltd | HSBC | 122.509 | 299.383 | Computacenter Plc | JP Morgan | 450.063 |
| | | | 122.509 | (64.601) | Cranswick Plc | HSBC | (16.099) |
| Belgien | | | | (3.545.828) | Currys Plc | JP Morgan | 148.748 |
| (69.478) | Colruyt SA | Goldman Sachs | 198.058 | 255.519 | Dechra Pharmaceuticals Plc | JP Morgan | 1.216.271 |
| (42.825) | Umicore SA | HSBC | (116.249) | 225.896 | Diploma Plc | JP Morgan | 262.830 |
| | | | 81.809 | (1.047.334) | Direct Line Insurance Group Plc | Goldman Sachs | (78.550) |
| Dänemark | | | | (776.147) | DS Smith Plc | HSBC | 22.508 |
| 50.878 | DSV PANALPINA A/S | JP Morgan | 544.130 | 345.579 | Dunelm Group Plc | HSBC | 2.761 |
| 43.661 | Novo Nordisk A/S 'B' | JP Morgan | 65.922 | (1.287.925) | Elementis Plc | HSBC | (82.427) |
| (45.029) | Pandora A/S | HSBC | (195.199) | (308.369) | Frasers Group Plc | Goldman Sachs | (15.418) |
| | | | 414.853 | 51.060 | Games Workshop Group Plc | HSBC | 229.770 |
| Frankreich | | | | 672.049 | Genuit Group Plc | HSBC | 372.987 |
| 51.206 | Euronext NV | JP Morgan | 410.460 | (166.982) | GlaxoSmithKline Plc | Goldman Sachs | 118.891 |
| 25.704 | Gaztransport Et Technigaz SA | JP Morgan | 199.774 | 751.068 | Grafton Group Plc (Unit) | HSBC | 458.475 |
| | | | 610.234 | (134.725) | Greggs Plc | Goldman Sachs | (134.725) |
| Deutschland | | | | (2.022.493) | Hipgnosis Songs Fund Ltd | JP Morgan | 102.662 |
| (61.371) | HelloFresh SE | HSBC | (16.140) | 318.370 | Howden Joinery Group Plc | HSBC | 68.131 |
| | | | (16.140) | (1.018.993) | HSBC Holdings Plc | Goldman Sachs | (352.062) |
| Irland | | | | (902.068) | lbstock Plc | HSBC | (103.738) |
| (34.935) | Kerry Group Plc 'A' | HSBC | (21.998) | 3.063.586 | IntegraFin Holdings Plc | JP Morgan | (1.002.038) |
| (10.562) | Kerry Group Plc 'A' | JP Morgan | (6.651) | 316.122 | Intermediate Capital Group Plc | Goldman Sachs | 475.764 |
| | | | (28.649) | (684.956) | ITM Power Plc | Goldman Sachs | (101.130) |
| Niederlande | | | | (863.121) | IWG Plc | Goldman Sachs | (76.818) |
| (30.237) | Unibail-Rodamco-Westfield (REIT) | HSBC | 40.653 | (278.977) | J D Wetherspoon Plc | JP Morgan | (124.145) |
| | | | 40.653 | (1.928.355) | J Sainsbury Plc | JP Morgan | 90.633 |
| Spanien | | | | (703.958) | JD Sports Fashion Plc | HSBC | (72.543) |
| (71.375) | ACS Actividades de Construccion y Servicios SA | HSBC | (172.490) | 234.833 | JET2 Plc | HSBC | 205.479 |
| | | | (172.490) | (1.002.343) | John Wood Group Plc | Goldman Sachs | (185.433) |
| Schweden | | | | (124.284) | Johnson Matthey Plc | HSBC | 186.426 |
| (159.001) | Electrolux AB 'B' | Goldman Sachs | 13.632 | (2.039.172) | Kingfisher Plc | JP Morgan | (422.109) |
| (283.121) | Hennes & Mauritz AB 'B' | JP Morgan | (340.399) | (354.572) | Land Securities Group Plc (REIT) | HSBC | (249.619) |
| (1.017.048) | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB | HSBC | (166.986) | (1.247.875) | Legal & General Group Plc | JP Morgan | (328.191) |
| | | | (493.753) | (7.866.526) | Lloyds Banking Group Plc | HSBC | (194.941) |
| Schweiz | | | | 105.301 | London Stock Exchange Group Plc | HSBC | 397.713 |
| (5.431) | Geberit AG Reg | HSBC | (124.994) | (1.351.998) | Marks & Spencer Group Plc | Goldman Sachs | (62.976) |
| 17.100 | Lonza Group AG Reg | Goldman Sachs | 441.687 | (481.231) | Marshalls Plc | Goldman Sachs | (9.625) |
| | | | 316.693 | 95.146 | Morgan Sindall Group Plc | HSBC | 114.175 |
| Großbritannien | | | | (1.106.754) | National Express Group Plc | HSBC | (208.335) |
| 77.166 | 4imprint Group Plc | JP Morgan | (189.057) | (273.592) | National Grid Plc | HSBC | 30.095 |
| 532.469 | AJ Bell Plc | HSBC | 165.790 | (313.267) | Network International Holdings Plc | Goldman Sachs | (27.567) |
| (350.554) | Alphawave IP Group Plc | Goldman Sachs | (128.506) | 231.683 | Next Fifteen Communications Group Plc | HSBC | (180.713) |
| (603.755) | Ascential Plc | JP Morgan | (66.766) | 44.672 | Next Plc | JP Morgan | 244.803 |
| 275.086 | Ashtead Group Plc | HSBC | 1.042.576 | (197.569) | Ocado Group Plc | HSBC | (408.637) |
| (196.443) | Associated British Foods Plc | JP Morgan | (345.740) | 297.385 | Oxford Instruments Plc | JP Morgan | 490.685 |
| 782.651 | Auction Technology Group Plc | Goldman Sachs | 647.778 | (108.936) | Persimmon Plc | HSBC | (150.981) |
| 98.668 | AVEVA Group Plc | JP Morgan | 199.506 | 932.608 | Pets at Home Group Plc | Goldman Sachs | 546.508 |
| (404.891) | B&M European Value Retail SA | JP Morgan | 274.307 | (1.197.835) | PZ Cussons Plc | JP Morgan | (6.528) |
| 5.673.961 | Baltic Classifieds Group Plc | HSBC | 1.577.361 | 1.116.144 | QinetiQ Group Plc | JP Morgan | 90.248 |
| (330.643) | Bodycote Plc | Goldman Sachs | (72.370) | (1.148.232) | Quilter Plc | JP Morgan | 230.316 |
| (570.702) | British Land Co Plc (REIT) | HSBC | (263.094) | 400.204 | RELX Plc | Goldman Sachs | (136.069) |
| 74.795 | Bunzl Plc | JP Morgan | (140.615) | 24.305 | Renishaw Plc | HSBC | (18.540) |
| (141.207) | Burberry Group Plc | HSBC | (285.944) | 2.871.736 | Rentokil Initial Plc | HSBC | (268.456) |
| 724.358 | Bytes Technology Group Plc | HSBC | 496.910 | 351.095 | Rightmove Plc | HSBC | 207.146 |
| (173.238) | Carnival Plc | Goldman Sachs | 87.485 | (490.992) | Royal Mail Plc | HSBC | 36.824 |
| | | | | 2.021.217 | RS GROUP Plc | Goldman Sachs | 1.351.728 |
| | | | | (216.304) | Sage Group Plc | HSBC | 13.411 |
| | | | | (1.080.920) | Scottish Mortgage Investment Trust Plc | JP Morgan | (597.948) |
| | | | | (106.709) | Severn Trent Plc | Goldman Sachs | 205.948 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) GBP | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) GBP |
|---------------------------------------|----------------------------------|---------------|--|---|-----------------------------------|---------------|--|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3.009.275) | SIG Plc | JP Morgan | 34.607 | 32.040 | Nutrien Ltd | Goldman Sachs | (104.536) |
| 2.583.594 | Sirius Real Estate Ltd | HSBC | 180.852 | (20.662) | NVIDIA Corp | HSBC | (137.945) |
| 39.104 | Spirax-Sarco Engineering Plc | HSBC | (93.850) | (363.589) | Opendoor Technologies Inc | Goldman Sachs | (46.345) |
| 1.088.754 | Spirent Communications Plc | Goldman Sachs | 56.615 | (67.864) | Oracle Corp | Goldman Sachs | (143.358) |
| (1.000.149) | SSP Group Plc | Goldman Sachs | (392.058) | (52.153) | Peloton Interactive Inc 'A' | Goldman Sachs | 53.027 |
| (1.265.614) | Standard Life Aberdeen Plc | Goldman Sachs | (91.441) | (5.837) | Pool Corp | HSBC | (33.219) |
| (1.819.393) | Tesco Plc | Goldman Sachs | 383.093 | 53.385 | Qualtrics International Inc 'A' | Goldman Sachs | (43.678) |
| (235.664) | Travis Perkins Plc | Goldman Sachs | (110.762) | (186.506) | Robinhood Markets Inc 'A' | Goldman Sachs | (29.630) |
| (893.439) | Tritax Big Box Plc (REIT) | HSBC | (11.787) | (46.038) | ROBLOX Corp 'A' | Goldman Sachs | 38.764 |
| (504.416) | TUI AG | Goldman Sachs | 230.518 | 30.146 | S&P Global Inc | HSBC | 607.757 |
| (357.052) | United Utilities Group Plc | HSBC | 96.404 | 20.073 | salesforce.com Inc | Goldman Sachs | (56.764) |
| (277.331) | Victoria Plc | HSBC | 180.465 | 8.560 | ServiceNow Inc | HSBC | 303.261 |
| (99.729) | Victrex Plc | HSBC | (55.848) | 1.500 | ServiceNow Inc | JP Morgan | 20.181 |
| (1.550.993) | Vodafone Group Plc | Goldman Sachs | (174.952) | 18.198 | Smartsheet Inc 'A' | Goldman Sachs | (30.356) |
| (764.677) | Volution Group Plc | HSBC | (408.176) | (3.161) | Snowflake Inc 'A' | Goldman Sachs | 41.732 |
| 1.329.392 | Watches of Switzerland Group Plc | HSBC | 1.781.385 | (13.067) | Snowflake Inc 'A' | JP Morgan | 159.847 |
| 408.432 | WH Smith Plc | Goldman Sachs | 408.432 | (118.485) | Sonos Inc | Goldman Sachs | (22.594) |
| 403.674 | Wise Plc 'A' | Goldman Sachs | 162.681 | (34.119) | T Rowe Price Group Inc | JP Morgan | (172.528) |
| 583.068 | Workspace Group Plc (REIT) | Goldman Sachs | 259.465 | (9.404) | Tesla Inc | JP Morgan | 91.430 |
| 69.433 | XP Power Ltd | HSBC | 192.091 | 3.488 | Thermo Fisher Scientific Inc | Goldman Sachs | 88.828 |
| | | | 8.719.272 | 31.374 | Thermo Fisher Scientific Inc | HSBC | 1.347.021 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | 47.041 | Trade Desk Inc 'A' | Goldman Sachs | 52.385 |
| 32.577 | Abbott Laboratories | Goldman Sachs | 143.878 | 36.516 | Tradeweb Markets Inc 'A' | HSBC | 209.425 |
| 68.549 | Accenture Plc 'A' | Goldman Sachs | 762.321 | (110.517) | UiPath Inc 'A' | Goldman Sachs | (111.651) |
| (85.365) | Affirm Holdings Inc | Goldman Sachs | (444.429) | (26.901) | Walt Disney Co | HSBC | (37.609) |
| 5.362 | Alphabet Inc 'C' | Goldman Sachs | (165.558) | (26.621) | Wayfair Inc 'A' | Goldman Sachs | (117.784) |
| (72.923) | Altria Group Inc | JP Morgan | 87.468 | (39.628) | Wingstop Inc | Goldman Sachs | 76.193 |
| 1.692 | Amazon.com Inc | JP Morgan | 215.515 | (57.452) | Zillow Group Inc 'C' | JP Morgan | (139.067) |
| (18.742) | American Express Co | JP Morgan | (128.346) | 68.534 | Zoetis Inc | Goldman Sachs | 243.889 |
| 75.627 | Antero Resources Corp | Goldman Sachs | 435.150 | 15.250 | Zoom Video Communications Inc 'A' | Goldman Sachs | 217.592 |
| 54.909 | Apple Inc | HSBC | (181.009) | 46.192 | ZoomInfo Technologies Inc | JP Morgan | (41.203) |
| (18.530) | Asbury Automotive Group Inc | Goldman Sachs | 60.349 | | | | 5.724.570 |
| (138.110) | AT&T Inc | Goldman Sachs | (102.576) | Gesamtsumme (zugrunde liegendes | | | |
| 31.560 | Axon Enterprise Inc | Goldman Sachs | 96.444 | Brutto-Exposure - GBP 643.902.042) | | | 15.319.561 |
| 137.170 | Baker Hughes Co | Goldman Sachs | 218.427 | | | | |
| (34.151) | Best Buy Co Inc | JP Morgan | (207.683) | | | | |
| (27.360) | Beyond Meat Inc | Goldman Sachs | (2.608) | | | | |
| (18.266) | Boot Barn Holdings Inc | Goldman Sachs | 192.005 | | | | |
| (7.866) | Boston Beer Co Inc 'A' | JP Morgan | 39.427 | | | | |
| (62.034) | Campbell Soup Co | JP Morgan | 206.468 | | | | |
| (48.041) | CarMax Inc | Goldman Sachs | (208.833) | | | | |
| (13.728) | Carvana Co | Goldman Sachs | 74.698 | | | | |
| (76.173) | Chewy Inc 'A' | Goldman Sachs | 15.127 | | | | |
| (75.937) | Comcast Corp 'A' | HSBC | (243.090) | | | | |
| (123.773) | Conagra Brands Inc | Goldman Sachs | 316.585 | | | | |
| 48.516 | Danaher Corp | Goldman Sachs | 540.005 | | | | |
| (18.663) | Datadog Inc 'A' | HSBC | (170.529) | | | | |
| 23.154 | Dollar General Corp | Goldman Sachs | (141.516) | | | | |
| 43.604 | Domo Inc 'B' | JP Morgan | 32.558 | | | | |
| 15.817 | Edwards Lifesciences Corp | Goldman Sachs | 49.628 | | | | |
| 47.864 | Entegris Inc | Goldman Sachs | 158.545 | | | | |
| 5.220 | Fair Isaac Corp | JP Morgan | 245.181 | | | | |
| (31.949) | Freshpet Inc | Goldman Sachs | (154.555) | | | | |
| (143.135) | Gap Inc | Goldman Sachs | 187.602 | | | | |
| (39.120) | HP Inc | Goldman Sachs | (25.422) | | | | |
| (31.862) | HP Inc | JP Morgan | (40.495) | | | | |
| (97.438) | Intel Corp | Goldman Sachs | (63.080) | | | | |
| 15.821 | Intuit Inc | JP Morgan | 673.043 | | | | |
| (90.240) | Kroger Co | HSBC | 162.717 | | | | |
| (5.923) | Kroger Co | JP Morgan | (18.989) | | | | |
| (70.842) | L Brands Inc | JP Morgan | 403.235 | | | | |
| 497.745 | Leslie's Inc | Goldman Sachs | 296.536 | | | | |
| (76.775) | Macy's Inc | Goldman Sachs | (148.809) | | | | |
| 14.242 | Meta Platforms Inc 'A' | JP Morgan | (27.151) | | | | |
| 40.833 | Microsoft Corp | Goldman Sachs | 303.271 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement GBP | Nicht realisierter Netto(-verlust) GBP |
|-------------------------------------|-----------------|---|---------------|---|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (968) | EUR | EURO STOXX 50 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 12.940.497 | (434.312) |
| (894) | GBP | FTSE 100 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 68.024.460 | (4.301.830) |
| (1.646) | GBP | FTSE 250 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 67.028.412 | (1.044.095) |
| (24) | USD | NASDAQ 100 E-Mini Stock Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 4.785.891 | (293.199) |
| Gesamt | | | | | (6.073.436) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP |
|---------|-------|---------|----------|-------------|------------|---|
|---------|-------|---------|----------|-------------|------------|---|

Derivative Finanzinstrumente

OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE

| Auf AUD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|--------------------------------------|------------|-----|------------|-----------------------------------|-----------|----------|
| AUD | 24.383.657 | GBP | 13.995.307 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (89.699) |
| GBP | 527.727 | AUD | 926.818 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (823) |
| | | | | | | (90.522) |

| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|--------------------------------------|------------|-----|------------|-----------------------------------|-----------|----------|
| CHF | 19.347.471 | GBP | 15.927.782 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 95.668 |
| GBP | 1.077.850 | CHF | 1.315.316 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (11.485) |
| | | | | | | 84.183 |

| Auf CNH lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|--------------------------------------|--------|-----|-------|-----------------------------------|-----------|------|
| CNH | 31.502 | GBP | 3.788 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (40) |
| GBP | 123 | CNH | 1.017 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 1 |
| | | | | | | (39) |

| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|--------------------------------------|-------------|-----|-------------|-----------------------------------|-----------|-------------|
| EUR | 255.328.375 | GBP | 218.776.995 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (1.420.090) |
| GBP | 15.560.448 | EUR | 18.226.573 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 44.461 |
| | | | | | | (1.375.629) |

| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|--------------------------------------|------------|-----|---------|-----------------------------------|-----------|-------|
| GBP | 3.605 | JPY | 576.727 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 47 |
| JPY | 18.118.951 | GBP | 112.563 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (756) |
| | | | | | | (709) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP |
|---------|-------|---------|----------|-------------|------------|---|
|---------|-------|---------|----------|-------------|------------|---|

Derivative Finanzinstrumente

OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE

| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|--|-------------|-----|-------------|-----------------------------------|-----------|-------------|
| GBP | 15.935.575 | USD | 19.709.044 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 279.829 |
| USD | 195.389.787 | GBP | 157.917.231 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (2.710.680) |
| | | | | | | (2.430.851) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - GBP 435.401.365) | | | | | | (3.813.567) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 72,12 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 9,65 |
| Staatsanleihen | 4,50 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 3,27 |
| Technologie | 3,26 |
| Kommunikation | 2,79 |
| Zyklische Konsumgüter | 2,48 |
| Industrie | 2,23 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 100,30 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | (0,30) |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|---------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Indien Fortsetzung | | | |
| STAMMAKTIEEN | | | | 265.538 | InterGlobe Aviation Ltd | 6.293.322 | 1,76 |
| | Argentinien | | | 846.684 | Mahindra & Mahindra Ltd | 11.254.767 | 3,16 |
| 756.130 | Grupo Financiero Galicia SA ADR | 7.054.693 | 1,98 | 69.788 | Maruti Suzuki India Ltd | 7.191.010 | 2,02 |
| 1.660.476 | YPF SA ADR | 7.721.213 | 2,17 | 1.368.627 | Zee Entertainment Enterprises Ltd | 4.448.605 | 1,25 |
| | | 14.775.906 | 4,15 | | | 41.504.480 | 11,65 |
| | Brasilien | | | 26.675.100 | Astra International Tbk PT | 13.446.402 | 3,77 |
| 461.264 | Gol Linhas Aereas Inteligentes SA ADR* | 2.910.576 | 0,82 | | | 13.446.402 | 3,77 |
| 744.579 | Rede D'Or Sao Luiz SA | 5.811.804 | 1,63 | | Kasachstan | | |
| 650.035 | Suzano SA | 7.427.629 | 2,08 | 79.781 | Kaspi.KZ JSC GDR | 4.204.459 | 1,18 |
| 2.454.443 | Ultrapar Participacoes SA | 7.535.914 | 2,12 | | | 4.204.459 | 1,18 |
| | | 23.685.923 | 6,65 | | Mexiko | | |
| | Kaimaninseln | | | 1.884.055 | Cemex SAB de CV ADR | 8.459.407 | 2,37 |
| 327.700 | Baidu Inc 'A' | 6.159.657 | 1,73 | | | 8.459.407 | 2,37 |
| 2.625.000 | Haidilao International Holding Ltd* | 5.218.455 | 1,47 | | Niederlande | | |
| 4.036.500 | JS Global Lifestyle Co Ltd | 4.310.593 | 1,21 | 308.015 | X5 Retail Group NV GDR* | 3.080 | 0,00 |
| 1.099.299 | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | 6.035.151 | 1,69 | | | 3.080 | 0,00 |
| 2.875.000 | Sunac China Holdings Ltd** | 1.485.523 | 0,42 | | Philippinen | | |
| 459.400 | Sunny Optical Technology Group Co Ltd | 7.247.691 | 2,03 | 1.588.260 | AC Energy Corp | 216.770 | 0,06 |
| 187.908 | TAL Education Group ADR | 785.455 | 0,22 | 529.420 | Ayala Corp | 7.043.775 | 1,98 |
| 8.703.000 | Topsports International Holdings Ltd | 6.454.759 | 1,81 | 2.658.410 | BDO Unibank Inc | 6.769.399 | 1,90 |
| 5.102.400 | Wynn Macau Ltd* | 2.978.023 | 0,84 | | | 14.029.944 | 3,94 |
| | | 40.675.307 | 11,42 | | Russland | | |
| | China | | | 213.200 | LUKOIL PJSC ADR* | 32 | 0,00 |
| 26.274.000 | China Eastern Airlines Corp Ltd 'H' | 9.341.539 | 2,62 | 188.191 | Magnit PJSC* | 30 | 0,00 |
| 10.890.000 | China Petroleum & Chemical Corp 'H' | 5.259.629 | 1,48 | 328.138 | Magnit PJSC GDR* | 10 | 0,00 |
| 1.338.600 | Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd 'A' | 5.978.615 | 1,68 | 742.923 | Sberbank of Russia PJSC ADR* | 460 | 0,00 |
| 4.980.780 | Infore Environment Technology Group Co Ltd 'A' | 3.499.919 | 0,98 | | | 532 | 0,00 |
| 1.196.484 | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd 'A' | 6.812.057 | 1,91 | | Südafrika | | |
| 930.300 | Ming Yang Smart Energy Group Ltd 'A' | 3.547.306 | 0,99 | 951.859 | Sibanye Stillwater Ltd | 3.105.449 | 0,87 |
| 2.708.648 | Shenzhen H&T Intelligent Control Co Ltd 'A' | 6.326.834 | 1,78 | | | 3.105.449 | 0,87 |
| | | 40.765.899 | 11,44 | | Südkorea | | |
| | Zypern | | | 17.757 | Korea Zinc Co Ltd | 8.539.779 | 2,40 |
| 261.721 | Ozon Holdings Plc ADR* | 2.617 | 0,00 | 377.892 | Samsung Electronics Co Ltd | 20.586.745 | 5,78 |
| 266.311 | TCS Group Holding Plc GDR* | 2.663 | 0,00 | | | 29.126.524 | 8,18 |
| | | 5.280 | 0,00 | | Taiwan | | |
| | Griechenland | | | 1.191.000 | Catcher Technology Co Ltd | 6.729.509 | 1,89 |
| 2.046.866 | National Bank of Greece SA | 7.849.884 | 2,20 | 1.422.000 | Hon Hai Precision Industry Co Ltd | 5.536.124 | 1,56 |
| | | 7.849.884 | 2,20 | 118.000 | Wiwynn Corp | 3.752.420 | 1,05 |
| | Hongkong | | | | | 16.018.053 | 4,50 |
| 2.128.000 | Hua Hong Semiconductor Ltd* | 8.067.642 | 2,26 | | Thailand | | |
| | | 8.067.642 | 2,26 | 31.543.700 | Land & Houses PCL NVDR | 8.250.033 | 2,31 |
| | Ungarn | | | 4.534.700 | Thai Oil PCL NVDR | 7.685.932 | 2,16 |
| 243.032 | OTP Bank Nyrt | 5.886.644 | 1,65 | | | 15.935.965 | 4,47 |
| | | 5.886.644 | 1,65 | | Türkei | | |
| | Indien | | | 1.071.489 | D-MARKET Elektronik Hizmetler ve Ticaret AS ADR | 1.467.940 | 0,41 |
| 1.858.177 | Bandhan Bank Ltd | 7.802.614 | 2,19 | | | 1.467.940 | 0,41 |
| 671.706 | ICICI Prudential Life Insurance Co Ltd | 4.514.162 | 1,27 | | Vereinigte Arabische Emirate | | |
| | | | | 8.325.421 | Emaar Properties PJSC | 12.942.420 | 3,63 |
| | | | | 3.385.324 | Fertiglobe Plc | 4.903.261 | 1,38 |
| | | | | | | 17.845.681 | 5,01 |
| | | | | 3.317.319 | Ferrexpo Plc | 7.600.637 | 2,13 |
| | | | | | Großbritannien | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|---|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | |
| 1.715.283 | Mediclinic International Plc (traded in South Africa) | 8.282.135 | 2,33 |
| 411.777 | Mediclinic International Plc (traded in United Kingdom) | 1.991.640 | 0,56 |
| | | 17.874.412 | 5,02 |
| Gesamt Stammaktien | | 324.734.813 | 91,14 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 324.734.813 | 91,14 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Irland | | | |
| 170.022 | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Dist) [~] | 17.003.864 | 4,77 |
| | | 17.003.864 | 4,77 |
| Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 17.003.864 | 4,77 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 341.738.677 | 95,91 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 14.582.063 | 4,09 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | 356.320.740 | 100,00 |

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

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

⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9.

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|---|-----------------|---|--|---|-----------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Thailand | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (3.201.400) | Energy Absolute PCL NVDR | Citibank | (199.117) |
| Australien | | | | Großbritannien | | | |
| (979.791) | Fortescue Metals Group Ltd | HSBC | (716.498) | 64.124 | Ferrexpo Plc | HSBC | 39.045 |
| | | | (716.498) | (988.160) | Glencore Plc | Goldman Sachs | (809.221) |
| Brasilien | | | | 185.706 | Wizz Air Holdings Plc | HSBC | 61.073 |
| 3.904.048 | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao | Bank of America | 1.646.749 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 9.628.812 | Cielo SA | Merrill Lynch | 1.785.161 | 204.564 | Alibaba Group Holding Ltd ADR | Bank of America | 2.166.333 |
| (940.153) | JBS SA | BNP Paribas | (545.857) | (266.853) | Dlocal Ltd | HSBC | (1.084.972) |
| 1.159.258 | Lojas Renner SA | Goldman Sachs | 487.850 | (34.730) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Goldman Sachs | (721.761) |
| 18.545 | Suzano SA | BNP Paribas | 23.604 | 223.419 | Gol Linhas Aereas | Bank of America | |
| 4.762.208 | Via SA | Goldman Sachs | 469.805 | | Inteligentes SA ADR | Merrill Lynch | 129.583 |
| (1.162.589) | WEG SA | Bank of America | (257.124) | (291.877) | Li Auto Inc ADR | HSBC | (1.742.506) |
| | | Merrill Lynch | (257.124) | (4.946) | MercadoLibre Inc | HSBC | (30.665) |
| | | | 3.610.188 | 18.749 | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR | Goldman Sachs | 36.373 |
| Kaimaninseln | | | | (208.978) | Tata Motors Ltd ADR | HSBC | (580.959) |
| 380.500 | Baidu Inc 'A' | Bank of America | 1.660.212 | 283.913 | Trip.com Group Ltd ADR | BNP Paribas | 292.430 |
| (275.816) | NIO Inc ADR | Merrill Lynch | (719.880) | Vietnam | | | |
| | | UBS | (719.880) | 3.831.200 | Vietnam Dairy Products JSC | Citibank | 885.052 |
| | | | 940.332 | Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 269.072.800) | | | |
| Frankreich | | | | | | | (764.467) |
| (13.465) | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | HSBC | (929.565) | * Wertpapier unter Vorbehalt einer Anpassung an die beizulegenden Zeitwerte gemäß Anmerkung 2 (a). | | | |
| | | | (929.565) | | | | |
| Griechenland | | | | | | | |
| 141.393 | National Bank of Greece SA | HSBC | 39.015 | | | | |
| | | | 39.015 | | | | |
| Hongkong | | | | | | | |
| (292.000) | BYD Co Ltd 'H' | Bank of America | (1.580.786) | | | | |
| 1.126.000 | CK Hutchison Holdings Ltd | Merrill Lynch | (98.279) | | | | |
| (81.700) | Li Auto Inc 'A' | Citibank | (212.162) | | | | |
| (267.800) | Meituan 'B' | HSBC | (803.857) | | | | |
| 1.664.000 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | BNP Paribas | 798.588 | | | | |
| 5.428.000 | Sunac China Holdings Ltd* | Bank of America | (362.303) | | | | |
| (115.000) | Tencent Holdings Ltd | Merrill Lynch | (251.695) | | | | |
| 1.576.000 | Topsports International Holdings Ltd | Goldman Sachs | (63.844) | | | | |
| 3.678.000 | Wynn Macau Ltd | Bank of America | 42.907 | | | | |
| | | Merrill Lynch | (2.531.431) | | | | |
| Saudi-Arabien | | | | | | | |
| (284.364) | Saudi Arabian Mining Co | Goldman Sachs | (243.251) | | | | |
| 411.906 | Yanbu National Petrochemical Co | HSBC | (504.340) | | | | |
| | | | (747.591) | | | | |
| Südafrika | | | | | | | |
| 82.805 | Sibanye Stillwater Ltd | HSBC | 28.167 | | | | |
| | | | 28.167 | | | | |
| Südkorea | | | | | | | |
| 167.979 | Fila Holdings Corp | Citibank | 263.860 | | | | |
| 335.452 | Korea Electric Power Corp | Citibank | 306.499 | | | | |
| 202.813 | Samsung Electronics Co Ltd | HSBC | 526.928 | | | | |
| 11.934 | Samsung SDI Co Ltd | HSBC | 10.768 | | | | |
| | | | 1.108.055 | | | | |
| Taiwan | | | | | | | |
| 839.000 | Accton Technology Corp | Bank of America | 75.866 | | | | |
| 114.000 | Wiwynn Corp | Merrill Lynch | (81.693) | | | | |
| | | Bank of America | (5.827) | | | | |
| | | Merrill Lynch | (5.827) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Netto(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|--|---------------|---|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (4.852) | TRY | BIST 30 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 8.726.715 | (376.654) |
| (575) | INR | Indian Railway Catering & Tourism Corp Ltd Futures June 2022 | Juni 2022 | 4.401.908 | (327.792) |
| Gesamt | | | | | (704.446) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 2.878.259 | USD | 2.932.407 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 69.305 |
| USD | 379.560 | CHF | 374.035 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (10.519) |
| | | | | | | 58.786 |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 18.465.242 | USD | 19.575.839 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 217.002 |
| USD | 2.201.749 | EUR | 2.084.532 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (32.658) |
| | | | | | | 184.344 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 25.419.035) | | | | | | 243.130 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Zyklische Konsumgüter | 23,48 |
| Finanzen | 17,22 |
| Industrie | 12,29 |
| Technologie | 10,27 |
| Energie | 8,92 |
| Grundstoffe | 8,86 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 6,65 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 4,77 |
| Kommunikation | 3,39 |
| Versorger | 0,06 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 95,91 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 4,09 |
| 100,00 | |

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|--------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Kolumbien Fortsetzung | | | |
| | | | | USD 2.500.000 | Colombia Government International Bond 3,00% 30/1/2030 | 2.077.928 | 0,19 |
| | | | | USD 200.000 | Colombia Government International Bond 4,125% 15/5/2051 | 141.171 | 0,01 |
| | | | | | | 7.357.846 | 0,65 |
| ANLEIHEN | | | | Dominikanische Republik | | | |
| | Angola | | | USD 889.000 | Dominican Republic International Bond 5,50% 22/2/2029 | 844.758 | 0,08 |
| USD 4.975.000 | Angolan Government International Bond RegS 8,25% 9/5/2028 | 4.813.312 | 0,42 | USD 1.047.000 | Dominican Republic International Bond RegS 5,50% 22/2/2029 | 991.242 | 0,09 |
| USD 5.868.000 | Angolan Government International Bond RegS 9,375% 8/5/2048 | 5.288.535 | 0,47 | USD 5.983.000 | Dominican Republic International Bond RegS 4,875% 23/9/2032 | 5.165.296 | 0,45 |
| USD 5.074.000 | Angolan Government International Bond RegS 9,125% 26/11/2049 | 4.469.243 | 0,39 | USD 1.180.000 | Dominican Republic International Bond RegS 5,875% 30/1/2060 | 921.494 | 0,08 |
| | | 14.571.090 | 1,28 | | | 7.922.790 | 0,70 |
| | Argentinien | | | Ecuador | | | |
| USD 506.645 | Argentine Republic Government International Bond 1,00% 9/7/2029^ | 151.233 | 0,01 | USD 9.547.192 | Ecuador Government International Bond RegS 5,00% 31/7/2030 | 7.920.231 | 0,70 |
| USD 12.314.560 | Argentine Republic Government International Bond 0,50% 9/7/2030 | 3.632.795 | 0,32 | USD 4.984.327 | Ecuador Government International Bond RegS 1,00% 31/7/2035 | 3.192.948 | 0,28 |
| USD 4.401.591 | Argentine Republic Government International Bond 2,00% 9/1/2038 | 1.538.356 | 0,14 | | | 11.113.179 | 0,98 |
| USD 5.702.811 | Province of Salta Argentina RegS 5,00% 1/12/2027 | 4.163.052 | 0,37 | Ägypten | | | |
| ARS 389.865.000 | Provincia de Buenos Aires RegS 37,867% 12/4/2025 | 1.870.205 | 0,16 | EGP 60.559.000 | Egypt Government Bond 14,425% 14/7/2030 | 2.992.085 | 0,26 |
| | | 11.355.641 | 1,00 | EGP 66.147.000 | Egypt Government Bond 15,433% 28/7/2035 | 3.352.782 | 0,30 |
| | Benin | | | USD 6.450.000 | Egypt Government International Bond RegS 5,25% 6/10/2025^ | 5.853.375 | 0,51 |
| EUR 5.490.000 | Benin Government International Bond RegS 4,95% 22/1/2035 | 4.444.453 | 0,39 | EUR 4.103.000 | Egypt Government International Bond RegS 6,375% 11/4/2031 (traded in Supranational) | 3.373.422 | 0,30 |
| | | 4.444.453 | 0,39 | EUR 134.000 | Egypt Government International Bond RegS 6,375% 11/4/2031 (traded in United Kingdom) | 110.173 | 0,01 |
| | Bermuda | | | USD 1.386.000 | Egypt Government International Bond RegS 7,625% 29/5/2032 | 1.120.927 | 0,10 |
| USD 3.622.000 | Investment Energy Resources Ltd 6,25% 26/4/2029 | 3.430.324 | 0,30 | USD 3.624.000 | Egypt Government International Bond RegS 8,50% 31/1/2047 | 2.659.110 | 0,23 |
| | | 3.430.324 | 0,30 | USD 5.073.000 | Egypt Government International Bond RegS 7,903% 21/2/2048 | 3.601.830 | 0,32 |
| | Brasilien | | | USD 505.000 | Egypt Government International Bond RegS 7,50% 16/2/2061 | 343.400 | 0,03 |
| BRL 122.432.000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,00% 1/1/2023 | 26.611.490 | 2,34 | | | 23.407.104 | 2,06 |
| BRL 55.673.000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,00% 1/1/2025 | 11.678.159 | 1,02 | Kolumbien | | | |
| | | 38.289.649 | 3,36 | USD 5.544.000 | Colombia Government International Bond 4,50% 15/3/2029^ | 5.138.747 | 0,45 |
| | Kaimaninseln | | | | | | |
| USD 2.382.000 | Latam Finance Ltd 6,875% 11/4/2024 | 2.238.913 | 0,20 | | | | |
| USD 3.154.000 | MAF Sukuk Ltd RegS 4,638% 14/5/2029 | 3.201.310 | 0,28 | | | | |
| USD 2.988.000 | MAF Sukuk Ltd RegS 3,933% 28/2/2030^ | 2.897.643 | 0,25 | | | | |
| | | 8.337.866 | 0,73 | | | | |
| | Chile | | | | | | |
| USD 2.974.000 | VTR Comunicaciones SpA 5,125% 15/1/2028 | 2.425.490 | 0,21 | | | | |
| | | 2.425.490 | 0,21 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|-----------------------|---|------------------------|--------------------|-------------------|--|------------------------|--------------------|
| Gabun | | | | Mauritius | | | |
| USD 12.871.000 | Gabon Government International Bond RegS 6,95% 16/6/2025 | 12.363.722 | 1,09 | USD 1.640.217 | Azure Power Energy Ltd 3,575% 19/8/2026 [^] | 1.475.786 | 0,13 |
| USD 11.166.000 | Gabon Government International Bond RegS 7,00% 24/11/2031 | 9.463.185 | 0,83 | | | 1.475.786 | 0,13 |
| | | 21.826.907 | 1,92 | Mexiko | | | |
| Ghana | | | | USD 2.892.000 | Alfa SAB de CV 6,875% 25/3/2044 | 2.958.906 | 0,26 |
| USD 943.000 | Ghana Government International Bond RegS 6,375% 11/2/2027 | 577.588 | 0,05 | USD 2.684.000 | Alpek SAB de CV 3,25% 25/2/2031 | 2.273.267 | 0,20 |
| USD 9.546.000 | Ghana Government International Bond RegS 7,625% 16/5/2029 | 5.083.245 | 0,45 | USD 4.085.000 | Banco Mercantil del Norte SA FRN 31/12/2099 | 3.904.647 | 0,34 |
| USD 4.071.000 | Ghana Government International Bond RegS 8,125% 26/3/2032 | 2.188.162 | 0,19 | USD 2.650.000 | Braskem Idesa SAPI 6,99% 20/2/2032 [^] | 2.344.482 | 0,21 |
| USD 1.710.000 | Ghana Government International Bond RegS 8,625% 7/4/2034 | 899.409 | 0,08 | USD 1.332.000 | Cemex SAB de CV 3,875% 11/7/2031 [^] | 1.130.748 | 0,10 |
| USD 8.965.000 | Ghana Government International Bond RegS 8,875% 7/5/2042 | 4.684.212 | 0,41 | USD 3.327.000 | Cemex SAB de CV FRN 31/12/2099 | 3.035.921 | 0,27 |
| USD 4.130.000 | Ghana Government International Bond RegS 8,95% 26/3/2051 | 2.126.372 | 0,19 | USD 1.501.000 | Cemex SAB de CV RegS 5,45% 19/11/2029 [^] | 1.439.181 | 0,13 |
| GHS 5.170.000 | Republic of Ghana Government Bonds 20,75% 16/1/2023 | 644.520 | 0,06 | USD 2.732.000 | Grupo Bimbo SAB de CV FRN 31/12/2099 [^] | 2.739.322 | 0,24 |
| GHS 6.214.000 | Republic of Ghana Government Bonds 17,60% 20/2/2023 | 754.835 | 0,06 | MXN 231.091.800 | Mexican Bonos 6,50% 9/6/2022 | 11.786.477 | 1,04 |
| | | 16.958.343 | 1,49 | MXN 2.738.813.800 | Mexican Bonos 8,00% 7/12/2023 | 137.935.924 | 12,12 |
| Ungarn | | | | MXN 376.285.000 | Mexican Bonos 7,75% 23/11/2034 | 17.973.450 | 1,58 |
| HUF 2.984.390.000 | Hungary Government Bond 6,00% 24/11/2023 | 7.981.651 | 0,70 | MXN 318.678.400 | Mexican Bonos 8,50% 18/11/2038 | 15.986.234 | 1,40 |
| HUF 12.121.440.000 | Hungary Government Bond 4,00% 28/4/2051 | 20.496.193 | 1,80 | USD 2.714.000 | Mexico City Airport Trust RegS 5,50% 31/7/2047 | 2.076.210 | 0,18 |
| | | 28.477.844 | 2,50 | USD 533.000 | Mexico Government International Bond 2,659% 24/5/2031 | 461.845 | 0,04 |
| Indien | | | | USD 8.609.000 | Mexico Government International Bond 4,40% 12/2/2052 | 7.158.683 | 0,63 |
| USD 3.356.000 | Muthoot Finance Ltd 6,125% 31/10/2022 | 3.364.390 | 0,30 | USD 3.586.000 | Operadora de Servicios Mega SA de CV Sofom ER 8,25% 11/2/2025 [^] | 2.334.988 | 0,20 |
| | | 3.364.390 | 0,30 | USD 1.328.000 | Petroleos Mexicanos 6,875% 16/10/2025 | 1.334.388 | 0,12 |
| Elfenbeinküste | | | | USD 3.445.000 | Petroleos Mexicanos 6,50% 13/3/2027 | 3.317.535 | 0,29 |
| EUR 2.531.000 | Ivory Coast Government International Bond RegS 4,875% 30/1/2032 | 2.252.400 | 0,20 | USD 11.509.000 | Petroleos Mexicanos 6,84% 23/1/2030 [^] | 10.413.919 | 0,91 |
| USD 8.397.000 | Ivory Coast Government International Bond RegS 6,125% 15/6/2033 [^] | 7.523.040 | 0,66 | USD 3.823.000 | Petroleos Mexicanos 5,95% 28/1/2031 | 3.194.824 | 0,28 |
| EUR 1.946.000 | Ivory Coast Government International Bond RegS 6,875% 17/10/2040 [^] | 1.719.838 | 0,15 | USD 15.120.000 | Petroleos Mexicanos 6,70% 16/2/2032 | 13.157.726 | 1,16 |
| EUR 1.135.000 | Ivory Coast Government International Bond RegS 6,625% 22/3/2048 | 965.147 | 0,09 | USD 3.285.000 | Petroleos Mexicanos 6,75% 21/9/2047 | 2.368.485 | 0,21 |
| | | 12.460.425 | 1,10 | EUR 6.872.000 | Petroleos Mexicanos RegS 3,75% 21/2/2024 | 7.302.552 | 0,64 |
| Luxemburg | | | | | | 256.629.714 | 22,55 |
| USD 3.596.000 | Kenbourne Invest SA 6,875% 26/11/2024 | 3.427.473 | 0,30 | Marokko | | | |
| USD 1.507.000 | Kenbourne Invest SA 4,70% 22/1/2028 | 1.210.287 | 0,11 | USD 2.569.000 | Morocco Government International Bond 3,00% 15/12/2032 | 2.021.854 | 0,18 |
| | | 4.637.760 | 0,41 | USD 2.477.000 | Morocco Government International Bond RegS 3,00% 15/12/2032 | 1.941.349 | 0,17 |
| | | | | USD 1.344.000 | Morocco Government International Bond RegS 4,00% 15/12/2050 | 932.400 | 0,08 |
| | | | | | | 4.895.603 | 0,43 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|-------------------|---|------------------------|--------------------|
| | Niederlande | | | | Paraguay Fortsetzung | | |
| USD 5.538.000 | Kazakhstan Temir Zholy Finance BV RegS 6,95% 10/7/2042 | 5.248.986 | 0,46 | USD 220.000 | Paraguay Government International Bond RegS 4,95% 28/4/2031 | 214.783 | 0,02 |
| USD 4.706.000 | Vivo Energy Investments BV 5,125% 24/9/2027 | 4.591.173 | 0,40 | USD 4.660.000 | Paraguay Government International Bond RegS 3,849% 28/6/2033 [*] | 4.114.157 | 0,36 |
| | | 9.840.159 | 0,86 | USD 731.000 | Paraguay Government International Bond RegS 5,40% 30/3/2050 | 625.177 | 0,05 |
| | Nigeria | | | | | 6.459.624 | 0,57 |
| USD 7.310.000 | Nigeria Government International Bond RegS 8,375% 24/3/2029 | 6.542.450 | 0,57 | | Peru | | |
| USD 5.162.000 | Nigeria Government International Bond RegS 7,143% 23/2/2030 | 4.258.650 | 0,37 | USD 5.432.000 | Peruvian Government International Bond 1,862% 1/12/2032 | 4.334.912 | 0,38 |
| USD 3.676.000 | Nigeria Government International Bond RegS 8,747% 21/1/2031 | 3.188.930 | 0,28 | | | 4.334.912 | 0,38 |
| USD 7.250.000 | Nigeria Government International Bond RegS 7,875% 16/2/2032 | 5.881.562 | 0,52 | PLN 297.301.000 | Republic of Poland Government Bond 2,50% 25/1/2023 | 68.199.060 | 5,99 |
| USD 4.963.000 | Nigeria Government International Bond RegS 7,375% 28/9/2033 | 3.927.904 | 0,35 | | | 68.199.060 | 5,99 |
| USD 2.219.000 | Nigeria Government International Bond RegS 7,625% 28/11/2047 | 1.603.228 | 0,14 | | Katar | | |
| USD 5.801.000 | Nigeria Government International Bond RegS 8,25% 28/9/2051 | 4.336.248 | 0,38 | USD 1.672.000 | Qatar Government International Bond RegS 4,40% 16/4/2050 | 1.704.320 | 0,15 |
| | | 29.738.972 | 2,61 | | | 1.704.320 | 0,15 |
| | Oman | | | EUR 4.318.000 | Republik Kamerun Republic of Cameroon International Bond RegS 5,95% 7/7/2032 | 3.749.049 | 0,33 |
| USD 3.854.000 | Oman Government International Bond RegS 6,00% 1/8/2029 | 3.926.263 | 0,34 | | | 3.749.049 | 0,33 |
| USD 3.942.000 | Oman Government International Bond RegS 7,375% 28/10/2032 | 4.350.983 | 0,38 | | Rumänien | | |
| USD 7.974.000 | Oman Government International Bond RegS 6,50% 8/3/2047 | 7.266.307 | 0,64 | EUR 2.194.000 | Romanian Government International Bond RegS 3,624% 26/5/2030 [*] | 2.143.282 | 0,19 |
| USD 794.000 | Oman Government International Bond RegS 6,75% 17/1/2048 | 742.390 | 0,07 | USD 6.970.000 | Romanian Government International Bond RegS 3,00% 14/2/2031 [*] | 5.901.656 | 0,52 |
| USD 511.000 | Oman Government International Bond RegS 7,00% 25/1/2051 | 487.366 | 0,04 | USD 7.440.000 | Romanian Government International Bond RegS 3,625% 27/3/2032 [*] | 6.391.090 | 0,56 |
| | | 16.773.309 | 1,47 | | | 14.436.028 | 1,27 |
| | Panama | | | RUB 2.126.111.000 | Russland Russian Federal Bond - OFZ 6,10% 18/7/2035 | 2.285.231 | 0,20 |
| USD 2.745.000 | Aeropuerto Internacional de Tocumen SA 5,125% 11/8/2061 | 2.314.055 | 0,20 | | | 2.285.231 | 0,20 |
| USD 459.000 | Panama Government International Bond 3,16% 23/1/2030 | 423.439 | 0,04 | EUR 2.586.000 | Senegal Senegal Government International Bond RegS 4,75% 13/3/2028 [*] | 2.548.632 | 0,22 |
| USD 5.876.000 | Panama Government International Bond 4,50% 16/4/2050 | 5.185.335 | 0,46 | USD 1.169.000 | Senegal Government International Bond RegS 6,25% 23/5/2033 [*] | 1.019.953 | 0,09 |
| | | 7.922.829 | 0,70 | EUR 3.632.000 | Senegal Government International Bond RegS 5,375% 8/6/2037 | 2.986.173 | 0,26 |
| | Paraguay | | | USD 3.652.000 | Senegal Government International Bond RegS 6,75% 13/3/2048 | 2.829.113 | 0,25 |
| USD 925.000 | Frigorifico Concepcion SA 7,70% 21/7/2028 | 755.577 | 0,07 | | | 9.383.871 | 0,82 |
| USD 757.000 | Paraguay Government International Bond RegS 4,70% 27/3/2027 | 749.930 | 0,07 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|-----------------|--|------------------------|--------------------|-----------------|---|------------------------|--------------------|
| | Serbien | | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | |
| EUR 2.920.000 | Serbia International Bond RegS 1,65% 3/3/2033 | 2.217.005 | 0,19 | USD 7.841.000 | CITGO Petroleum Corp 7,00% 15/6/2025 | 7.841.157 | 0,69 |
| | | 2.217.005 | 0,19 | USD 1.810.000 | Sasol Financing USA LLC 4,375% 18/9/2026 | 1.669.363 | 0,15 |
| | Singapur | | | USD 3.588.000 | Sasol Financing USA LLC 6,50% 27/9/2028 | 3.488.774 | 0,31 |
| USD 4.160.003 | Continuum Energy Levanter Pte Ltd RegS 4,50% 9/2/2027 ^a | 3.715.465 | 0,33 | USD 4.022.000 | Sasol Financing USA LLC 5,50% 18/3/2031 | 3.516.414 | 0,31 |
| | | 3.715.465 | 0,33 | USD 224.739.900 | United States Treasury Note/Bond 0,125% 31/12/2022 ^a | 222.762.277 | 19,57 |
| | Südafrika | | | | | 239.277.985 | 21,03 |
| USD 8.113.000 | Eskom Holdings SOC Ltd RegS 7,125% 11/2/2025 | 7.751.971 | 0,68 | | Uruguay | | |
| USD 5.163.000 | Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 22/6/2030 ^a | 5.132.203 | 0,45 | UYU 488.010.000 | Uruguay Government International Bond RegS 9,875% 20/6/2022 | 12.177.630 | 1,07 |
| USD 921.000 | Republic of South Africa Government International Bond 5,65% 27/9/2047 | 748.370 | 0,07 | | | 12.177.630 | 1,07 |
| USD 1.713.000 | Republic of South Africa Government International Bond 5,75% 30/9/2049 | 1.400.378 | 0,12 | | Venezuela | | |
| | | 15.032.922 | 1,32 | USD 49.187.000 | Petroleos de Venezuela SA RegS 8,50% 27/10/2022 | 9.837.400 | 0,87 |
| | Schweden | | | USD 298.810.114 | Petroleos de Venezuela SA RegS 9,75% 17/5/2035 | 16.061.044 | 1,41 |
| EUR 5.337.500 | East Renewable AB 13,50% 1/1/2025 | 2.287.118 | 0,20 | USD 9.827.000 | Venezuela Government International Bond 9,25% 15/9/2027 | 884.430 | 0,08 |
| | | 2.287.118 | 0,20 | USD 9.983.500 | Venezuela Government International Bond RegS 11,75% 21/10/2026 | 898.515 | 0,08 |
| | Ukraine | | | USD 2.832.800 | Venezuela Government International Bond RegS 9,25% 7/5/2028 | 254.952 | 0,02 |
| UAH 280.857.000 | Ukraine Government International Bond RegS 16,00% 24/5/2023 | 7.191.797 | 0,63 | USD 44.697.400 | Venezuela Government International Bond RegS 11,95% 5/8/2031 | 4.022.766 | 0,35 |
| USD 942.000 | Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2024 | 385.278 | 0,04 | | | 31.959.107 | 2,81 |
| USD 2.818.000 | Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2025 | 1.113.110 | 0,10 | | Sambia | | |
| USD 2.826.000 | Ukraine Government International Bond RegS 6,876% 21/5/2029 | 1.059.750 | 0,09 | USD 5.951.000 | Zambia Government International Bond RegS 5,375% 20/9/2022 | 3.957.415 | 0,35 |
| USD 38.269.000 | Ukraine Government International Bond RegS FRN 31/5/2040 | 14.924.910 | 1,31 | USD 1.953.000 | Zambia Government International Bond RegS 8,50% 14/4/2024 | 1.376.865 | 0,12 |
| | | 24.674.845 | 2,17 | USD 2.375.000 | Zambia Government International Bond RegS 8,97% 30/7/2027 | 1.653.202 | 0,14 |
| | Vereinigte Arabische Emirate | | | | | 6.987.482 | 0,61 |
| USD 3.408.000 | NBK Tier 1 Ltd FRN 31/12/2099 | 3.073.416 | 0,27 | | Gesamt Anleihen | 1.005.397.092 | 88,35 |
| | | 3.073.416 | 0,27 | | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | 1.005.397.092 | 88,35 |
| | Großbritannien | | | | Wertpapiervermögen zum Marktwert | 1.005.397.092 | 88,35 |
| USD 3.767.000 | Liquid Telecommunications Financing Plc 5,50% 4/9/2026 | 3.503.630 | 0,31 | | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 132.514.459 | 11,65 |
| USD 750.300 | State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 Plc RegS 9,375% 10/3/2023 | 393.015 | 0,03 | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | 1.137.911.551 | 100,00 |
| USD 2.081.000 | Vedanta Resources Finance II Plc 8,95% 11/3/2025 | 1.887.904 | 0,17 | | | | |
| | | 5.784.549 | 0,51 | | | | |

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

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Marktwert USD |
|---|--------------------|--|-------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | USD 500.000 | Fund receives Fixed 0,781% and pays Floating USD 12 Month FEDL | Bank of America Merrill Lynch | 20/10/2035 | (108.494) | (108.494) |
| CCIRS | USD 1.000.000 | Fund receives Fixed 0,902% and pays Floating USD 12 Month FEDL | Bank of America Merrill Lynch | 20/10/2040 | (264.490) | (264.490) |
| CCIRS | MXN 710.000.000 | Fund receives Fixed 8,210% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 22/3/2032 | (522.719) | (522.102) |
| CCIRS | EUR 11.727.228 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,355% | Bank of America Merrill Lynch | 10/1/2032 | 1.657.695 | 1.657.923 |
| CCIRS | EUR 4.265.667 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,640% | Bank of America Merrill Lynch | 31/5/2052 | 89.299 | 89.462 |
| CCIRS | EUR 117.917.218 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,736% | Bank of America Merrill Lynch | 31/5/2032 | 1.377.622 | 1.379.786 |
| CCIRS | HUF 15.761.390.887 | Fund receives Floating HUF 6 Month BUBOR and pays Fixed 5,760% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | 3.615.594 | 3.616.416 |
| CCIRS | PLN 157.258.648 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 4,585% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | 4.512.181 | 4.512.834 |
| CCIRS | USD 500.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 0,740% | Bank of America Merrill Lynch | 20/10/2035 | 111.056 | 111.056 |
| CCIRS | USD 1.000.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 0,843% | Bank of America Merrill Lynch | 20/10/2040 | 274.167 | 274.167 |
| CCIRS | USD 62.259.927 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 1,124% | Bank of America Merrill Lynch | 3/1/2027 | 3.990.773 | 3.991.383 |
| CCIRS | USD 61.649.198 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 1,144% | Bank of America Merrill Lynch | 31/12/2026 | 3.878.268 | 3.889.050 |
| CCIRS | USD 35.194.553 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 1,404% | Bank of America Merrill Lynch | 5/1/2032 | 3.694.609 | 3.695.214 |
| CDS | USD 818.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Argentine Republic Government International Bond | Deutsche Bank | 20/6/2026 | (136.601) | (457.667) |
| CDS | USD 19.182.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Argentine Republic Government International Bond | Goldman Sachs | 20/6/2026 | (3.301.859) | (10.732.219) |
| IRS | BRL 337.000.000 | Fund receives Fixed 12,070% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | Credit Suisse | 2/1/2025 | (315.717) | (315.717) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 35.617.981) | | | | | 18.551.384 | 10.816.602 |

CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps

CDS: Credit Default Swaps

IRS: Zinsraten-Swaps

| Anzahl der Kontrakte | Vertrags- wahrung | Kontrakte/ Bezeichnung | Verfalls- datum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------------|---|--------------------|--|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (148) | EUR | Euro Bund Futures June 2022 | Juni 2022 | 24.017.980 | 1.874.195 |
| (68) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 11.847.510 | 2.862.808 |
| (1.830) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 218.456.250 | 192.579 |
| 1.015 | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 114.576.055 | (456.346) |
| (50) | USD | US Ultra Bond Futures September 2022 | September 2022 | 7.760.937 | 36.641 |
| Gesamt | | | | | 4.509.877 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Netto(-verlust) USD | Marktwert USD |
|--|-----------|-----------------------|---------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 70.499.000 | Put | OTC USD/JPY | Citibank | USD 126,00 | 21/07/2022 | (411.362) | 487.148 |
| 32.970.000 | Put | OTC USD/JPY | Goldman Sachs | USD 126,50 | 22/08/2022 | (203.919) | 390.002 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 0) | | | | | | (615.281) | 877.150 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn USD | Marktwert USD |
|--|-----------|-----------------------|---------------|---------------|---------------|------------------------------------|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (70.499.000) | Put | OTC USD/JPY | Citibank | USD 120,00 | 21/07/2022 | 158.411 | (70.358) |
| (10.990.000) | Put | OTC USD/JPY | Goldman Sachs | USD 126,00 | 22/06/2022 | 53.181 | (30.146) |
| (10.990.000) | Call | OTC USD/JPY | Goldman Sachs | USD 130,00 | 22/06/2022 | 18.551 | (54.422) |
| (32.970.000) | Put | OTC USD/JPY | Goldman Sachs | USD 121,00 | 22/08/2022 | 108.273 | (97.426) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 0) | | | | | | 338.416 | (252.352) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|-----------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 31.790.550 | USD | 22.333.042 | State Street Bank & Trust Company | 19/7/2022 | 503.964 |
| BRL | 225.500.000 | USD | 45.262.947 | Citibank | 2/6/2022 | 2.684.152 |
| BRL | 225.500.000 | USD | 44.699.493 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2022 | 2.620.526 |
| CHF | 22.682.112 | USD | 22.826.568 | State Street Bank & Trust Company | 19/7/2022 | 874.315 |
| CLP | 19.559.680.714 | USD | 22.751.751 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2022 | 695.059 |
| CNH | 16.261.981 | USD | 2.401.161 | Morgan Stanley | 19/7/2022 | 31.865 |
| COP | 4.162.444.215 | USD | 1.020.582 | Natwest Markets | 19/7/2022 | 82.483 |
| COP | 122.249.837.556 | USD | 30.801.168 | Toronto Dominion Bank | 19/7/2022 | 1.595.553 |
| CZK | 13.289.952 | USD | 563.124 | Natwest Markets | 19/7/2022 | 9.490 |
| EUR | 5.105.629 | USD | 5.490.443 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2022 | (7.557) |
| EUR | 22.124.590 | USD | 23.351.682 | HSBC | 19/7/2022 | 407.700 |
| EUR | 5.192.065 | USD | 5.519.408 | Morgan Stanley | 19/7/2022 | 56.300 |
| GBP | 5.868.473 | USD | 7.389.944 | JP Morgan | 19/7/2022 | (172) |
| HUF | 2.996.036.825 | USD | 8.374.381 | HSBC | 19/7/2022 | (307.571) |
| IDR | 111.645.410.221 | USD | 7.564.052 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2022 | 103.557 |
| INR | 1.122.872.117 | USD | 14.368.165 | HSBC | 19/7/2022 | 16.658 |
| JPY | 66.656.638 | USD | 518.652 | HSBC | 19/7/2022 | 19 |
| KRW | 3.386.341.840 | USD | 2.668.806 | Morgan Stanley | 19/7/2022 | 57.874 |
| MXN | 666.072.780 | USD | 32.956.769 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2022 | 705.882 |
| MXN | 110.996.895 | USD | 5.525.578 | Deutsche Bank | 19/7/2022 | 84.094 |
| NZD | 3.749.666 | USD | 2.381.674 | HSBC | 19/7/2022 | 56.661 |
| PLN | 248.544.395 | USD | 55.921.790 | BNP Paribas | 19/7/2022 | 1.949.627 |
| RON | 1.608.573 | USD | 339.408 | Standard Chartered Bank | 19/7/2022 | 6.852 |
| THB | 24.641.856 | USD | 712.903 | Morgan Stanley | 19/7/2022 | 8.172 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|-------------|---------|-----------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 2.760.577 | AUD | 3.895.544 | UBS | 19/7/2022 | (37.819) |
| USD | 45.298.407 | BRL | 225.500.000 | Bank of America Merrill Lynch | 2/6/2022 | (2.648.692) |
| USD | 15.207.370 | BRL | 76.718.138 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2022 | (891.539) |
| USD | 21.730.217 | BRL | 106.000.000 | Goldman Sachs | 19/7/2022 | (513.339) |
| USD | 1.446.527 | CHF | 1.437.373 | State Street Bank & Trust Company | 19/7/2022 | (55.406) |
| USD | 5.540.841 | CLP | 4.636.465.251 | BNP Paribas | 19/7/2022 | (17.037) |
| USD | 5.642.831 | CNH | 37.716.081 | HSBC | 19/7/2022 | (36) |
| USD | 338.145 | CNH | 2.290.105 | Morgan Stanley | 19/7/2022 | (4.487) |
| USD | 29.974.215 | COP | 122.249.837.556 | Natwest Markets | 19/7/2022 | (2.422.506) |
| USD | 563.124 | CZK | 13.289.953 | Natwest Markets | 19/7/2022 | (9.490) |
| USD | 33.109.472 | EUR | 30.980.000 | BNP Paribas | 19/7/2022 | (159.647) |
| USD | 23.508.470 | EUR | 22.221.030 | HSBC | 19/7/2022 | (354.478) |
| USD | 40.975.486 | GBP | 32.983.331 | JP Morgan | 19/7/2022 | (558.196) |
| USD | 50.245.069 | HUF | 18.356.902.765 | Toronto Dominion Bank | 19/7/2022 | 819.226 |
| USD | 7.564.052 | IDR | 111.645.410.221 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2022 | (103.557) |
| USD | 7.303.619 | INR | 570.777.805 | HSBC | 19/7/2022 | (8.468) |
| USD | 518.652 | JPY | 66.656.638 | HSBC | 19/7/2022 | (19) |
| USD | 11.034.455 | JPY | 1.404.361.759 | JP Morgan | 19/7/2022 | 106.791 |
| USD | 2.830.778 | KRW | 3.505.210.201 | Citibank | 19/7/2022 | 8.384 |
| USD | 2.668.823 | KRW | 3.386.362.392 | Morgan Stanley | 19/7/2022 | (57.874) |
| USD | 213.815.342 | MXN | 4.321.314.968 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2022 | (4.579.588) |
| USD | 21.812.255 | MXN | 441.600.000 | Citibank | 19/7/2022 | (505.767) |
| USD | 2.381.675 | NZD | 3.749.667 | HSBC | 19/7/2022 | (56.661) |
| USD | 24.968.460 | PHP | 1.316.212.354 | Standard Chartered Bank | 19/7/2022 | 6.984 |
| USD | 49.441.934 | PLN | 219.744.675 | BNP Paribas | 19/7/2022 | (1.723.717) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 21.524.339 | PLN | 92.123.742 | UBS Standard | 19/7/2022 | 74.121 |
| USD | 350.598 | RON | 1.661.606 | Chartered Bank | 19/7/2022 | (7.078) |
| USD | 5.610.772 | THB | 191.011.215 | JP Morgan | 19/7/2022 | 21.359 |
| USD | 712.903 | THB | 24.641.857 | Morgan Stanley | 19/7/2022 | (8.172) |
| USD | 36.547.085 | TRY | 628.653.707 | BNP Paribas | 19/7/2022 | 344.233 |
| USD | 8.580.405 | TWD | 246.734.696 | Citibank | 19/7/2022 | 42.577 |
| USD | 37.474.970 | ZAR | 597.322.736 | HSBC | 19/7/2022 | (564.704) |
| ZAR | 139.734.528 | USD | 8.727.888 | HSBC | 19/7/2022 | 170.912 |
| ZAR | 87.385.482 | USD | 5.499.622 | JP Morgan | 19/7/2022 | 65.401 |
| ZAR | 68.160.658 | USD | 4.291.513 | Morgan Stanley | 19/7/2022 | 49.205 |
| ZAR | 188.146.323 | USD | 11.750.000 | Chartered Bank Standard | 19/7/2022 | 231.839 |
| | | | | | | (1.111.742) |
| Auf AUD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| AUD | 919.152.994 | USD | 652.934.849 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 7.003.818 |
| USD | 20.634.104 | AUD | 29.539.935 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (575.144) |
| | | | | | | 6.428.674 |
| Auf CAD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CAD | 230.832.434 | USD | 179.952.541 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 2.598.867 |
| USD | 8.911.158 | CAD | 11.519.870 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (199.211) |
| | | | | | | 2.399.656 |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 9.052 | USD | 9.224 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 217 |
| USD | 745 | CHF | 734 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (22) |
| | | | | | | 195 |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 37.133.184 | USD | 39.378.466 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 424.483 |
| USD | 2.443.352 | EUR | 2.315.128 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (38.225) |
| | | | | | | 386.258 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|-----------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 1.368.631 | USD | 1.694.039 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 28.935 |
| USD | 141.091 | GBP | 114.450 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (2.992) |
| | | | | | | 25.943 |
| Auf SEK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| SEK | 317.356 | USD | 32.107 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 218 |
| USD | 3.388 | SEK | 33.697 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (43) |
| | | | | | | 175 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 2.071.119.086) | | | | | | 8.129.159 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Staatsanleihen | 73,67 |
| Energie | 7,54 |
| Finanzen | 1,67 |
| Grundstoffe | 1,35 |
| Industrie | 1,34 |
| Kommunikation | 0,93 |
| Versorger | 0,68 |
| Zyklische Konsumgüter | 0,60 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 0,31 |
| Diversifiziert | 0,26 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 88,35 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 11,65 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|-----------------------|------------------------|--------------------|--|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Dominikanische Republik Fortsetzung | | | |
| | | | | USD 1.100.000 | Dominican Republic International Bond RegS 5,50% 27/1/2025 [^] | 1.119.250 | 1,16 |
| | | | | USD 449.000 | Dominican Republic International Bond RegS 6,875% 29/1/2026 | 465.837 | 0,49 |
| | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 1.817.987 1,89 | | | |
| | | | | Ecuador | | | |
| | | | | USD 1.412.921 | Ecuador Government International Bond RegS 31/7/2030 (Zero Coupon) | 779.703 | 0,81 |
| | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 779.703 0,81 | | | |
| | | | | Ägypten | | | |
| | | | | EGP 9.045.000 | Egypt Government Bond 14,196% 7/7/2023 | 484.169 | 0,50 |
| | | | | EGP 6.095.000 | Egypt Government Bond 13,765% 5/1/2024 | 322.014 | 0,33 |
| | | | | USD 501.000 | Egypt Government International Bond RegS 6,20% 1/3/2024 | 486.596 | 0,51 |
| | | | | USD 1.430.000 | Egypt Government International Bond RegS 5,75% 29/5/2024 | 1.362.075 | 1,42 |
| | | | | USD 1.155.000 | Egypt Government International Bond RegS 5,25% 6/10/2025 [^] | 1.048.163 | 1,09 |
| | | | | USD 4.500.000 | Egypt Government International Bond RegS 5,80% 30/9/2027 [^] | 3.796.875 | 3,94 |
| | | | | USD 225.000 | Egypt Government International Bond RegS 7,625% 29/5/2032 | 181.969 | 0,19 |
| | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 7.681.861 7,98 | | | |
| | | | | El Salvador | | | |
| | | | | USD 1.079.000 | El Salvador Government International Bond RegS 7,75% 24/1/2023 [^] | 790.552 | 0,82 |
| | | | | USD 657.000 | El Salvador Government International Bond RegS 5,875% 30/1/2025 | 287.466 | 0,30 |
| | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 1.078.018 1,12 | | | |
| | | | | Äthiopien | | | |
| | | | | USD 526.000 | Ethiopia International Bond RegS 6,625% 11/12/2024 | 330.162 | 0,34 |
| | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 330.162 0,34 | | | |
| | | | | Gabun | | | |
| | | | | USD 1.421.440 | Gabon Government International Bond RegS 6,375% 12/12/2024 [^] | 1.398.914 | 1,45 |
| | | | | USD 850.000 | Gabon Government International Bond RegS 6,95% 16/6/2025 | 816.499 | 0,85 |
| | | | | USD 291.000 | Gabon Government International Bond RegS 6,625% 6/2/2031 | 248.062 | 0,26 |
| | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 2.463.475 2,56 | | | |
| | | | | Georgien | | | |
| | | | | USD 1.275.000 | Georgian Railway JSC RegS 4,00% 17/6/2028 | 1.086.166 | 1,13 |
| | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 1.086.166 1,13 | | | |
| | | | | Ghana | | | |
| | | | | USD 652.283 | Ghana Government International Bond RegS 8,125% 18/1/2026 [^] | 489.123 | 0,51 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|-------------------|---|------------------------|--------------------|----------------|--|------------------------|--------------------|
| | Ghana Fortsetzung | | | | Libanon | | |
| USD 400.000 | Ghana Government International Bond RegS 7,875% 26/3/2027 | 253.000 | 0,26 | USD 1.496.000 | Lebanon Government International Bond RegS 6,10% 4/10/2022 | 143.642 | 0,15 |
| USD 387.000 | Ghana Government International Bond RegS 8,95% 26/3/2051 | 199.251 | 0,21 | USD 1.100.000 | Lebanon Government International Bond RegS 6,00% 27/1/2023 | 104.901 | 0,11 |
| GHS 373.000 | Republic of Ghana Government Bonds 20,75% 16/1/2023 | 46.500 | 0,05 | USD 1.000.000 | Lebanon Government International Bond RegS 6,65% 22/4/2024 | 95.133 | 0,10 |
| | | 987.874 | 1,03 | USD 1.055.000 | Lebanon Government International Bond RegS 6,60% 27/11/2026 | 99.716 | 0,10 |
| | Guatemala | | | | | 443.392 | 0,46 |
| USD 200.000 | Guatemala Government Bond RegS 5,75% 6/6/2022 | 200.020 | 0,21 | | Mexiko | | |
| | | 200.020 | 0,21 | USD 270.000 | Cemex SAB de CV RegS 7,375% 5/6/2027 | 279.914 | 0,29 |
| | Hongkong | | | MXN 21.892.000 | Mexican Bonos 6,50% 9/6/2022 | 1.116.567 | 1,16 |
| USD 859.000 | CNAC HK Finbridge Co Ltd RegS 4,625% 14/3/2023 | 870.811 | 0,90 | MXN 19.239.200 | Mexican Bonos 8,00% 7/11/2047 | 902.566 | 0,94 |
| | | 870.811 | 0,90 | USD 205.000 | Mexico Government International Bond 3,90% 27/4/2025 | 208.895 | 0,22 |
| | Ungarn | | | USD 400.000 | Petroleos Mexicanos 4,625% 21/9/2023 | 400.400 | 0,42 |
| HUF 974.680.000 | Hungary Government Bond 1,75% 26/10/2022 | 2.593.318 | 2,69 | USD 1.816.000 | Petroleos Mexicanos 6,875% 16/10/2025 | 1.824.735 | 1,89 |
| USD 204.000 | Hungary Government International Bond 5,375% 21/2/2023 | 207.183 | 0,22 | EUR 497.000 | Petroleos Mexicanos RegS 5,125% 15/3/2023 | 539.732 | 0,56 |
| | | 2.800.501 | 2,91 | EUR 1.443.000 | Petroleos Mexicanos RegS 3,75% 21/2/2024 | 1.533.409 | 1,59 |
| | Indien | | | | | 6.806.218 | 7,07 |
| USD 515.000 | Export-Import Bank of India RegS 4,00% 14/1/2023 | 516.989 | 0,54 | | Mongolei | | |
| | | 516.989 | 0,54 | USD 342.000 | Mongolia Government International Bond RegS 5,625% 1/5/2023 | 340.931 | 0,35 |
| | Indonesien | | | USD 1.275.000 | Mongolia Government International Bond RegS 3,50% 7/7/2027 | 1.092.244 | 1,14 |
| USD 273.000 | Indonesia Government International Bond 2,95% 11/1/2023 | 273.948 | 0,28 | | | 1.433.175 | 1,49 |
| IDR 2.197.000.000 | Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2029 | 161.750 | 0,17 | | Nigeria | | |
| IDR 2.240.000.000 | Indonesia Treasury Bond 8,375% 15/4/2039 | 164.378 | 0,17 | USD 424.000 | Nigeria Government International Bond RegS 7,625% 21/11/2025 | 404.920 | 0,42 |
| USD 623.000 | Pertamina Persero PT RegS 4,30% 20/5/2023* | 627.973 | 0,65 | USD 910.000 | Nigeria Government International Bond RegS 6,125% 28/9/2028 | 744.949 | 0,77 |
| | | 1.228.049 | 1,27 | USD 1.125.000 | Nigeria Government International Bond RegS 7,375% 28/9/2033 | 890.367 | 0,93 |
| | Irak | | | | | 2.040.236 | 2,12 |
| USD 1.698.000 | Iraq International Bond RegS 6,752% 9/3/2023 | 1.694.243 | 1,76 | | Oman | | |
| | | 1.694.243 | 1,76 | USD 1.959.000 | Oman Government International Bond RegS 4,875% 1/2/2025 | 1.963.897 | 2,04 |
| | Jordanien | | | USD 479.000 | Oman Government International Bond RegS 4,75% 15/6/2026 | 471.815 | 0,49 |
| USD 485.000 | Jordan Government International Bond RegS 6,125% 29/1/2026 | 475.855 | 0,49 | USD 897.000 | Oman Government International Bond RegS 6,75% 28/10/2027 | 949.699 | 0,99 |
| | | 475.855 | 0,49 | | | 3.385.411 | 3,52 |
| | Kasachstan | | | | | | |
| KZT 145.000.000 | Development Bank of Kazakhstan JSC RegS 8,95% 4/5/2023 | 295.018 | 0,31 | | | | |
| | | 295.018 | 0,31 | | | | |
| | Kenia | | | | | | |
| USD 469.000 | Republic of Kenya Government International Bond RegS 6,875% 24/6/2024 | 439.101 | 0,46 | | | | |
| | | 439.101 | 0,46 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---------------|---|------------------------|--------------------|---------------|--|------------------------|--------------------|
| | Pakistan | | | | Sri Lanka | | |
| USD 427.000 | Pakistan Government International Bond RegS 8,25% 30/9/2025 | 327.420 | 0,34 | USD 460.000 | Sri Lanka Government International Bond RegS 5,875% 25/7/2022 [*] | 205.810 | 0,21 |
| | | 327.420 | 0,34 | USD 891.000 | Sri Lanka Government International Bond RegS 6,85% 14/3/2024 | 345.262 | 0,36 |
| | Panama | | | USD 419.000 | Sri Lanka Government International Bond RegS 6,35% 28/6/2024 | 162.363 | 0,17 |
| USD 673.000 | Panama Government International Bond 4,00% 22/9/2024 | 680.822 | 0,71 | USD 533.000 | Sri Lanka Government International Bond RegS 6,85% 3/11/2025 | 217.197 | 0,23 |
| | | 680.822 | 0,71 | | | 930.632 | 0,97 |
| | Paraguay | | | | Schweden | | |
| USD 938.000 | Paraguay Government International Bond RegS 4,625% 25/1/2023 [*] | 944.592 | 0,98 | EUR 133.437 | East Renewable AB 13,50% 1/1/2025 | 57.178 | 0,06 |
| | | 944.592 | 0,98 | | | 57.178 | 0,06 |
| | Polen | | | | Türkei | | |
| USD 200.000 | Republic of Poland Government International Bond 4,00% 22/1/2024 | 204.088 | 0,21 | USD 750.000 | Turkey Government International Bond 4,25% 13/3/2025 | 676.335 | 0,70 |
| | | 204.088 | 0,21 | USD 1.577.000 | Turkey Government International Bond 6,375% 14/10/2025 | 1.468.175 | 1,53 |
| | Katar | | | | | 2.144.510 | 2,23 |
| USD 999.000 | Qatar Government International Bond RegS 3,875% 23/4/2023 | 1.011.487 | 1,05 | | Ukraine | | |
| USD 625.000 | Qatar Government International Bond RegS 3,375% 14/3/2024 | 630.625 | 0,65 | USD 2.717.000 | Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2022 | 1.942.655 | 2,02 |
| USD 1.968.000 | Qatar Government International Bond RegS 3,25% 2/6/2026 | 1.974.150 | 2,05 | USD 977.000 | Ukraine Government International Bond RegS 8,994% 1/2/2024 | 404.478 | 0,42 |
| | | 3.616.262 | 3,75 | USD 1.446.000 | Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2025 | 571.170 | 0,59 |
| | Rumänien | | | EUR 531.000 | Ukraine Government International Bond RegS 6,75% 20/6/2026 | 213.313 | 0,22 |
| USD 310.000 | Romanian Government International Bond RegS 4,375% 22/8/2023 | 311.632 | 0,32 | USD 1.607.000 | Ukraine Government International Bond RegS FRN 31/5/2040 | 626.730 | 0,65 |
| EUR 951.000 | Romanian Government International Bond RegS 2,75% 14/4/2041 | 688.223 | 0,72 | | | 3.758.346 | 3,90 |
| | | 999.855 | 1,04 | | Vereinigte Arabische Emirate | | |
| | Russland | | | USD 2.226.000 | Abu Dhabi Government International Bond RegS 2,125% 30/9/2024 [*] | 2.178.369 | 2,26 |
| USD 400.000 | Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 4,875% 16/9/2023 | 114.000 | 0,12 | USD 1.985.000 | Abu Dhabi Government International Bond RegS 2,50% 16/4/2025 [*] | 1.953.052 | 2,03 |
| | | 114.000 | 0,12 | | | 4.131.421 | 4,29 |
| | Saudi-Arabien | | | | Großbritannien | | |
| USD 515.000 | Saudi Government International Bond RegS 2,875% 4/3/2023 | 517.060 | 0,53 | USD 46.100 | State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 Plc RegS 9,375% 10/3/2023 | 24.148 | 0,02 |
| USD 903.000 | Saudi Government International Bond RegS 2,90% 22/10/2025 | 893.970 | 0,93 | | | 24.148 | 0,02 |
| | | 1.411.030 | 1,46 | | Vereinigte Staaten von Amerika | | |
| | Serbien | | | USD 678.000 | United States Treasury Note/Bond 0,125% 31/12/2022 | 672.034 | 0,70 |
| EUR 1.650.000 | Serbia International Bond RegS 1,00% 23/9/2028 | 1.379.503 | 1,43 | USD 7.869.400 | United States Treasury Note/Bond 31/3/2024 (Zero Coupon) [*] | 7.834.818 | 8,13 |
| | | 1.379.503 | 1,43 | | | 8.506.852 | 8,83 |
| | Südafrika | | | | Venezuela | | |
| USD 800.000 | Eskom Holdings SOC Ltd RegS 7,125% 11/2/2025 | 764.400 | 0,79 | USD 471.500 | Petroleos de Venezuela SA RegS 8,50% 27/10/2022 | 94.300 | 0,10 |
| USD 590.000 | Republic of South Africa Government International Bond 4,665% 17/1/2024 | 596.515 | 0,62 | | | | |
| USD 560.000 | Transnet SOC Ltd RegS 4,00% 26/7/2022 | 554.680 | 0,58 | | | | |
| | | 1.915.595 | 1,99 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|
| Venezuela Fortsetzung | | | |
| USD 1.678.200 | Petroleos de Venezuela SA RegS 12,75% 17/2/2023 | 90.203 | 0,09 |
| USD 700.000 | Petroleos de Venezuela SA RegS 6,00% 16/5/2024 | 37.625 | 0,04 |
| USD 1.466.217 | Petroleos de Venezuela SA RegS 9,75% 17/5/2035 | 78.809 | 0,08 |
| USD 602.900 | Venezuela Government International Bond RegS 12,75% 23/8/2022 | 54.261 | 0,06 |
| USD 985.800 | Venezuela Government International Bond RegS 7,75% 13/10/2022 | 88.722 | 0,09 |
| USD 1.473.500 | Venezuela Government International Bond RegS 9,00% 7/5/2023 | 132.615 | 0,14 |
| | | 576.535 | 0,60 |
| Sambia | | | |
| USD 950.000 | Zambia Government International Bond RegS 5,375% 20/9/2022 | 631.750 | 0,66 |
| USD 950.000 | Zambia Government International Bond RegS 8,50% 14/4/2024 | 669.750 | 0,69 |
| | | 1.301.500 | 1,35 |
| | Gesamt Anleihen | 87.345.633 | 90,71 |
| | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | 87.345.633 | 90,71 |
| | Wertpapiervermögen zum Marktwert | 87.345.633 | 90,71 |
| | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 8.950.211 | 9,29 |
| | Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | 96.295.844 | 100,00 |
| ^ Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Marktwert USD |
|--|---------------|---|----------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | USD 7.630.000 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.35 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Morgan Stanley | 20/12/2025 | 410.853 | (249.745) |
| CCCDs | USD 2.452.151 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.36 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Morgan Stanley | 20/6/2026 | 164.038 | (75.853) |
| CCIRS | GBP 560.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,540% | Morgan Stanley | 14/12/2051 | 226.559 | 226.601 |
| CDS | USD 4.000.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Argentine Republic Government International Bond | Morgan Stanley | 20/6/2026 | (693.977) | (2.237.977) |
| | | Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 2.790.176) | | | 107.473 | (2.336.974) |
| CCCDs: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps CDS: Credit Default Swaps | | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn USD |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|------------------------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (8) | EUR | Euro BTP Futures June 2022 | Juni 2022 | 1.087.276 | 152.763 |
| (10) | EUR | Euro Bund Futures June 2022 | Juni 2022 | 1.622.836 | 167.543 |
| (4) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 696.912 | 168.401 |
| (26) | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2022 | September 2022 | 3.804.045 | 67.099 |
| (87) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 10.385.625 | 74.596 |
| (7) | USD | US Ultra Bond Futures September 2022 | September 2022 | 1.086.531 | 20.016 |
| Gesamt | | | | | 650.418 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|-------------|---------|---------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 1.123.886 | USD | 789.537 | State Street Bank & Trust Company | 19/7/2022 | 17.817 |
| BRL | 1.605.747 | USD | 318.297 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2022 | 18.660 |
| CAD | 478.812 | USD | 373.440 | State Street Bank & Trust Company | 19/7/2022 | 5.167 |
| CNH | 510.676 | USD | 75.404 | Morgan Stanley | 19/7/2022 | 1.001 |
| EUR | 2.670.585 | USD | 2.818.703 | HSBC | 19/7/2022 | 49.212 |
| EUR | 446.875 | USD | 475.049 | Morgan Stanley | 19/7/2022 | 4.846 |
| EUR | 30.000 | USD | 31.624 | Standard Chartered Bank | 19/7/2022 | 592 |
| EUR | 40.000 | USD | 42.995 | Toronto Dominion Bank | 19/7/2022 | (39) |
| GBP | 50.000 | USD | 62.099 | Citibank | 19/7/2022 | 863 |
| GBP | 20.000 | USD | 25.132 | State Street Bank & Trust Company | 19/7/2022 | 53 |
| GBP | 50.000 | USD | 62.709 | UBS | 19/7/2022 | 253 |
| HUF | 207.540.975 | USD | 568.065 | Toronto Dominion Bank | 19/7/2022 | (9.262) |
| KRW | 844.330.660 | USD | 665.425 | Morgan Stanley | 19/7/2022 | 14.430 |
| MXN | 15.099.639 | USD | 747.118 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2022 | 16.002 |
| MXN | 9.513.350 | USD | 473.588 | Deutsche Bank | 19/7/2022 | 7.207 |
| NZD | 909.864 | USD | 577.918 | HSBC | 19/7/2022 | 13.749 |
| PLN | 5.953.839 | USD | 1.339.597 | BNP Paribas | 19/7/2022 | 46.703 |
| USD | 236.604 | AUD | 333.880 | UBS | 19/7/2022 | (3.241) |
| USD | 7.934.187 | BRL | 40.026.385 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2022 | (465.145) |
| USD | 370.137 | CAD | 474.577 | State Street Bank & Trust Company | 19/7/2022 | (5.121) |
| USD | 489.546 | CHF | 486.448 | State Street Bank & Trust Company | 19/7/2022 | (18.751) |
| USD | 470.268 | CLP | 393.510.683 | BNP Paribas | 19/7/2022 | (1.446) |
| USD | 422.373 | CNH | 2.823.093 | HSBC | 19/7/2022 | (3) |
| USD | 141.589 | CNH | 958.916 | Morgan Stanley | 19/7/2022 | (1.879) |
| USD | 86.618 | CZK | 2.044.230 | Natwest Markets | 19/7/2022 | (1.460) |
| USD | 7.951.130 | EUR | 7.528.845 | HSBC | 19/7/2022 | (134.024) |
| USD | 21.212 | EUR | 20.000 | JP Morgan | 19/7/2022 | (266) |
| USD | 130.963 | GBP | 105.049 | Morgan Stanley | 19/7/2022 | (1.318) |
| USD | 24.817 | GBP | 20.000 | UBS | 19/7/2022 | (368) |
| USD | 3.728.509 | HUF | 1.362.200.765 | Toronto Dominion Bank | 19/7/2022 | 60.792 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------|---------|----------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 848.649 | IDR | 12.526.068.957 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2022 | (11.618) |
| USD | 459.496 | INR | 35.909.644 | HSBC | 19/7/2022 | (533) |
| USD | 963.121 | JPY | 123.779.417 | HSBC | 19/7/2022 | (35) |
| USD | 264.336 | KRW | 327.314.250 | Citibank | 19/7/2022 | 783 |
| USD | 407.465 | KRW | 517.016.410 | Morgan Stanley | 19/7/2022 | (8.836) |
| USD | 4.185.240 | MXN | 84.585.797 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2022 | (89.642) |
| USD | 85.673 | NZD | 134.882 | HSBC | 19/7/2022 | (2.038) |
| USD | 2.315.952 | PLN | 10.293.246 | BNP Paribas | 19/7/2022 | (80.742) |
| USD | 731.308 | TWD | 21.029.198 | Citibank | 19/7/2022 | 3.629 |
| USD | 2.243.055 | ZAR | 35.685.201 | HSBC | 19/7/2022 | (29.508) |
| ZAR | 12.905.617 | USD | 806.091 | HSBC | 19/7/2022 | 15.785 |
| ZAR | 7.489.655 | USD | 471.363 | JP Morgan | 19/7/2022 | 5.605 |
| | | | | | | (582.126) |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 21.561.430 | USD | 22.862.586 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 249.044 |
| USD | 946.119 | EUR | 895.311 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (13.558) |
| | | | | | | 235.486 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 70.307.126) | | | | | | (346.640) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Staatsanleihen | 77,53 |
| Energie | 5,94 |
| Finanzen | 2,48 |
| Industrie | 2,00 |
| Grundstoffe | 1,97 |
| Versorger | 0,79 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 90,71 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 9,29 |
| <hr/> | |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|----------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Belgien | | | |
| ANLEIHEN | | | | EUR 300.000 | BNP Paribas Fortis SA RegS 24/10/2023 (Zero Coupon) | 296.832 | 0,06 |
| | Australien | | | EUR 600.000 | ING Belgium SA RegS 0,75% 28/9/2026 | 582.408 | 0,11 |
| EUR 800.000 | APA Infrastructure Ltd RegS 0,75% 15/3/2029 | 680.568 | 0,13 | EUR 1.000.000 | KBC Bank NV RegS 0,75% 24/10/2027* | 958.420 | 0,19 |
| EUR 325.000 | APA Infrastructure Ltd RegS 2,00% 15/7/2030 | 290.472 | 0,05 | EUR 2.000.000 | KBC Group NV RegS FRN 21/1/2028 | 1.846.960 | 0,36 |
| EUR 1.000.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd RegS 0,25% 17/3/2025* | 972.130 | 0,19 | EUR 700.000 | KBC Group NV RegS FRN 7/12/2031 | 615.174 | 0,12 |
| EUR 396.000 | Macquarie Group Ltd RegS 0,35% 3/3/2028 | 343.059 | 0,07 | EUR 4.264.029 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,50% 22/10/2024 | 4.250.597 | 0,82 |
| EUR 1.300.000 | National Australia Bank Ltd RegS 0,625% 16/3/2027 | 1.241.409 | 0,24 | EUR 2.165.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,80% 22/6/2025 | 2.165.996 | 0,42 |
| | | 3.527.638 | 0,68 | EUR 585.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 4,50% 28/3/2026 | 665.707 | 0,13 |
| | Österreich | | | EUR 625.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 22/10/2027 (Zero Coupon) | 589.112 | 0,11 |
| EUR 500.000 | BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029 | 494.445 | 0,10 | EUR 650.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,80% 22/6/2028 | 635.752 | 0,12 |
| EUR 1.240.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 20/4/2023 (Zero Coupon) | 1.240.161 | 0,24 | EUR 747.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,90% 22/6/2029 | 726.278 | 0,14 |
| EUR 3.335.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 1,65% 21/10/2024 | 3.423.844 | 0,66 | EUR 630.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 22/10/2031 (Zero Coupon) | 541.397 | 0,10 |
| EUR 755.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,75% 20/10/2026 | 746.665 | 0,14 | EUR 1.190.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,35% 22/6/2032 (traded in Belgium) | 1.040.167 | 0,20 |
| EUR 910.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,50% 20/4/2027 | 885.903 | 0,17 | EUR 250.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,35% 22/6/2032 (traded in Germany) | 218.523 | 0,04 |
| EUR 500.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 20/10/2028 (Zero Coupon) | 459.160 | 0,09 | EUR 2.745.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,25% 22/4/2033* | 2.639.812 | 0,51 |
| EUR 4.306.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,90% 20/2/2032 | 4.014.613 | 0,78 | EUR 263.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,45% 22/6/2037 | 244.816 | 0,05 |
| EUR 110.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 2,40% 23/5/2034 | 117.992 | 0,02 | EUR 1.072.397 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,90% 22/6/2038 | 1.056.161 | 0,20 |
| EUR 400.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,25% 20/10/2036 | 318.500 | 0,06 | EUR 1.605.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,40% 22/6/2040 | 1.195.805 | 0,23 |
| EUR 865.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 4,15% 15/3/2037 | 1.125.815 | 0,22 | EUR 75.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 3,75% 22/6/2045 | 96.053 | 0,02 |
| EUR 180.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 3,15% 20/6/2044 | 222.548 | 0,04 | EUR 775.477 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,60% 22/6/2047 | 680.117 | 0,13 |
| EUR 2.010.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 1,85% 23/5/2049 | 1.970.584 | 0,38 | EUR 690.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,40% 22/6/2053 | 552.400 | 0,11 |
| EUR 990.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,75% 20/3/2051 | 731.660 | 0,14 | EUR 95.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 2,15% 22/6/2066 | 90.536 | 0,02 |
| EUR 158.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 3,80% 26/1/2062 | 234.222 | 0,05 | EUR 807.509 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,65% 22/6/2071 | 414.074 | 0,08 |
| EUR 170.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,70% 20/4/2071 | 98.857 | 0,02 | | | 22.103.097 | 4,27 |
| EUR 116.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 2,10% 20/9/2117 | 107.932 | 0,02 | | | | |
| EUR 125.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,85% 30/6/2120 | 60.410 | 0,01 | | | | |
| | | 16.253.311 | 3,14 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-----------------|---|------------------------|--------------------|-------------------|--|------------------------|--------------------|
| Kanada | | | | Frankreich | | | |
| EUR 2.000.000 | Bank of Nova Scotia RegS 0,01% 15/12/2027 | 1.827.000 | 0,35 | EUR 100.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 0,375% 30/4/2024 | 99.196 | 0,02 |
| EUR 873.000 | Bank of Nova Scotia RegS 0,01% 14/9/2029 | 765.926 | 0,15 | EUR 300.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 1,00% 31/1/2028 | 293.145 | 0,06 |
| EUR 495.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce RegS 0,25% 24/1/2023 | 495.436 | 0,10 | EUR 1.000.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 0,125% 29/9/2031 | 854.650 | 0,16 |
| EUR 1.300.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce RegS 0,375% 10/3/2026 | 1.249.339 | 0,24 | EUR 2.400.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 1,625% 25/5/2032 | 2.333.304 | 0,45 |
| EUR 2.416.000 | CPPIB Capital Inc RegS 0,875% 6/2/2029 | 2.285.971 | 0,44 | EUR 2.400.000 | Agence France Locale RegS 0,20% 20/3/2029 | 2.188.488 | 0,42 |
| EUR 1.600.000 | Royal Bank of Canada RegS 0,125% 26/4/2027 | 1.491.067 | 0,29 | EUR 1.300.000 | AXA Home Loan SFH SA RegS 0,75% 22/10/2026 | 1.259.661 | 0,24 |
| | | 8.114.739 | 1,57 | EUR 800.000 | AXA SA RegS FRN 6/7/2047 | 802.256 | 0,15 |
| Zypern | | | | EUR 200.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,125% 5/2/2024 | 196.508 | 0,04 |
| EUR 84.000 | Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023 | 87.183 | 0,02 | EUR 100.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,01% 7/3/2025 | 95.577 | 0,02 |
| EUR 480.000 | Cyprus Government International Bond RegS 1,50% 16/4/2027 | 472.317 | 0,09 | EUR 1.300.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,25% 19/7/2028 | 1.122.121 | 0,22 |
| EUR 1.489.000 | Cyprus Government International Bond RegS 0,95% 20/1/2032 | 1.264.727 | 0,24 | EUR 800.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,625% 3/11/2028 | 702.496 | 0,13 |
| | | 1.824.227 | 0,35 | EUR 100.000 | BNP Paribas SA RegS 1,00% 17/4/2024 | 99.380 | 0,02 |
| Dänemark | | | | EUR 200.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 15/7/2025 | 194.478 | 0,04 |
| EUR 950.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 17/2/2027 | 908.874 | 0,18 | EUR 750.000 | BNP Paribas SA RegS 1,125% 11/6/2026 | 717.487 | 0,14 |
| DKK 11.504.902 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/10/2053 | 1.243.372 | 0,24 | EUR 300.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 23/1/2027 | 296.394 | 0,06 |
| DKK 5.542.810 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | 612.068 | 0,12 | EUR 900.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 14/10/2027 | 822.150 | 0,16 |
| DKK 6.386.919 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | 726.742 | 0,14 | EUR 700.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 11/7/2030 | 609.714 | 0,12 |
| EUR 200.000 | Orsted A/S RegS FRN 9/12/3019 | 179.700 | 0,03 | EUR 1.300.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 31/3/2032 | 1.239.134 | 0,24 |
| | | 3.670.756 | 0,71 | EUR 700.000 | BPCE SA RegS 0,625% 26/9/2023 | 698.271 | 0,13 |
| Finnland | | | | EUR 400.000 | BPCE SA RegS 0,375% 5/10/2023 | 397.852 | 0,08 |
| EUR 2.500.000 | Finland Government Bond RegS 15/9/2024 (Zero Coupon)^ | 2.466.100 | 0,47 | EUR 500.000 | BPCE SA RegS 1,00% 15/7/2024 | 496.195 | 0,10 |
| EUR 373.000 | Finland Government Bond RegS 0,50% 15/9/2027 | 361.071 | 0,07 | EUR 700.000 | BPCE SA RegS 0,125% 4/12/2024 | 681.030 | 0,13 |
| EUR 2.058.000 | Finland Government Bond RegS 0,125% 15/9/2031 | 1.800.277 | 0,35 | EUR 200.000 | BPCE SA RegS 1,00% 1/4/2025 | 194.824 | 0,04 |
| EUR 5.495.000 | Finland Government Bond RegS 1,50% 15/9/2032 | 5.393.288 | 1,04 | EUR 700.000 | BPCE SA RegS 0,25% 14/1/2031 | 569.849 | 0,11 |
| EUR 380.000 | Finland Government Bond RegS 1,125% 15/4/2034 | 353.708 | 0,07 | EUR 300.000 | BPCE SA RegS FRN 2/3/2032^ | 283.122 | 0,05 |
| EUR 105.000 | Finland Government Bond RegS 0,125% 15/4/2036 | 82.938 | 0,02 | EUR 3.000.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 21/1/2027 | 2.801.580 | 0,54 |
| EUR 410.000 | Finland Government Bond RegS 0,25% 15/9/2040 | 305.007 | 0,06 | EUR 2.000.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 10/11/2027 | 1.837.020 | 0,35 |
| EUR 75.000 | Finland Government Bond RegS 1,375% 15/4/2047 | 67.885 | 0,01 | EUR 1.000.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 23/3/2028 | 911.820 | 0,18 |
| EUR 350.000 | Finland Government Bond RegS 0,125% 15/4/2052 | 209.468 | 0,04 | EUR 2.000.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 16/10/2028 | 1.803.160 | 0,35 |
| EUR 800.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,125% 1/7/2024 | 781.872 | 0,15 | EUR 2.200.000 | BPCE SFH SA RegS 0,75% 23/2/2029 | 2.068.836 | 0,40 |
| EUR 700.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,625% 27/7/2027 | 636.244 | 0,12 | EUR 1.900.000 | BPCE SFH SA RegS 1,125% 12/4/2030 | 1.808.458 | 0,35 |
| EUR 427.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,375% 16/6/2028 | 371.896 | 0,07 | | | | |
| EUR 1.900.000 | OP Mortgage Bank RegS 1,00% 5/10/2027 | 1.847.370 | 0,36 | | | | |
| | | 14.677.124 | 2,83 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Frankreich Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | |
| EUR 200.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 27/5/2030 | 173.872 | 0,03 | EUR 200.000 | FCT Noria '2021-1 C' RegS FRN 25/10/2049 | 194.885 | 0,04 |
| EUR 2.100.000 | BPCE SFH SA RegS 0,125% 3/12/2030 | 1.823.136 | 0,35 | EUR 100.000 | FCT Noria '2021-1 D' RegS FRN 25/10/2049 | 96.303 | 0,02 |
| EUR 1.100.000 | BPCE SFH SA RegS 1,75% 27/5/2032 | 1.080.618 | 0,21 | EUR 100.000 | FCT Pixel '2021-1 D' RegS FRN 25/2/2038 | 97.339 | 0,02 |
| EUR 400.000 | Bpifrance SACA RegS 0,125% 25/11/2023 | 397.536 | 0,08 | EUR 2.100.000 | France Government Bond OAT RegS 1,75% 25/11/2024 | 2.156.847 | 0,42 |
| EUR 600.000 | Caisse Centrale du Credit Immobilier de France SA RegS 0,125% 26/10/2022 | 600.786 | 0,12 | EUR 8.505.000 | France Government Bond OAT RegS 25/3/2025 (Zero Coupon) | 8.329.967 | 1,61 |
| EUR 1.100.000 | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale RegS 1,50% 25/5/2032 | 1.063.381 | 0,20 | EUR 4.490.000 | France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2025 | 4.453.362 | 0,86 |
| EUR 300.000 | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA RegS 0,25% 7/2/2035 | 239.901 | 0,05 | EUR 1.835.000 | France Government Bond OAT RegS 1,00% 25/11/2025 | 1.843.166 | 0,35 |
| EUR 300.000 | Caisse Francaise de Financement Local RegS 0,625% 26/1/2023 | 301.026 | 0,06 | EUR 958.948 | France Government Bond OAT RegS 25/2/2026 (Zero Coupon) | 926.535 | 0,18 |
| EUR 600.000 | Caisse Francaise de Financement Local RegS 0,375% 11/5/2024 | 592.578 | 0,11 | EUR 2.070.000 | France Government Bond OAT RegS 25/2/2027 (Zero Coupon) | 1.967.659 | 0,38 |
| EUR 600.000 | Cie de Financement Foncier SA RegS 0,25% 11/4/2023 | 599.784 | 0,12 | EUR 1.500.000 | France Government Bond OAT RegS 1,50% 25/5/2031^ | 1.501.860 | 0,29 |
| EUR 100.000 | Cie de Financement Foncier SA RegS 0,75% 29/5/2026 | 97.411 | 0,02 | EUR 4.190.000 | France Government Bond OAT RegS 25/11/2031 (Zero Coupon)^ | 3.610.188 | 0,70 |
| EUR 500.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,875% 21/9/2023 | 499.550 | 0,10 | EUR 560.000 | France Government Bond OAT RegS 25/5/2032 (Zero Coupon) | 475.530 | 0,09 |
| EUR 600.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,625% 15/3/2024 | 592.326 | 0,11 | EUR 941.196 | France Government Bond OAT RegS 5,75% 25/10/2032 | 1.311.105 | 0,25 |
| EUR 2.600.000 | Coentreprise de Transport d'Electricite SA RegS 0,875% 29/9/2024 | 2.560.454 | 0,49 | EUR 793.013 | France Government Bond OAT RegS 1,25% 25/5/2034 | 746.638 | 0,14 |
| EUR 400.000 | Coentreprise de Transport d'Electricite SA RegS 2,125% 29/7/2032 | 371.416 | 0,07 | EUR 250.000 | France Government Bond OAT RegS 1,25% 25/5/2038 | 225.870 | 0,04 |
| EUR 500.000 | Credit Agricole Assurances SA RegS 2,00% 17/7/2030 | 432.340 | 0,08 | EUR 335.127 | France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2040 | 258.467 | 0,05 |
| EUR 200.000 | Credit Agricole Assurances SA RegS FRN 27/9/2048 | 207.272 | 0,04 | EUR 7.720.564 | France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/6/2044 (traded in France) | 5.594.707 | 1,08 |
| EUR 800.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA RegS 0,05% 6/12/2029^ | 705.360 | 0,14 | EUR 1.282.500 | France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/6/2044 (traded in Germany) | 929.364 | 0,18 |
| EUR 400.000 | Credit Agricole SA FRN 5/6/2030 | 385.160 | 0,07 | EUR 405.000 | France Government Bond OAT RegS 3,25% 25/5/2045 | 491.386 | 0,09 |
| EUR 700.000 | Credit Agricole SA RegS 0,75% 5/12/2023 | 699.216 | 0,13 | EUR 1.200.000 | France Government Bond OAT RegS 1,50% 25/5/2050 | 1.042.116 | 0,20 |
| EUR 200.000 | Credit Agricole SA RegS 1,375% 13/3/2025 | 197.260 | 0,04 | EUR 5.140.000 | France Government Bond OAT RegS 0,75% 25/5/2052 | 3.551.175 | 0,68 |
| EUR 700.000 | Credit Agricole SA RegS FRN 22/4/2026 | 677.838 | 0,13 | EUR 1.430.000 | France Government Bond OAT RegS 0,75% 25/5/2053 | 967.609 | 0,19 |
| EUR 400.000 | Credit Mutuel - CIC Home Loan SFH SA RegS 0,25% 30/4/2024 | 394.304 | 0,08 | EUR 568.727 | France Government Bond OAT RegS 4,00% 25/4/2060 | 824.375 | 0,16 |
| EUR 600.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,875% 5/10/2023^ | 599.562 | 0,12 | EUR 545.000 | France Government Bond OAT RegS 1,75% 25/5/2066 | 477.322 | 0,09 |
| EUR 900.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,375% 3/10/2028 | 790.128 | 0,15 | EUR 640.000 | France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2072 | 310.886 | 0,06 |
| EUR 300.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,125% 23/5/2029 | 271.533 | 0,05 | EUR 423.465 | Harmony French Home Loans FCT '2021-1 A' RegS FRN 27/5/2061 | 423.468 | 0,08 |
| EUR 2.800.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA RegS 0,625% 4/3/2027 | 2.689.540 | 0,52 | EUR 200.000 | Harmony French Home Loans FCT '2021-1 B' RegS FRN 27/5/2061 | 199.440 | 0,04 |
| EUR 400.000 | Electricite de France SA RegS 1,00% 29/11/2033 | 321.040 | 0,06 | EUR 300.000 | Orange SA RegS 1,00% 12/5/2025 | 294.342 | 0,06 |
| EUR 1.500.000 | Engie SA RegS 0,375% 26/10/2029^ | 1.290.645 | 0,25 | EUR 200.000 | Orange SA RegS 1,00% 12/9/2025 | 195.404 | 0,04 |
| EUR 500.000 | Engie SA RegS 1,375% 21/6/2039 | 368.590 | 0,07 | EUR 200.000 | Orange SA RegS 1,25% 7/7/2027 | 192.560 | 0,04 |
| EUR 100.000 | Engie SA RegS 1,25% 24/10/2041 | 69.471 | 0,01 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Frankreich Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | |
| EUR 200.000 | Orange SA RegS 0,75% 29/6/2034 | 158.754 | 0,03 | EUR 1.480.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 15/8/2052 (Zero Coupon) | 981.965 | 0,19 |
| EUR 100.000 | Orange SA RegS FRN 29/10/2049 | 107.465 | 0,02 | EUR 338.000 | Commerzbank AG 0,05% 9/5/2029 | 302.104 | 0,06 |
| EUR 1.100.000 | RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR RegS 1,625% 8/10/2024 | 1.107.920 | 0,21 | EUR 154.000 | Commerzbank AG RegS 0,125% 23/2/2023 | 153.968 | 0,03 |
| EUR 1.500.000 | Societe Du Grand Paris EPIC RegS 1,625% 8/4/2042 | 1.328.760 | 0,26 | EUR 100.000 | Commerzbank AG RegS 1,25% 23/10/2023 | 99.754 | 0,02 |
| EUR 400.000 | Societe Generale SA FRN 24/11/2030 | 365.680 | 0,07 | EUR 929.000 | Commerzbank AG RegS 0,50% 15/3/2027 | 886.647 | 0,17 |
| EUR 200.000 | Societe Generale SA RegS 0,125% 24/2/2026 | 186.424 | 0,04 | EUR 62.000 | Commerzbank AG RegS 0,625% 24/8/2027 | 59.178 | 0,01 |
| EUR 800.000 | Societe Generale SA RegS FRN 21/4/2026 | 774.128 | 0,15 | EUR 705.000 | Deutsche Bahn Finance GmbH RegS 0,625% 8/12/2050 | 423.895 | 0,08 |
| EUR 200.000 | Societe Generale SA RegS 0,875% 1/7/2026 | 187.632 | 0,04 | EUR 300.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,75% 7/2/2023 | 300.090 | 0,06 |
| EUR 300.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,50% 2/6/2025 | 293.259 | 0,06 | EUR 900.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,125% 5/9/2024^ | 865.818 | 0,17 |
| EUR 300.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,50% 28/1/2026 | 290.832 | 0,06 | EUR 1.400.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 27/10/2025 | 1.303.666 | 0,25 |
| EUR 1.500.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,01% 2/12/2026 | 1.405.815 | 0,27 | EUR 900.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,01% 25/8/2026 | 847.881 | 0,16 |
| EUR 800.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,125% 18/7/2029 | 715.792 | 0,14 | EUR 185.000 | Deutsche Telekom AG RegS 1,75% 9/12/2049 | 140.078 | 0,03 |
| EUR 900.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,01% 11/2/2030 | 787.392 | 0,15 | EUR 543.000 | DZ HYP AG RegS 0,50% 30/9/2026 | 522.008 | 0,10 |
| EUR 400.000 | TotalEnergies Capital International SA RegS 0,696% 31/5/2028 | 371.552 | 0,07 | EUR 2.003.000 | DZ HYP AG RegS 0,01% 26/10/2026 | 1.882.299 | 0,36 |
| EUR 1.000.000 | UNEDIC ASSEO RegS 0,875% 25/5/2028 | 966.320 | 0,19 | EUR 720.000 | DZ HYP AG RegS 0,01% 15/1/2027 | 673.574 | 0,13 |
| EUR 800.000 | UNEDIC ASSEO RegS 1,75% 25/11/2032 | 789.048 | 0,15 | EUR 49.000 | DZ HYP AG RegS 0,01% 27/10/2028 | 44.232 | 0,01 |
| EUR 900.000 | Veolia Environnement SA RegS 0,892% 14/1/2024 | 899.469 | 0,17 | EUR 600.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,625% 3/11/2023 | 604.218 | 0,12 |
| EUR 1.200.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099^ | 1.136.220 | 0,22 | EUR 400.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,113% 15/5/2032 | 346.460 | 0,07 |
| EUR 500.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 436.585 | 0,08 | EUR 2.700.000 | ING-DiBa AG RegS 0,01% 7/10/2028 | 2.441.448 | 0,47 |
| | | 105.570.112 | 20,37 | EUR 12.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,05% 30/5/2024 | 11.886 | 0,00 |
| | Deutschland | | | EUR 60.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,50% 15/9/2027 | 57.718 | 0,01 |
| EUR 900.000 | Bayerische Landesbank RegS FRN 22/11/2032 | 792.729 | 0,15 | EUR 1.774.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,125% 30/6/2025 | 1.734.670 | 0,34 |
| EUR 604.000 | Berlin Hyp AG RegS 0,625% 22/10/2025 | 590.555 | 0,11 | EUR 153.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 30/9/2026 (Zero Coupon) | 146.107 | 0,03 |
| EUR 2.112.000 | Berlin Hyp AG RegS 0,01% 24/8/2026 | 1.991.658 | 0,38 | EUR 1.100.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 1,125% 15/6/2037 | 983.741 | 0,19 |
| EUR 2.000.000 | Berlin Hyp AG RegS 0,01% 24/1/2028 | 1.834.260 | 0,35 | EUR 2.081.000 | Land Baden-Wuerttemberg RegS 0,01% 2/9/2030 | 1.823.476 | 0,35 |
| EUR 1.975.000 | Berlin Hyp AG RegS 0,01% 7/7/2028 | 1.795.275 | 0,35 | EUR 1.525.000 | Land Berlin RegS 0,125% 4/6/2035 | 1.204.094 | 0,23 |
| EUR 25.000 | Berlin Hyp AG RegS 0,01% 2/9/2030 | 21.689 | 0,00 | EUR 600.000 | Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 0,125% 27/6/2023 | 597.990 | 0,12 |
| EUR 5.960.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 15/8/2031 (Zero Coupon) | 5.405.124 | 1,04 | EUR 700.000 | Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 0,875% 15/9/2025 | 690.599 | 0,13 |
| EUR 6.420.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 15/5/2036 (Zero Coupon)^ | 5.357.875 | 1,03 | EUR 600.000 | Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 2,20% 9/5/2029 | 516.234 | 0,10 |
| EUR 1.050.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 1,00% 15/5/2038 | 997.427 | 0,19 | EUR 100.000 | Landesbank Hessen- Thueringen Girozentrale 0,01% 26/9/2029 | 88.584 | 0,02 |
| EUR 870.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 3,25% 4/7/2042 | 1.164.069 | 0,23 | EUR 304.000 | Landwirtschaftliche Rentenbank RegS 0,05% 12/6/2023 | 303.356 | 0,06 |
| EUR 412.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 2,50% 4/7/2044 | 506.900 | 0,10 | EUR 300.000 | LANXESS AG RegS 0,625% 1/12/2029^ | 246.837 | 0,05 |
| EUR 3.355.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 15/8/2050 (Zero Coupon) | 2.312.971 | 0,45 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|---------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Deutschland Fortsetzung | | | | Irland Fortsetzung | | | |
| EUR 400.000 | Muenchener Hypothekenbank eG RegS 2,50% 4/7/2028 | 420.676 | 0,08 | EUR 1.100.000 | AIB Group Plc RegS FRN 4/4/2028 | 1.061.060 | 0,20 |
| EUR 1.100.000 | Norddeutsche Landesbank- Girozentrale RegS 0,01% 23/9/2026 | 1.035.441 | 0,20 | EUR 550.841 | Haus European Loan Conduit No 39 DAC 'A1' RegS FRN 28/7/2051 | 533.283 | 0,10 |
| EUR 1.000.000 | NRW Bank 15/10/2029 (Zero Coupon) | 888.390 | 0,17 | EUR 140.959 | Haus European Loan Conduit No 39 DAC 'C' RegS FRN 2 8/7/2051 | 136.078 | 0,03 |
| EUR 26.000 | NRW Bank 18/2/2030 (Zero Coupon) | 22.917 | 0,00 | EUR 100.971 | Haus European Loan Conduit No 39 DAC 'D' RegS FRN 28/7/2051 | 96.175 | 0,02 |
| EUR 316.000 | NRW Bank RegS 0,875% 10/11/2025 | 312.265 | 0,06 | EUR 1.945.000 | Ireland Government Bond RegS 0,35% 18/10/2032 | 1.694.776 | 0,33 |
| EUR 405.000 | NRW Bank RegS 0,625% 2/2/2029 | 380.502 | 0,07 | EUR 318.195 | Ireland Government Bond RegS 1,30% 15/5/2033 | 304.923 | 0,06 |
| EUR 2.177.000 | NRW Bank RegS 0,25% 26/1/2032 | 1.887.916 | 0,36 | EUR 570.000 | Ireland Government Bond RegS 0,40% 15/5/2035 | 474.599 | 0,09 |
| EUR 2.426.000 | NRW Bank RegS 0,50% 17/6/2041 | 1.840.873 | 0,36 | EUR 300.000 | Ireland Government Bond RegS 1,70% 15/5/2037 | 292.053 | 0,06 |
| EUR 100.000 | Red & Black Auto Germany 8 UG 'C' RegS FRN 15/9/2030 | 97.654 | 0,02 | EUR 230.000 | Ireland Government Bond RegS 0,55% 22/4/2041 | 176.684 | 0,03 |
| EUR 300.000 | Santander Consumer Bank AG RegS 0,25% 5/12/2024 | 293.154 | 0,06 | EUR 65.000 | Ireland Government Bond RegS 2,00% 18/2/2045 | 64.255 | 0,01 |
| EUR 1.900.000 | State of Hesse 0,125% 10/10/2031 | 1.643.747 | 0,32 | EUR 540.000 | Ireland Government Bond RegS 1,50% 15/5/2050 | 465.885 | 0,09 |
| EUR 1.128.000 | State of Hesse RegS 25/4/2025 (Zero Coupon) | 1.092.446 | 0,21 | EUR 572.433 | Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC '1X A' RegS FRN 17/8/2033 | 565.277 | 0,11 |
| EUR 776.000 | State of Lower Saxony RegS 0,125% 7/3/2025 | 756.336 | 0,15 | EUR 146.344 | Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC 'C' RegS FRN 17/8/2033 | 141.332 | 0,03 |
| EUR 637.000 | State of Lower Saxony RegS 0,125% 8/4/2027 | 600.717 | 0,12 | EUR 99.554 | Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC 'D' RegS FRN 17/8/2033 | 97.140 | 0,02 |
| EUR 2.146.000 | State of Lower Saxony RegS 0,01% 25/11/2027 | 1.991.703 | 0,38 | GBP 349.995 | Taurus '2021-UK4X A' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 404.192 | 0,08 |
| EUR 3.242.000 | State of Lower Saxony RegS 0,01% 16/6/2028* | 2.976.156 | 0,57 | GBP 301.226 | Taurus '2021-UK4X C' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 336.911 | 0,06 |
| EUR 840.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,50% 16/2/2027 | 809.248 | 0,16 | GBP 100.271 | Taurus '2021-UK4X D' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 110.017 | 0,02 |
| EUR 3.877.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,60% 4/6/2041 | 3.005.295 | 0,58 | EUR 500.000 | Vita Scientia '2022-1X A' DAC RegS FRN 27/2/2033 | 497.871 | 0,10 |
| EUR 64.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,375% 2/9/2050 | 42.149 | 0,01 | | | 8.117.784 | 1,57 |
| EUR 1.080.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,50% 15/1/2052 | 723.060 | 0,14 | Italien | | | |
| EUR 850.000 | UniCredit Bank AG RegS 0,01% 28/9/2026 | 799.969 | 0,15 | EUR 321.000 | Autoflorence 2 Srl 'B' RegS FRN 24/12/2044 | 318.895 | 0,06 |
| EUR 2.600.000 | UniCredit Bank AG RegS 0,50% 23/2/2027 | 2.483.338 | 0,48 | EUR 100.000 | Autoflorence 2 Srl 'C' RegS FRN 24/12/2044 | 95.822 | 0,02 |
| EUR 200.000 | Vonovia SE RegS 2,375% 25/3/2032 | 183.620 | 0,04 | EUR 100.000 | Autoflorence 2 Srl 'D' RegS FRN 24/12/2044 | 97.637 | 0,02 |
| EUR 700.000 | Vonovia SE RegS 1,00% 16/6/2033 | 531.986 | 0,10 | EUR 138.000 | Brignole Co '2021 B' Srl RegS FRN 24/7/2036 | 134.750 | 0,03 |
| | | 68.874.665 | 13,29 | EUR 201.000 | Cassia '2022-1X B' SRL RegS FRN 22/5/2034 | 201.087 | 0,04 |
| | | | | EUR 1.300.000 | Credit Agricole Italia SpA RegS 0,125% 15/3/2033 | 1.042.873 | 0,20 |
| Island | | | | EUR 450.000 | Credito Emiliano SpA RegS 1,125% 17/1/2024 | 450.585 | 0,09 |
| EUR 325.000 | Iceland Government International Bond RegS 0,10% 20/6/2024 | 316.297 | 0,06 | EUR 300.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,50% 5/3/2024 | 297.591 | 0,06 |
| | | 316.297 | 0,06 | EUR 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 2,125% 26/5/2025 | 199.618 | 0,04 |
| Irland | | | | EUR 1.745.081 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,45% 22/5/2023 | 1.811.656 | 0,35 |
| GBP 499.822 | Agora Securities UK '2021-1X A' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 574.762 | 0,11 | EUR 1.412.023 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,25% 20/11/2023 | 1.465.750 | 0,28 |
| EUR 100.000 | AIB Group Plc RegS FRN 17/11/2027 | 90.511 | 0,02 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------------------|--|------------------------|--------------------|----------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Italien Fortsetzung | | | | Italien Fortsetzung | | | |
| EUR 4.400.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 15/1/2024 (Zero Coupon) | 4.328.280 | 0,83 | EUR 1.185.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,80% 1/3/2041 | 926.149 | 0,18 |
| EUR 4.072.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,45% 15/11/2024 | 4.061.739 | 0,78 | EUR 425.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,75% 1/9/2044 | 515.695 | 0,10 |
| EUR 1.865.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,50% 1/12/2024 | 1.909.965 | 0,37 | EUR 4.412.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,50% 30/4/2045 | 3.126.255 | 0,60 |
| EUR 2.852.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,45% 15/5/2025 | 2.828.785 | 0,55 | EUR 369.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,70% 1/3/2047 | 328.779 | 0,06 |
| EUR 4.795.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,85% 1/7/2025 | 4.804.110 | 0,93 | EUR 642.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,85% 1/9/2049 | 688.680 | 0,13 |
| EUR 410.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,50% 15/11/2025 | 418.643 | 0,08 | EUR 60.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,15% 1/9/2052 | 45.136 | 0,01 |
| EUR 1.379.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,50% 1/2/2026 (traded in Germany) | 1.310.119 | 0,25 | EUR 8.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,80% 12/2/2031 | 6.762 | 0,00 |
| EUR 4.971.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,50% 1/2/2026 (traded in Italy) [^] | 4.722.699 | 0,91 | EUR 350.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,15% 1/3/2072 | 243.856 | 0,05 |
| EUR 2.575.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,50% 1/3/2026 | 2.821.453 | 0,54 | EUR 142.000 | Red & Black Auto Italy Srl 'D' RegS FRN 28/12/2031 | 136.358 | 0,03 |
| EUR 1.300.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,10% 1/4/2027 | 1.230.671 | 0,24 | EUR 672.000 | Snam SpA RegS 1,00% 12/9/2034 | 521.284 | 0,10 |
| EUR 400.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,20% 1/6/2027 | 399.536 | 0,08 | EUR 760.000 | Terna - Rete Elettrica Nazionale RegS 0,375% 25/9/2030 | 632.320 | 0,12 |
| EUR 137.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,05% 1/8/2027 | 135.422 | 0,03 | EUR 200.000 | UniCredit SpA RegS FRN 16/6/2026 | 191.712 | 0,04 |
| EUR 1.670.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,50% 15/7/2028 | 1.482.526 | 0,29 | EUR 485.000 | UniCredit SpA RegS FRN 23/9/2029 | 460.580 | 0,09 |
| EUR 3.438.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,75% 1/9/2028 | 3.885.662 | 0,75 | | | 64.521.272 | 12,45 |
| EUR 615.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,50% 1/3/2030 | 648.954 | 0,12 | Japan | | | |
| EUR 450.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,35% 1/4/2030 | 403.988 | 0,08 | EUR 100.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2,00% 9/7/2040 | 79.702 | 0,02 |
| EUR 395.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,95% 1/8/2030 | 339.463 | 0,06 | | | 79.702 | 0,02 |
| EUR 90.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,65% 1/12/2030 | 81.317 | 0,02 | Jersey | | | |
| EUR 690.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,90% 1/4/2031 | 577.426 | 0,11 | USD 810.000 | Aptiv Plc 4,15% 1/5/2052 | 602.589 | 0,12 |
| EUR 1.350.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,60% 1/8/2031 | 1.087.506 | 0,21 | | | 602.589 | 0,12 |
| EUR 2.820.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,95% 1/12/2031 | 2.329.715 | 0,45 | Litauen | | | |
| EUR 1.580.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,65% 1/3/2032 [^] | 1.395.867 | 0,27 | EUR 600.000 | Lithuania Government International Bond RegS 2,125% 1/6/2032 | 586.476 | 0,11 |
| EUR 200.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,95% 1/6/2032 | 163.042 | 0,03 | | | 586.476 | 0,11 |
| EUR 450.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,50% 1/12/2032 | 421.884 | 0,08 | Luxemburg | | | |
| EUR 1.875.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,45% 1/9/2033 | 1.753.912 | 0,34 | EUR 500.000 | BL Consumer Credit '2021-1 E' RegS FRN 25/9/2038 | 492.366 | 0,10 |
| EUR 1.105.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,35% 1/3/2035 | 1.119.022 | 0,22 | EUR 168.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,20% 28/4/2025 | 164.370 | 0,03 |
| EUR 248.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,25% 1/9/2036 | 219.991 | 0,04 | EUR 3.653.000 | European Financial Stability Facility RegS 15/10/2025 (Zero Coupon) [^] | 3.528.433 | 0,68 |
| EUR 480.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,25% 1/3/2038 | 475.142 | 0,09 | EUR 687.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,40% 31/5/2026 | 667.578 | 0,13 |
| EUR 1.429.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,95% 1/9/2038 | 1.367.553 | 0,26 | EUR 418.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,75% 3/5/2027 | 408.190 | 0,08 |
| EUR 920.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 5,00% 1/8/2039 | 1.120.100 | 0,22 | EUR 3.901.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,05% 17/10/2029 | 3.509.964 | 0,68 |
| EUR 2.810.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,10% 1/3/2040 | 2.712.437 | 0,52 | EUR 1.880.000 | European Financial Stability Facility RegS 20/11/2031 (Zero Coupon) | 1.640.225 | 0,32 |
| EUR 20.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 5,00% 1/9/2040 | 24.513 | 0,00 | EUR 15.000 | European Financial Stability Facility RegS 1,20% 17/2/2045 | 12.885 | 0,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|---|------------------------|--------------------|---------------|--|------------------------|--------------------|
| | Luxemburg Fortsetzung | | | | Niederlande Fortsetzung | | |
| EUR 878.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,70% 20/1/2050 | 640.053 | 0,12 | EUR 1.000.000 | ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025 | 958.150 | 0,19 |
| EUR 460.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,05% 18/1/2052 | 262.011 | 0,05 | EUR 500.000 | ING Groep NV RegS FRN 18/2/2029 | 433.185 | 0,08 |
| EUR 399.000 | HeidelbergCement Finance Luxembourg SA RegS 1,75% 24/4/2028* | 378.579 | 0,07 | EUR 600.000 | ING Groep NV RegS FRN 16/2/2031 | 548.844 | 0,11 |
| EUR 425.000 | Nestle Finance International Ltd RegS 0,375% 3/12/2040 | 283.653 | 0,05 | EUR 2.600.000 | ING Groep NV RegS FRN 26/5/2031 | 2.486.640 | 0,48 |
| EUR 1.355.000 | State of the Grand-Duchy of Luxembourg RegS 14/9/2032 (Zero Coupon) | 1.133.376 | 0,22 | EUR 215.000 | Jubilee Place 'B' RegS FRN 17/1/2059 | 210.775 | 0,04 |
| | | 13.121.683 | 2,53 | EUR 100.000 | Jubilee Place 'C' RegS FRN 17/1/2059 | 98.050 | 0,02 |
| | Niederlande | | | EUR 200.000 | Nationale-Niederlanden Bank NV RegS 0,625% 11/9/2025 | 195.198 | 0,04 |
| EUR 200.000 | Achmea Bank NV RegS 0,01% 16/6/2025 | 192.210 | 0,04 | EUR 1.200.000 | Naturgy Finance BV RegS FRN 31/12/2099* | 1.052.064 | 0,20 |
| EUR 600.000 | Aegon Bank NV RegS 0,01% 16/11/2025 | 571.836 | 0,11 | EUR 617.000 | Niederlandse Waterschapsbank NV RegS 1,50% 15/6/2039 | 571.650 | 0,11 |
| EUR 250.000 | ASML Holding NV RegS 1,625% 28/5/2027 | 248.645 | 0,05 | EUR 1.000.000 | Netherlands Government Bond 15/1/2026 (Zero Coupon) | 968.950 | 0,19 |
| EUR 755.000 | BNG Bank NV RegS 0,125% 19/4/2033 | 628.938 | 0,12 | EUR 1.220.000 | Netherlands Government Bond RegS 2,00% 15/7/2024 | 1.258.235 | 0,24 |
| EUR 300.000 | BP Capital Markets BV RegS 1,467% 21/9/2041 | 219.717 | 0,04 | EUR 2.070.000 | Netherlands Government Bond RegS 15/1/2027 (Zero Coupon) | 1.978.796 | 0,38 |
| EUR 450.000 | Coloplast Finance BV RegS 2,25% 19/5/2027 | 448.996 | 0,09 | EUR 184.050 | Netherlands Government Bond RegS 0,75% 15/7/2027 | 181.665 | 0,04 |
| EUR 300.000 | Cooperatieve Rabobank UA RegS 0,875% 8/2/2028 | 288.603 | 0,06 | EUR 155.904 | Netherlands Government Bond RegS 5,50% 15/1/2028 | 193.731 | 0,04 |
| EUR 200.000 | de Volksbank NV RegS 0,01% 16/9/2024 | 194.144 | 0,04 | EUR 1.125.000 | Netherlands Government Bond RegS 0,25% 15/7/2029 | 1.052.764 | 0,20 |
| EUR 700.000 | de Volksbank NV RegS FRN 4/5/2027 | 691.110 | 0,13 | EUR 2.115.000 | Netherlands Government Bond RegS 15/7/2030 (Zero Coupon) | 1.911.304 | 0,37 |
| EUR 533.793 | Domi '2021-1 A' BV RegS FRN 15/6/2053 | 529.618 | 0,10 | EUR 975.000 | Netherlands Government Bond RegS 2,50% 15/1/2033 | 1.076.215 | 0,21 |
| EUR 774.316 | Dutch Property Finance '2021-2 A' BV RegS FRN 28/4/2059 | 768.991 | 0,15 | EUR 960.000 | Netherlands Government Bond RegS 15/1/2038 (Zero Coupon) | 742.877 | 0,14 |
| EUR 207.000 | Dutch Property Finance '2021-2 B' BV RegS FRN 28/4/2059 | 201.555 | 0,04 | EUR 1.991.000 | Netherlands Government Bond RegS 0,50% 15/1/2040 | 1.650.750 | 0,32 |
| EUR 120.000 | Dutch Property Finance '2021-2 C' BV RegS FRN 28/4/2059 | 115.432 | 0,02 | EUR 937.000 | Netherlands Government Bond RegS 2,75% 15/1/2047 | 1.162.105 | 0,22 |
| EUR 100.000 | EDP Finance BV RegS 1,875% 29/9/2023 | 101.372 | 0,02 | EUR 510.000 | Netherlands Government Bond RegS 15/1/2052 (Zero Coupon) | 322.250 | 0,06 |
| USD 910.000 | Enel Finance International NV 2,65% 10/9/2024 | 829.706 | 0,16 | EUR 600.000 | NN Group NV RegS FRN 8/4/2044 | 620.124 | 0,12 |
| EUR 850.000 | Enel Finance International NV RegS 17/6/2024 (Zero Coupon) | 827.577 | 0,16 | EUR 500.000 | Silver Arrow Athlon NL '2021-1 A' BV RegS FRN 26/4/2031 | 499.850 | 0,10 |
| EUR 150.000 | Enel Finance International NV RegS 1,50% 21/7/2025 | 149.297 | 0,03 | EUR 1.725.000 | TenneT Holding BV RegS 0,50% 9/6/2031 | 1.460.385 | 0,28 |
| EUR 1.100.000 | Enel Finance International NV RegS 17/6/2027 (Zero Coupon) | 984.830 | 0,19 | EUR 950.000 | TenneT Holding BV RegS 0,875% 16/6/2035 | 748.866 | 0,14 |
| EUR 850.000 | Enel Finance International NV RegS 0,875% 28/9/2034 | 647.768 | 0,13 | EUR 813.000 | Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1,625% 18/10/2041 | 633.709 | 0,12 |
| EUR 325.000 | Enexis Holding NV RegS 1,50% 20/10/2023 | 328.253 | 0,06 | EUR 600.000 | Vonovia Finance BV RegS 1,80% 29/6/2025 | 590.946 | 0,11 |
| EUR 125.000 | Heineken NV RegS 2,25% 30/3/2030 | 123.368 | 0,02 | EUR 900.000 | Vonovia Finance BV RegS 1,00% 9/7/2030 | 751.266 | 0,15 |
| EUR 400.000 | Heineken NV RegS 1,75% 7/5/2040 | 318.764 | 0,06 | | | 35.925.909 | 6,93 |
| EUR 1.100.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 1.103.949 | 0,21 | | Neuseeland | | |
| EUR 1.100.000 | ING Bank NV RegS 0,50% 17/2/2027 | 1.051.886 | 0,20 | EUR 495.000 | ANZ New Zealand International Ltd RegS 0,125% 22/9/2023 | 491.267 | 0,09 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Neuseeland Fortsetzung | | | | Portugal Fortsetzung | | |
| EUR 382.000 | ASB Finance Ltd RegS 0,25% 21/5/2031 | 328.478 | 0,06 | EUR 210.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 1,00% 12/4/2052 | 130.448 | 0,02 |
| EUR 807.000 | Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023 | 805.709 | 0,16 | EUR 400.000 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 2 'D' RegS FRN 23/9/2038 | 392.934 | 0,08 |
| EUR 600.000 | Chorus Ltd RegS 0,875% 5/12/2026 | 560.790 | 0,11 | EUR 200.000 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance No 1 'B' RegS FRN 28/10/2040 | 197.397 | 0,04 |
| | | 2.186.244 | 0,42 | EUR 300.000 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance No 1 'C' RegS FRN 28/10/2040 | 286.500 | 0,05 |
| | Norwegen | | | | | 6.485.241 | 1,25 |
| EUR 1.250.000 | DNB Bank ASA RegS 0,05% 14/11/2023 | 1.234.125 | 0,24 | | Rumänien | | |
| EUR 1.452.000 | DNB Boligkreditt AS RegS 0,625% 19/6/2025 | 1.423.526 | 0,27 | EUR 1.400.000 | Romanian Government International Bond RegS 2,125% 7/3/2028 | 1.236.375 | 0,24 |
| EUR 1.113.000 | DNB Boligkreditt AS RegS 0,01% 21/1/2031^ | 950.191 | 0,18 | | | 1.236.375 | 0,24 |
| EUR 873.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,50% 30/1/2025 | 856.291 | 0,17 | | Singapur | | |
| EUR 3.673.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,01% 22/9/2027 | 3.382.686 | 0,65 | EUR 516.000 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd RegS 0,625% 18/4/2025 | 505.285 | 0,10 |
| EUR 150.000 | Telenor ASA RegS 25/9/2023 (Zero Coupon) | 148.365 | 0,03 | | | 505.285 | 0,10 |
| EUR 330.000 | Telenor ASA RegS 2,50% 22/5/2025 | 338.811 | 0,07 | | Slowakei | | |
| | | 8.333.995 | 1,61 | EUR 800.000 | Slovakia Government Bond RegS 1,00% 14/5/2032 | 730.664 | 0,14 |
| | Polen | | | EUR 350.000 | Slovakia Government Bond RegS 2,00% 17/10/2047 | 313.173 | 0,06 |
| EUR 300.000 | mBank Hipoteczny SA RegS 1,073% 5/3/2025 | 297.849 | 0,06 | EUR 100.000 | Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,25% 26/3/2024 | 98.587 | 0,02 |
| EUR 98.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 1,00% 25/10/2028 | 91.679 | 0,02 | EUR 500.000 | Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,01% 23/6/2025 | 478.708 | 0,09 |
| EUR 725.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 2,75% 25/5/2032 | 725.680 | 0,14 | | | 1.621.132 | 0,31 |
| | | 1.115.208 | 0,22 | | Slowenien | | |
| | Portugal | | | EUR 400.000 | Slovenia Government Bond RegS 0,275% 14/1/2030 | 354.138 | 0,07 |
| EUR 85.658 | Ares Lusitani-STC SA / Pelican Finance 2 'C' RegS FRN 25/1/2035 | 84.280 | 0,02 | EUR 470.000 | Slovenia Government Bond RegS 0,875% 15/7/2030 | 431.313 | 0,08 |
| EUR 342.634 | Ares Lusitani-STC SA / Pelican Finance 2 'D' RegS FRN 25/1/2035 | 338.308 | 0,06 | | | 785.451 | 0,15 |
| EUR 300.000 | Banco Santander Totta SA RegS 1,25% 26/9/2027 | 295.071 | 0,06 | | Spanien | | |
| EUR 300.000 | EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 30/4/2079 | 307.056 | 0,06 | EUR 400.000 | Autonomia Spain 2021 FT 'B' RegS FRN 31/1/2039 | 392.877 | 0,08 |
| EUR 200.000 | EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 20/7/2080 | 185.346 | 0,04 | EUR 100.000 | Autonomia Spain 2021 FT 'D' RegS FRN 31/1/2039 | 96.337 | 0,02 |
| EUR 435.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,95% 25/10/2023 | 463.410 | 0,09 | EUR 100.000 | Autonomia Spain 2021 FT 'E' RegS FRN 31/1/2039 | 97.295 | 0,02 |
| EUR 885.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 5,65% 15/2/2024^ | 960.668 | 0,19 | EUR 100.000 | Autonomia Spain 2021 FT 'F' RegS FRN 31/1/2039 | 96.909 | 0,02 |
| EUR 1.085.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 2,875% 15/10/2025 | 1.148.776 | 0,22 | EUR 600.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS 1,00% 21/6/2026 | 575.562 | 0,11 |
| EUR 729.737 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,125% 14/4/2027 | 822.691 | 0,16 | EUR 600.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 24/3/2026 | 585.696 | 0,11 |
| EUR 178.532 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 0,70% 15/10/2027 | 171.184 | 0,03 | EUR 2.300.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 11/3/2027^ | 2.175.639 | 0,42 |
| EUR 470.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 0,90% 12/10/2035 | 389.668 | 0,07 | EUR 400.000 | Banco de Sabadell SA RegS 0,125% 10/2/2028 | 365.672 | 0,07 |
| EUR 340.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 1,15% 11/4/2042 | 260.902 | 0,05 | EUR 200.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 16/6/2028 | 172.502 | 0,03 |
| EUR 41.200 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,10% 15/2/2045 | 50.602 | 0,01 | EUR 500.000 | Banco Santander SA RegS 0,875% 9/5/2031 | 455.920 | 0,09 |
| | | | | EUR 600.000 | CaixaBank SA RegS 0,375% 3/2/2025 | 577.680 | 0,11 |
| | | | | EUR 500.000 | CaixaBank SA RegS FRN 18/11/2026 | 466.190 | 0,09 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------------------|--|------------------------|--------------------|--|---|------------------------|--------------------|
| Spanien Fortsetzung | | | | Supranationale Anleihen Fortsetzung | | | |
| GBP 500.000 | CaixaBank SA RegS FRN 6/4/2028 | 573.912 | 0,11 | EUR 5.279.000 | European Investment Bank 17/6/2027 (Zero Coupon) | 4.961.257 | 0,96 |
| EUR 600.000 | Iberdrola Finanzas SA RegS 0,875% 16/6/2025 | 590.448 | 0,11 | EUR 1.828.000 | European Investment Bank 0,20% 17/3/2036 | 1.442.639 | 0,28 |
| EUR 200.000 | Iberdrola Finanzas SA RegS 1,25% 28/10/2026 | 197.100 | 0,04 | EUR 764.000 | European Investment Bank 1,50% 15/11/2047 | 697.922 | 0,13 |
| EUR 4.810.000 | Spain Government Bond 30/4/2023 (Zero Coupon) | 4.804.805 | 0,93 | EUR 45.000 | European Investment Bank RegS 0,375% 15/5/2026 | 43.722 | 0,01 |
| EUR 800.000 | Spain Government Bond 31/5/2024 (Zero Coupon) | 788.600 | 0,15 | EUR 56.000 | European Investment Bank RegS 0,875% 14/1/2028 | 54.793 | 0,01 |
| EUR 1.650.000 | Spain Government Bond 31/1/2025 (Zero Coupon) | 1.605.928 | 0,31 | EUR 3.135.000 | European Investment Bank RegS 28/3/2028 (Zero Coupon) | 2.903.010 | 0,56 |
| EUR 1.465.000 | Spain Government Bond 31/1/2026 (Zero Coupon) | 1.397.669 | 0,27 | EUR 4.485.000 | European Investment Bank RegS 1,50% 15/6/2032 | 4.408.082 | 0,85 |
| EUR 1.065.000 | Spain Government Bond RegS 4,80% 31/1/2024 | 1.139.422 | 0,22 | EUR 2.377.000 | European Investment Bank RegS 0,25% 15/6/2040 | 1.758.576 | 0,34 |
| EUR 2.116.000 | Spain Government Bond RegS 2,75% 31/10/2024 | 2.211.982 | 0,43 | EUR 75.000 | European Investment Bank RegS 0,01% 15/5/2041 | 52.136 | 0,01 |
| EUR 1.455.000 | Spain Government Bond RegS 1,60% 30/4/2025 | 1.477.058 | 0,28 | EUR 172.254 | European Stability Mechanism RegS 14/3/2025 (Zero Coupon) | 167.720 | 0,03 |
| EUR 1.330.000 | Spain Government Bond RegS 4,65% 30/7/2025 | 1.475.249 | 0,28 | EUR 114.000 | European Stability Mechanism RegS 0,75% 15/3/2027 | 111.340 | 0,02 |
| EUR 755.000 | Spain Government Bond RegS 2,15% 31/10/2025 | 780.104 | 0,15 | EUR 559.000 | European Union RegS 4/7/2035 (Zero Coupon) | 435.355 | 0,08 |
| EUR 2.054.000 | Spain Government Bond RegS 1,95% 30/4/2026 | 2.104.097 | 0,41 | EUR 929.000 | European Union RegS 0,40% 4/2/2037 | 750.121 | 0,15 |
| EUR 450.000 | Spain Government Bond RegS 0,80% 30/7/2027 | 433.602 | 0,08 | | | 18.573.686 | 3,58 |
| EUR 500.000 | Spain Government Bond RegS 1,40% 30/4/2028 | 493.875 | 0,09 | Schweden | | | |
| EUR 1.041.000 | Spain Government Bond RegS 0,60% 31/10/2029 | 954.066 | 0,18 | EUR 100.000 | Lansforsakringar Hypotek AB RegS 0,625% 29/1/2026 | 97.199 | 0,02 |
| EUR 3.240.000 | Spain Government Bond RegS 0,50% 30/4/2030 | 2.913.440 | 0,56 | EUR 945.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 0,05% 1/7/2024 | 920.392 | 0,18 |
| EUR 1.538.000 | Spain Government Bond RegS 1,95% 30/7/2030 | 1.539.984 | 0,30 | EUR 845.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 0,125% 18/6/2024 | 826.004 | 0,16 |
| EUR 1.305.000 | Spain Government Bond RegS 1,25% 31/10/2030 | 1.231.894 | 0,24 | EUR 800.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 1,375% 23/2/2029 | 744.192 | 0,14 |
| EUR 3.740.000 | Spain Government Bond RegS 0,70% 30/4/2032 | 3.233.679 | 0,62 | EUR 725.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS FRN 1/6/2033 | 723.528 | 0,14 |
| EUR 1.909.000 | Spain Government Bond RegS 2,35% 30/7/2033 | 1.918.602 | 0,37 | EUR 796.000 | Swedbank AB RegS 0,25% 2/11/2026 | 736.770 | 0,14 |
| EUR 1.270.000 | Spain Government Bond RegS 1,85% 30/7/2035 | 1.184.313 | 0,23 | EUR 925.000 | Swedbank AB RegS 1,30% 17/2/2027 | 875.337 | 0,17 |
| EUR 325.000 | Spain Government Bond RegS 4,20% 31/1/2037 | 394.459 | 0,08 | EUR 950.000 | Swedbank AB RegS FRN 20/5/2027 | 875.368 | 0,17 |
| EUR 1.310.000 | Spain Government Bond RegS 0,85% 30/7/2037 | 1.026.346 | 0,20 | | | 5.798.790 | 1,12 |
| EUR 1.490.000 | Spain Government Bond RegS 4,90% 30/7/2040 | 1.998.403 | 0,39 | Schweiz | | | |
| EUR 800.000 | Spain Government Bond RegS 1,20% 31/10/2040 | 629.888 | 0,12 | EUR 2.636.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028 | 2.318.045 | 0,45 |
| EUR 117.000 | Spain Government Bond RegS 4,70% 30/7/2041 | 154.135 | 0,03 | EUR 500.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2032 | 460.365 | 0,09 |
| EUR 1.227.000 | Spain Government Bond RegS 1,00% 30/7/2042 | 912.998 | 0,18 | EUR 2.010.000 | UBS Group AG RegS FRN 29/1/2026 | 1.912.475 | 0,37 |
| EUR 5.000 | Spain Government Bond RegS 1,00% 31/10/2050 | 3.237 | 0,00 | EUR 925.000 | UBS Group AG RegS FRN 3/11/2026 | 863.099 | 0,16 |
| EUR 2.730.000 | Spain Government Bond RegS 1,90% 31/10/2052 | 2.159.730 | 0,42 | | | 5.553.984 | 1,07 |
| EUR 761.000 | Spain Government Bond RegS 3,45% 30/7/2066 | 818.806 | 0,16 | Großbritannien | | | |
| EUR 240.000 | Spain Government Bond RegS 1,45% 31/10/2071 | 141.854 | 0,03 | EUR 2.098.000 | Barclays Plc RegS FRN 9/6/2025 | 2.039.445 | 0,39 |
| | | 47.347.964 | 9,14 | EUR 700.000 | Barclays Plc RegS FRN 24/1/2026 | 679.588 | 0,13 |
| Supranationale Anleihen | | | | GBP 100.000 | Barley Hill NO 2 Plc 'B' RegS FRN 27/8/2058 | 117.053 | 0,02 |
| EUR 400.000 | African Development Bank 0,50% 21/3/2029 | 373.459 | 0,07 | EUR 150.000 | BP Capital Markets Plc RegS 1,231% 8/5/2031 | 133.540 | 0,03 |
| EUR 433.000 | European Investment Bank 0,10% 15/10/2026 | 413.554 | 0,08 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | |
| EUR 795.000 | British Telecommunications Plc RegS 1,00% 21/11/2024 | 782.455 | 0,15 | EUR 527.000 | National Grid Electricity Transmission Plc RegS 0,823% 7/7/2032 | 428.367 | 0,08 |
| EUR 1.100.000 | Cadent Finance Plc RegS 0,625% 19/3/2030 | 924.385 | 0,18 | EUR 800.000 | National Grid Plc RegS 2,949% 30/3/2030 | 797.880 | 0,15 |
| EUR 410.000 | Cadent Finance Plc RegS 0,75% 11/3/2032 | 329.099 | 0,06 | EUR 279.000 | Nationwide Building Society RegS 0,25% 14/9/2028 | 242.669 | 0,05 |
| GBP 113.000 | Canada Square Funding '2021-2 B' Plc RegS FRN 17/6/2058 | 129.521 | 0,03 | EUR 1.200.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 26/2/2030 | 1.025.904 | 0,20 |
| GBP 100.000 | Canada Square Funding '2021-2 C' Plc RegS FRN 17/6/2058 | 114.556 | 0,02 | GBP 136.000 | Newday Funding Master Issuer Plc '2021-3X B' RegS FRN 15/11/2029 | 158.234 | 0,03 |
| GBP 115.000 | Canada Square Funding 'C' RegS FRN 17/1/2059 | 129.387 | 0,03 | GBP 400.000 | Pierpont BTL '2021-1 B' Plc RegS FRN 22/12/2053 | 456.976 | 0,09 |
| GBP 130.000 | Canada Square Funding 'D' RegS FRN 17/1/2059 | 145.622 | 0,03 | GBP 366.000 | Polaris '2022-1 B' Plc RegS FRN 23/10/2059 | 426.647 | 0,08 |
| EUR 800.000 | Diageo Finance Plc RegS 0,125% 12/10/2023 | 792.488 | 0,15 | GBP 136.000 | Polaris '2022-1 D' Plc RegS FRN 23/10/2059 | 158.628 | 0,03 |
| GBP 200.000 | Dowson '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/10/2028 | 231.975 | 0,05 | GBP 298.000 | Polaris '2022-1 E' Plc RegS FRN 23/10/2059 | 344.420 | 0,07 |
| GBP 200.000 | Dowson '2021-2 C' Plc RegS FRN 20/10/2028 | 229.519 | 0,04 | EUR 875.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 13/9/2029 | 753.007 | 0,15 |
| GBP 103.000 | Dowson '2022-1 B' Plc RegS FRN 20/1/2029 | 120.660 | 0,02 | EUR 125.000 | Santander UK Plc 0,10% 12/5/2024 | 122.750 | 0,02 |
| GBP 520.000 | Economic Master Issuer Plc '2021-1X A' RegS FRN 25/6/2073 | 604.758 | 0,12 | GBP 184.000 | Satus '2021-1 B' Plc RegS FRN 17/8/2028 | 213.669 | 0,04 |
| GBP 556.256 | Elvet Mortgages '2020-1 A' Plc FRN 22/3/2065 | 651.983 | 0,13 | GBP 226.000 | Satus '2021-1 C' Plc RegS FRN 17/8/2028 | 259.943 | 0,05 |
| GBP 831.922 | Elvet Mortgages '2021-1 A' Plc FRN 22/10/2063 | 972.004 | 0,19 | GBP 100.000 | Satus '2021-1 D' Plc RegS FRN 17/8/2028 | 113.464 | 0,02 |
| GBP 551.843 | Finsbury Square '2021-1GRX AGRN' RegS FRN 16/12/2067 | 628.762 | 0,12 | GBP 142.000 | Satus '2021-1 E' Plc RegS FRN 17/8/2028 | 163.819 | 0,03 |
| GBP 272.000 | Finsbury Square '2021-1GRX B' RegS FRN 16/12/2067 | 308.571 | 0,06 | EUR 452.000 | Sky Ltd RegS 1,875% 24/11/2023 | 458.518 | 0,09 |
| GBP 233.000 | Finsbury Square '2021-1GRX C' RegS FRN 16/12/2067 | 259.452 | 0,05 | EUR 2.125.000 | SSE Plc RegS FRN 31/12/2099 | 2.056.511 | 0,40 |
| GBP 785.616 | Finsbury Square '2021-2X A' Plc RegS FRN 16/12/2071 | 902.757 | 0,17 | USD 660.000 | Standard Chartered Plc RegS FRN 23/3/2025* | 586.887 | 0,11 |
| GBP 217.000 | Finsbury Square '2021-2X B' Plc RegS FRN 16/12/2071 | 247.589 | 0,05 | GBP 100.000 | Stanlington No 2 Plc 'E' RegS FRN 12/6/2056 | 112.587 | 0,02 |
| GBP 109.000 | Finsbury Square '2021-2X C' Plc RegS FRN 16/12/2071 | 121.138 | 0,02 | EUR 400.000 | Swiss Re Finance UK Plc RegS FRN 4/6/2052 | 347.032 | 0,07 |
| GBP 100.000 | Finsbury Square '2021-2X D' Plc RegS FRN 16/12/2071 | 110.331 | 0,02 | GBP 100.000 | Together Asset Backed Securitisation '2021-1ST1 B' Plc RegS FRN 12/7/2063 | 113.445 | 0,02 |
| GBP 242.139 | Gemgarto '2021-1X X' Plc RegS FRN 16/12/2067 | 286.010 | 0,06 | GBP 99.999 | Tower Bridge Funding '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 113.809 | 0,02 |
| EUR 250.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 23/9/2023 (Zero Coupon) | 247.560 | 0,05 | GBP 99.999 | Tower Bridge Funding '2021-2 D' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 113.374 | 0,02 |
| EUR 206.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,375% 2/12/2024 | 206.729 | 0,04 | GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2022-1X B' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 113.598 | 0,02 |
| GBP 389.000 | Harben Finance '2017-1RX B' RegS FRN 28/9/2055 | 437.507 | 0,08 | GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2022-1X C' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 112.699 | 0,02 |
| GBP 181.000 | Harben Finance '2017-1RX C' RegS FRN 28/9/2055 | 201.688 | 0,04 | GBP 492.190 | Twin Bridges '2021-2 A' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 562.345 | 0,11 |
| GBP 179.000 | Harben Finance '2017-1RX D' RegS FRN 28/9/2055 | 198.218 | 0,04 | GBP 137.000 | Twin Bridges '2021-2 B' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 152.720 | 0,03 |
| GBP 100.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2021-1 C' Plc Regs FRN 20/7/2058 | 111.982 | 0,02 | GBP 100.000 | Twin Bridges '2021-2 D' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 109.515 | 0,02 |
| GBP 386.626 | London Wall Mortgage Capital Plc '2021-FL1 A' RegS FRN 15/5/2051 | 448.596 | 0,09 | GBP 76.426 | Twin Bridges '2021-2 X1' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 89.649 | 0,02 |
| GBP 100.000 | Mortimer BTL '2021-1 C' Plc RegS FRN 23/6/2053 | 113.416 | 0,02 | GBP 500.000 | Twin Bridges '2022-1 A' Plc RegS FRN 1/12/2055 | 574.239 | 0,11 |
| EUR 425.000 | Motability Operations Group Plc RegS 0,125% 20/7/2028 | 376.444 | 0,07 | GBP 263.000 | Twin Bridges '2022-1 B' Plc RegS FRN 1/12/2055 | 295.316 | 0,06 |
| | | | | GBP 100.000 | Twin Bridges '2022-1 D' Plc RegS FRN 1/12/2055 | 110.178 | 0,02 |
| | | | | | | 26.023.587 | 5,02 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------------------|--|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| EUR 1.000.000 | Air Products and Chemicals Inc 0,80% 5/5/2032 | 845.700 | 0,16 | EUR 200.000 | Morgan Stanley FRN 26/7/2024 | 198.918 | 0,04 |
| EUR 680.000 | American Tower Corp 0,95% 5/10/2030 | 559.885 | 0,11 | EUR 325.000 | National Grid North America Inc RegS 0,75% 8/8/2023 | 323.898 | 0,06 |
| EUR 100.000 | American Tower Corp 1,00% 15/1/2032 | 79.313 | 0,02 | USD 865.000 | Oracle Corp 3,60% 1/4/2050 | 583.225 | 0,11 |
| USD 505.000 | American Tower Corp 4,05% 15/3/2032 | 444.147 | 0,09 | EUR 150.000 | PepsiCo Inc 1,05% 9/10/2050 | 99.372 | 0,02 |
| EUR 225.000 | American Tower Corp 1,25% 21/5/2033 | 177.800 | 0,03 | EUR 270.000 | Verizon Communications Inc 0,875% 19/3/2032 | 230.027 | 0,04 |
| EUR 700.000 | Booking Holdings Inc 0,10% 8/3/2025 | 669.193 | 0,13 | | | 12.460.856 | 2,40 |
| USD 1.900.000 | Citigroup Inc FRN 17/3/2033 | 1.663.196 | 0,32 | | | 505.915.179 | 97,63 |
| EUR 273.000 | Coca-Cola Co 0,95% 6/5/2036 | 219.197 | 0,04 | Gesamt Anleihen | | | |
| EUR 509.000 | Eli Lilly & Co 1,375% 14/9/2061 | 318.206 | 0,06 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| EUR 1.650.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 2,00% 1/11/2028 | 1.583.670 | 0,31 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| EUR 1.500.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 0,875% 9/5/2029 | 1.319.220 | 0,25 | Irland | | | |
| EUR 411.000 | International Business Machines Corp 1,75% 7/3/2028 | 402.577 | 0,08 | 74.523 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc)^ | 7.321.551 | 1,42 |
| EUR 272.000 | International Flavors & Fragrances Inc 1,80% 25/9/2026 | 266.098 | 0,05 | | | 7.321.551 | 1,42 |
| USD 260.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 26/4/2033 | 247.473 | 0,05 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| EUR 395.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 11/3/2027 | 379.121 | 0,07 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | |
| EUR 1.925.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 23/3/2030 | 1.850.620 | 0,36 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | |
| | | | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | | |
| | | | | | | 513.236.730 | 99,05 |
| | | | | | | 4.946.802 | 0,95 |
| | | | | | | 518.183.532 | 100,00 |

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

- Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9.

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|---|----------------------------------|--------------------|---|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | EUR 7.941.180 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (22.477) | 46.498 |
| CCILS | EUR 879.000 | Fund receives Fixed 2,481% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2037 | (15.454) | (15.431) |
| CCILS | GBP 310.000 | Fund receives Fixed 3,650% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2031 | (57.289) | (64.371) |
| CCILS | GBP 990.000 | Fund receives Fixed 3,718% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (71.511) | (185.462) |
| CCILS | GBP 510.000 | Fund receives Fixed 3,810% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (37.540) | (89.165) |
| CCILS | GBP 510.000 | Fund receives Fixed 3,850% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (37.845) | (86.392) |
| CCILS | GBP 1.235.000 | Fund receives Fixed 4,005% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2031 | (94.175) | (164.995) |
| CCILS | GBP 750.000 | Fund receives Fixed 4,262% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (60.160) | (58.639) |
| CCILS | GBP 1.000.000 | Fund receives Fixed 4,324% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2032 | (53.134) | (53.109) |
| CCILS | GBP 340.000 | Fund receives Fixed 4,328% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2032 | (20.747) | (20.738) |
| CCILS | GBP 940.000 | Fund receives Fixed 4,371% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2032 | (43.805) | (43.781) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|----------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCILS | GBP 530.000 | Fund receives Fixed 4,435% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (43.986) | (28.552) |
| CCILS | GBP 1.775.000 | Fund receives Fixed 4,810% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2026 | (127.254) | (117.060) |
| CCILS | EUR 2.410.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,018% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 30.158 | 30.186 |
| CCILS | GBP 1.775.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,070% | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2024 | 122.808 | 123.923 |
| CCILS | GBP 990.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,100% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2027 | 14.885 | 14.948 |
| CCIRS | EUR 3.160.000 | Fund receives Fixed 0,088% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (373.560) | (453.896) |
| CCIRS | EUR 13.150.000 | Fund receives Fixed -0,103% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2026 | (732.981) | (829.984) |
| CCIRS | EUR 3.260.000 | Fund receives Fixed 0,180% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (391.696) | (443.017) |
| CCIRS | EUR 15.000.000 | Fund receives Fixed 0,282% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2024 | (174.100) | (176.751) |
| CCIRS | EUR 6.180.000 | Fund receives Fixed 0,424% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2027 | (301.967) | (301.906) |
| CCIRS | EUR 2.600.000 | Fund receives Fixed 0,547% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/3/2029 | (183.077) | (183.041) |
| CCIRS | EUR 770.000 | Fund receives Fixed 0,624% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 10/2/2029 | (49.928) | (49.918) |
| CCIRS | EUR 3.470.000 | Fund receives Fixed 0,730% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (312.256) | (312.090) |
| CCIRS | EUR 3.130.000 | Fund receives Fixed 0,813% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (245.169) | (245.115) |
| CCIRS | EUR 1.670.000 | Fund receives Fixed 0,817% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (130.282) | (130.256) |
| CCIRS | EUR 3.980.000 | Fund receives Fixed 0,906% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2037 | (568.750) | (568.666) |
| CCIRS | EUR 8.400.000 | Fund receives Fixed 1,284% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 29/4/2027 | (88.151) | (88.069) |
| CCIRS | EUR 1.300.000 | Fund receives Fixed 1,566% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 29/4/2032 | (33.057) | (33.034) |
| CCIRS | EUR 6.300.000 | Fund receives Fixed 1,699% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (41.611) | (41.514) |
| CCIRS | EUR 3.155.000 | Fund receives Fixed 1,762% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (4.709) | (4.660) |
| CCIRS | EUR 5.710.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,538% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2027 | 247.828 | 247.884 |
| CCIRS | EUR 640.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,581% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2072 | 189.845 | 189.872 |
| CCIRS | GBP 120.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,280% | Bank of America Merrill Lynch | 1/4/2072 | 24.796 | 24.804 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 5.467.727) | | | | | (3.686.351) | (4.111.497) |

CCDCS: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps
 CCILS: Zentral abgewickelte inflationsgebundene Swaps
 CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|----------------------|-----------------|--|---------------|---|---|
| 261 | AUD | 90 Day Bank Bill Futures December 2022 | Dezember 2022 | 173.591.881 | (540.567) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (199) | EUR | Euro BOBL Futures June 2022 | Juni 2022 | 25.153.600 | 799.282 |
| 40 | EUR | Euro BTP Futures June 2022 | Juni 2022 | 4.379.600 | (100.218) |
| 36 | EUR | Euro BTP Futures June 2022 | Juni 2022 | 4.567.320 | (394.530) |
| (92) | EUR | Euro Bund Futures June 2022 | Juni 2022 | 13.937.080 | 219.063 |
| 1 | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 162.640 | (5.322) |
| 125 | EUR | Euro Schatz Futures June 2022 | Juni 2022 | 13.761.875 | (169.871) |
| (155) | EUR | Euro-OAT Futures June 2022 | Juni 2022 | 22.323.100 | 586.520 |
| (2) | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2022 | September 2022 | 273.156 | 4.442 |
| (27) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 3.235.590 | 34.116 |
| (63) | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 6.638.616 | 31.213 |
| (7) | USD | US Ultra Bond Futures September 2022 | September 2022 | 1.014.265 | 4.789 |
| Gesamt | | | | | 468.917 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|-----------------------|-------------|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 3.410.000 | Call | OTC USD/CNH | HSBC | USD 6,90 | 18/08/2022 | (6.087) | 12.249 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 622.179) | | | | | | (6.087) | 12.249 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|-----------------------|-------------|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (3.410.000) | Call | OTC USD/CNH | HSBC | USD 7,10 | 18/08/2022 | 2.285 | (4.714) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 220.666) | | | | | | 2.285 | (4.714) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|------------|---------|------------|-------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 870.000 | EUR | 587.131 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | (5.051) |
| CNH | 4.245.000 | USD | 647.572 | Citibank | 15/6/2022 | (11.055) |
| DKK | 3.970.000 | EUR | 533.710 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | (68) |
| EUR | 175.046 | AUD | 260.000 | Bank of America Merrill Lynch | 14/7/2022 | 1.090 |
| EUR | 229.932 | AUD | 340.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 2.453 |
| EUR | 273.298 | AUD | 400.000 | Royal Bank of Canada | 14/7/2022 | 5.676 |
| EUR | 3.085.664 | DKK | 22.950.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 756 |
| EUR | 486.470 | GBP | 415.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (1.029) |
| EUR | 485.281 | GBP | 415.000 | Societe Generale | 15/6/2022 | (2.218) |
| EUR | 1.489.516 | GBP | 1.265.000 | Chartered Bank | 15/6/2022 | 3.525 |
| EUR | 15.970.214 | GBP | 13.340.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 322.200 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|------------|---------|------------|-----------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 1.301.913 | NOK | 12.600.000 | HSBC | 15/6/2022 | 54.129 |
| EUR | 208.023 | NZD | 330.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 8.132 |
| EUR | 74.602 | SEK | 770.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 1.478 |
| EUR | 400.000 | USD | 440.844 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (11.274) |
| EUR | 2.000.000 | USD | 2.201.271 | HSBC | 15/6/2022 | (53.622) |
| EUR | 400.000 | USD | 444.544 | JP Morgan | 15/6/2022 | (14.726) |
| EUR | 1.180.000 | USD | 1.282.235 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (16.229) |
| EUR | 6.464.550 | USD | 7.060.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | (111.522) |
| GBP | 420.000 | EUR | 494.429 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (1.056) |
| GBP | 417.500 | EUR | 489.321 | JP Morgan | 15/6/2022 | 1.115 |
| GBP | 790.000 | EUR | 925.999 | JP Morgan | 14/7/2022 | 683 |
| NOK | 12.600.000 | EUR | 1.280.969 | Natwest Markets | 15/6/2022 | (33.185) |
| NOK | 12.300.000 | USD | 1.359.100 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (49.863) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|---|-----------|---------|------------|-------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| NZD | 1.290.000 | USD | 893.809 | Bank of America | 15/6/2022 | (50.896) |
| NZD | 1.310.000 | USD | 900.694 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | (45.181) |
| USD | 1.334.323 | CNH | 8.490.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 58.662 |
| USD | 1.247.166 | EUR | 1.180.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | (16.488) |
| USD | 1.256.767 | EUR | 1.190.000 | HSBC | 15/6/2022 | (17.530) |
| USD | 833.352 | EUR | 780.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | (2.545) |
| USD | 877.413 | EUR | 830.000 | Societe Generale | 15/6/2022 | (11.439) |
| USD | 540.000 | EUR | 501.413 | Standard Chartered Bank | 15/6/2022 | 1.572 |
| USD | 1.388.340 | NOK | 12.300.000 | JP Morgan | 14/7/2022 | 77.142 |
| USD | 907.834 | NZD | 1.310.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 51.841 |
| USD | 842.422 | NZD | 1.290.000 | HSBC | 15/6/2022 | 2.955 |
| USD | | | | Morgan Stanley | 15/6/2022 | |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 57.835.292) | | | | | | 138.432 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|---------------------------------------|--------------|
| Staatsanleihen | 54,91 |
| Finanzen | 30,29 |
| Versorger | 5,01 |
| Mit Hypotheken besicherte Wertpapiere | 3,38 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 1,42 |
| Asset Backed Securities (ABS) | 1,13 |
| Kommunikation | 1,00 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 0,79 |
| Industrie | 0,36 |
| Grundstoffe | 0,26 |
| Technologie | 0,24 |
| Energie | 0,14 |
| Zyklische Konsumgüter | 0,12 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 99,05 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 0,95 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|-------------------|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Frankreich | | | |
| ANLEIHEN | | | | EUR 300.000 | AXA SA RegS FRN 4/7/2043 | 312.198 | 0,12 |
| | Australien | | | EUR 400.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,125% 5/2/2024 | 393.016 | 0,15 |
| EUR 675.000 | APA Infrastructure Ltd RegS 0,75% 15/3/2029 | 574.230 | 0,22 | EUR 200.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 2,625% 18/3/2024 | 204.954 | 0,08 |
| EUR 850.000 | APA Infrastructure Ltd RegS 2,00% 15/7/2030 | 759.696 | 0,30 | EUR 600.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,01% 7/3/2025 | 573.462 | 0,22 |
| EUR 513.000 | Macquarie Group Ltd RegS 0,35% 3/3/2028 | 444.417 | 0,17 | EUR 2.800.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,25% 29/6/2028 | 2.487.856 | 0,96 |
| EUR 136.000 | Telstra Corp Ltd RegS 1,375% 26/3/2029 | 129.064 | 0,05 | EUR 600.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,25% 19/7/2028 | 517.902 | 0,20 |
| EUR 475.000 | Toyota Finance Australia Ltd RegS 0,064% 13/1/2025* | 456.812 | 0,18 | EUR 300.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,625% 21/2/2031 | 247.614 | 0,10 |
| | | 2.364.219 | 0,92 | EUR 900.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 15/7/2025 | 875.151 | 0,34 |
| | Österreich | | | EUR 400.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 4/6/2026 | 380.352 | 0,15 |
| EUR 1.100.000 | BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029 | 1.087.779 | 0,42 | EUR 1.400.000 | BNP Paribas SA RegS 1,125% 11/6/2026 | 1.339.310 | 0,52 |
| EUR 200.000 | Kommunalkredit Austria AG RegS 0,25% 14/5/2024 | 193.580 | 0,08 | EUR 1.900.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 14/10/2027* | 1.735.650 | 0,67 |
| | | 1.281.359 | 0,50 | EUR 1.200.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 30/5/2028 | 1.079.352 | 0,42 |
| | Belgien | | | EUR 2.000.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 11/7/2030 | 1.742.040 | 0,68 |
| EUR 400.000 | Ageas SA RegS FRN 31/12/2099 | 347.856 | 0,13 | EUR 1.200.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 31/3/2032 | 1.143.816 | 0,44 |
| EUR 400.000 | Belfius Bank SA RegS 0,375% 8/6/2027 | 362.216 | 0,14 | EUR 900.000 | BPCE SA RegS 0,625% 26/9/2023 | 897.777 | 0,35 |
| EUR 600.000 | Belfius Bank SA RegS FRN 6/4/2034 | 503.034 | 0,19 | EUR 200.000 | BPCE SA RegS 0,375% 5/10/2023 | 198.926 | 0,08 |
| EUR 100.000 | Elia System Operator SA RegS 1,375% 14/1/2026 | 98.117 | 0,04 | EUR 800.000 | BPCE SA RegS 1,00% 15/7/2024 | 793.912 | 0,31 |
| EUR 200.000 | Elia Transmission Belgium SA RegS 1,375% 7/4/2027 | 193.950 | 0,08 | EUR 1.000.000 | BPCE SA RegS 0,125% 4/12/2024 | 972.900 | 0,38 |
| EUR 300.000 | KBC Group NV RegS 0,75% 18/10/2023 | 299.310 | 0,12 | EUR 800.000 | BPCE SA RegS FRN 15/9/2027 | 734.296 | 0,28 |
| EUR 1.700.000 | KBC Group NV RegS FRN 10/9/2026 | 1.584.757 | 0,61 | EUR 600.000 | BPCE SA RegS FRN 14/1/2028 | 544.992 | 0,21 |
| EUR 400.000 | KBC Group NV RegS FRN 31/12/2099 | 375.800 | 0,15 | EUR 1.000.000 | BPCE SA RegS 0,25% 14/1/2031 | 814.070 | 0,32 |
| | | 3.765.040 | 1,46 | EUR 100.000 | BPCE SA RegS FRN 2/3/2032 | 94.374 | 0,04 |
| | Kanada | | | EUR 1.200.000 | BPCE SA RegS FRN 13/10/2046 | 942.216 | 0,37 |
| EUR 1.700.000 | Bank of Nova Scotia RegS 0,01% 14/9/2029 | 1.491.495 | 0,58 | EUR 600.000 | BPCE SFH SA RegS 1,125% 12/4/2030 | 571.092 | 0,22 |
| EUR 400.000 | Royal Bank of Canada RegS 0,125% 23/7/2024 | 389.932 | 0,15 | EUR 200.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 27/5/2030 | 173.872 | 0,07 |
| | | 1.881.427 | 0,73 | EUR 900.000 | Capgemini SE RegS 2,50% 1/7/2023 | 914.373 | 0,35 |
| | Dänemark | | | EUR 800.000 | Capgemini SE RegS 1,00% 18/10/2024 | 789.352 | 0,31 |
| EUR 918.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 15/5/2031 | 828.605 | 0,32 | EUR 100.000 | Capgemini SE RegS 2,00% 15/4/2029 | 97.479 | 0,04 |
| DKK 1 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | — | 0,00 | EUR 900.000 | Capgemini SE RegS 1,125% 23/6/2030^ | 811.071 | 0,31 |
| EUR 1.800.000 | Orsted A/S RegS FRN 9/12/3019^ | 1.617.300 | 0,63 | EUR 136.000 | Carrefour SA RegS 1,75% 15/7/2022 | 136.030 | 0,05 |
| | | 2.445.905 | 0,95 | EUR 1.100.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,625% 15/3/2024^ | 1.085.931 | 0,42 |
| | Finnland | | | EUR 200.000 | Credit Agricole Assurances SA RegS FRN 27/9/2048 | 207.272 | 0,08 |
| EUR 857.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,375% 29/8/2023^ | 852.672 | 0,33 | EUR 600.000 | Credit Agricole SA FRN 5/6/2030 | 577.740 | 0,22 |
| EUR 625.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,625% 27/7/2027 | 568.075 | 0,22 | | | | |
| EUR 452.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,375% 16/6/2028 | 393.670 | 0,15 | | | | |
| EUR 500.000 | OP Mortgage Bank RegS 1,00% 5/10/2027 | 486.150 | 0,19 | | | | |
| EUR 671.000 | OP Mortgage Bank RegS 0,625% 15/2/2029 | 626.801 | 0,24 | | | | |
| | | 2.927.368 | 1,13 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|---|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Frankreich Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | |
| EUR 1.100.000 | Credit Agricole SA RegS 0,75% 5/12/2023 [*] | 1.098.768 | 0,43 | EUR 1.600.000 | Valeo RegS 1,00% 3/8/2028 [*] | 1.308.080 | 0,51 |
| EUR 400.000 | Credit Agricole SA RegS FRN 22/4/2026 | 387.336 | 0,15 | EUR 600.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 523.902 | 0,20 |
| EUR 1.100.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,875% 5/10/2023 | 1.099.197 | 0,43 | EUR 900.000 | Vinci SA RegS 1,625% 18/1/2029 | 866.304 | 0,34 |
| EUR 900.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,375% 3/10/2028 | 790.128 | 0,31 | | | 45.428.885 | 17,60 |
| EUR 700.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,125% 23/5/2029 [*] | 633.577 | 0,25 | | Deutschland | | |
| EUR 400.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,75% 18/1/2030 | 346.640 | 0,13 | EUR 1.000.000 | BASF SE RegS 0,101% 5/6/2023 [*] | 994.830 | 0,38 |
| EUR 400.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 3,375% 11/3/2031 | 383.576 | 0,15 | EUR 2.400.000 | Bayerische Landesbank RegS FRN 22/11/2032 | 2.113.944 | 0,82 |
| EUR 1.100.000 | Danone SA RegS 1/12/2025 (Zero Coupon) [^] | 1.036.288 | 0,40 | EUR 129.000 | Berlin Hyp AG RegS 0,75% 26/2/2026 | 126.228 | 0,05 |
| EUR 300.000 | Electricite de France SA RegS 1,00% 29/11/2033 | 240.780 | 0,09 | EUR 461.000 | Berlin Hyp AG RegS 0,01% 24/8/2026 | 434.732 | 0,17 |
| EUR 600.000 | Electricite de France SA RegS FRN 31/12/2099 | 475.230 | 0,18 | EUR 2.200.000 | Bertelsmann SE & Co KGaA RegS FRN 23/4/2075 [^] | 2.201.672 | 0,85 |
| EUR 100.000 | Electricite de France SA RegS FRN 31/12/2099 | 96.690 | 0,04 | EUR 1.120.000 | Commerzbank AG 0,05% 9/5/2029 | 1.001.056 | 0,39 |
| EUR 600.000 | Engie SA RegS 1,25% 24/10/2041 | 416.826 | 0,16 | EUR 500.000 | Commerzbank AG RegS 1,25% 23/10/2023 | 498.770 | 0,19 |
| EUR 300.000 | Faurecia SE RegS 2,75% 15/2/2027 | 258.141 | 0,10 | EUR 205.000 | Commerzbank AG RegS 0,625% 24/8/2027 | 195.670 | 0,08 |
| EUR 769.000 | Faurecia SE RegS 3,75% 15/6/2028 | 674.436 | 0,26 | EUR 1.400.000 | Commerzbank AG RegS FRN 29/12/2031 | 1.199.254 | 0,46 |
| EUR 1.400.000 | La Banque Postale SA RegS FRN 2/8/2032 [*] | 1.188.712 | 0,46 | EUR 200.000 | Deutsche Bahn Finance GmbH RegS 0,625% 8/12/2050 | 120.254 | 0,05 |
| EUR 700.000 | Orange SA RegS 1,00% 12/5/2025 [^] | 686.798 | 0,27 | EUR 274.000 | Deutsche Bahn Finance GMBH RegS 1,125% 29/5/2051 | 190.534 | 0,07 |
| EUR 800.000 | Orange SA RegS 1,00% 12/9/2025 [^] | 781.616 | 0,30 | EUR 3.000.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/5/2028 | 2.989.650 | 1,16 |
| EUR 300.000 | Orange SA RegS 1,875% 12/9/2030 | 289.440 | 0,11 | EUR 1.200.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/6/2032 | 1.152.576 | 0,45 |
| EUR 200.000 | Orange SA RegS 0,50% 4/9/2032 | 164.144 | 0,06 | EUR 700.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,75% 7/2/2023 | 700.210 | 0,27 |
| EUR 400.000 | Orange SA RegS 0,75% 29/6/2034 | 317.508 | 0,12 | EUR 900.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,125% 5/9/2024 [*] | 865.818 | 0,33 |
| EUR 500.000 | Orange SA RegS FRN 29/12/2049 | 525.355 | 0,20 | EUR 400.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 17/1/2025 | 380.560 | 0,15 |
| EUR 50.000 | RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR RegS 3,875% 28/6/2022 | 50.144 | 0,02 | EUR 400.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 27/10/2025 | 372.476 | 0,14 |
| EUR 700.000 | RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR RegS 1,625% 8/10/2024 | 705.040 | 0,27 | EUR 35.000 | DZ HYP AG RegS 0,375% 31/3/2026 | 33.708 | 0,01 |
| EUR 300.000 | RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR RegS 0,75% 12/1/2034 | 249.858 | 0,10 | EUR 150.000 | E.ON SE RegS 1,00% 7/10/2025 | 146.630 | 0,06 |
| EUR 300.000 | Schneider Electric SE RegS 12/6/2023 (Zero Coupon) | 298.092 | 0,12 | EUR 800.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,625% 3/11/2023 | 805.624 | 0,31 |
| EUR 400.000 | Societe Generale SA FRN 24/11/2030 | 365.680 | 0,14 | EUR 300.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,875% 10/6/2025 | 300.501 | 0,12 |
| EUR 1.000.000 | Societe Generale SA RegS 0,875% 1/7/2026 [*] | 938.160 | 0,36 | EUR 800.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,113% 15/5/2032 | 692.920 | 0,27 |
| EUR 600.000 | Societe Generale SA RegS FRN 23/2/2028 | 596.220 | 0,23 | EUR 300.000 | Eurogrid GmbH RegS 0,741% 21/4/2033 | 239.409 | 0,09 |
| EUR 1.600.000 | Societe Generale SA RegS FRN 22/9/2028 [*] | 1.450.496 | 0,56 | EUR 500.000 | Evonik Industries AG RegS 0,625% 18/9/2025 | 476.580 | 0,18 |
| EUR 500.000 | Terega SA RegS 0,875% 17/9/2030 | 402.620 | 0,16 | EUR 2.490.000 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 1,875% 31/3/2028 | 2.282.409 | 0,88 |
| EUR 396.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 29/12/2049 | 388.234 | 0,15 | EUR 165.000 | Fresenius SE & Co KGaA RegS 1,125% 28/1/2033 | 131.865 | 0,05 |
| EUR 197.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 29/12/2049 | 193.050 | 0,07 | EUR 600.000 | Hamburg Commercial Bank AG RegS FRN 22/9/2026 | 558.366 | 0,22 |
| EUR 922.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 811.471 | 0,31 | EUR 1.562.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,000% 10/1/2031 | 1.363.782 | 0,53 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------------------|--|------------------------|--------------------|----------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Deutschland Fortsetzung | | | | Italien Fortsetzung | | | |
| EUR 1.100.000 | Landesbank Baden-Wuerttemberg RegS 2,20% 9/5/2029 | 946.429 | 0,37 | EUR 209.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,75% 20/3/2028 | 195.860 | 0,08 |
| EUR 400.000 | LANXESS AG RegS 0,625% 1/12/2029 [^] | 329.116 | 0,13 | EUR 395.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS FRN 31/12/2099 | 357.151 | 0,14 |
| EUR 675.000 | Mercedes-Benz Group AG RegS 0,75% 11/3/2033 | 560.675 | 0,22 | EUR 200.000 | Iren SpA RegS 1,00% 1/7/2030 | 170.542 | 0,07 |
| EUR 500.000 | Merck Financial Services GmbH RegS 0,005% 15/12/2023 [^] | 494.620 | 0,19 | EUR 300.000 | Iren SpA RegS 0,25% 17/1/2031 | 234.660 | 0,09 |
| EUR 200.000 | Merck Financial Services GmbH RegS 0,125% 16/7/2025 | 191.558 | 0,07 | EUR 700.000 | Italgas SpA RegS 0,875% 24/4/2030 | 599.270 | 0,23 |
| EUR 200.000 | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen RegS FRN 26/5/2049 | 194.064 | 0,07 | EUR 700.000 | Italgas SpA RegS 1,00% 11/12/2031 | 583.821 | 0,23 |
| EUR 1.379.000 | State of North Rhine-Westphalia Germany RegS 0,125% 4/6/2031 | 1.202.654 | 0,47 | EUR 2.264.000 | Snam SpA RegS 0,75% 17/6/2030 | 1.937.758 | 0,75 |
| EUR 100.000 | Vonovia SE RegS 2,375% 25/3/2032 | 91.810 | 0,04 | EUR 775.000 | Terna - Rete Elettrica Nazionale RegS 0,375% 23/6/2029 [^] | 675.180 | 0,26 |
| EUR 800.000 | Vonovia SE RegS 1,00% 16/6/2033 | 607.984 | 0,24 | EUR 700.000 | UniCredit SpA RegS FRN 16/6/2026 | 670.992 | 0,26 |
| | | 27.188.938 | 10,53 | EUR 1.060.000 | UniCredit SpA RegS 1,625% 18/1/2032 | 884.602 | 0,34 |
| | | | | | | 12.622.275 | 4,89 |
| Griechenland | | | | Japan | | | |
| EUR 100.000 | Alpha Bank SA RegS 2,50% 5/2/2023 | 101.317 | 0,04 | EUR 1.508.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 1,00% 9/7/2029 | 1.355.436 | 0,52 |
| | | 101.317 | 0,04 | EUR 766.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2,00% 9/7/2040 [^] | 610.517 | 0,24 |
| | | | | EUR 673.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd RegS 2,25% 21/11/2026 | 676.015 | 0,26 |
| | | | | | | 2.641.968 | 1,02 |
| Irland | | | | Jersey | | | |
| EUR 300.000 | AIB Group Plc RegS 1,25% 28/5/2024 | 297.090 | 0,11 | EUR 500.000 | Aptiv Plc 1,50% 10/3/2025 | 493.100 | 0,19 |
| EUR 350.000 | AIB Group Plc RegS 2,25% 3/7/2025 | 350.049 | 0,14 | EUR 500.000 | Aptiv Plc 1,60% 15/9/2028 [^] | 461.103 | 0,18 |
| EUR 200.000 | AIB Group Plc RegS FRN 17/11/2027 | 181.022 | 0,07 | USD 745.000 | Aptiv Plc 4,15% 1/5/2052 | 554.233 | 0,22 |
| EUR 1.175.000 | AIB Group Plc RegS FRN 4/4/2028 | 1.133.405 | 0,44 | | | 1.508.436 | 0,59 |
| EUR 400.000 | Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 25/11/2025 | 386.564 | 0,15 | Luxemburg | | | |
| EUR 575.000 | Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 10/5/2027 | 520.927 | 0,20 | EUR 600.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0,334% 13/8/2028 | 523.146 | 0,20 |
| EUR 975.000 | Eaton Capital Unlimited Co RegS 0,128% 8/3/2026 [^] | 905.580 | 0,35 | EUR 325.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1,213% 12/2/2036 [^] | 250.315 | 0,10 |
| EUR 400.000 | Linde Plc RegS 1,00% 30/9/2051 | 245.532 | 0,09 | EUR 497.000 | DH Europe Finance II Sarl 1,35% 18/9/2039 [^] | 374.395 | 0,14 |
| EUR 109.000 | Zurich Finance Ireland Designated Activity Co RegS FRN 17/9/2050 | 94.155 | 0,04 | EUR 974.000 | GELF Bond Issuer I SA RegS 1,125% 18/7/2029 | 823.079 | 0,32 |
| | | 4.114.324 | 1,59 | EUR 759.000 | HeidelbergCement Finance Luxembourg SA RegS 1,75% 24/4/2028 [^] | 720.154 | 0,28 |
| Italien | | | | EUR 410.000 | Nestle Finance International Ltd RegS 0,375% 3/12/2040 | 273.642 | 0,11 |
| EUR 375.000 | A2A SpA RegS 1,50% 16/3/2028 | 351.165 | 0,14 | EUR 900.000 | Repsol Europe Finance Sarl RegS 0,875% 6/7/2033 | 729.873 | 0,28 |
| EUR 100.000 | Assicurazioni Generali SpA RegS 2,124% 1/10/2030 | 87.122 | 0,03 | EUR 525.000 | Segro Capital Sarl RegS 1,875% 23/3/2030 | 487.352 | 0,19 |
| EUR 921.000 | ASTM SpA RegS 1,625% 8/2/2028 | 833.873 | 0,32 | EUR 425.000 | Segro Capital Sarl RegS 0,50% 22/9/2031 | 341.789 | 0,13 |
| EUR 700.000 | ASTM SpA RegS 2,375% 25/11/2033 [^] | 573.055 | 0,22 | EUR 450.000 | SES SA RegS FRN 31/12/2099 | 405.887 | 0,16 |
| EUR 775.000 | Eni SpA RegS 0,375% 14/6/2028 | 692.207 | 0,27 | | | 4.929.632 | 1,91 |
| EUR 1.023.000 | Hera SpA RegS 0,25% 3/12/2030 | 813.070 | 0,31 | Niederlande | | | |
| EUR 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 2,125% 26/5/2025 | 199.618 | 0,08 | EUR 200.000 | Achmea Bank NV RegS 0,01% 16/6/2025 | 192.210 | 0,07 |
| EUR 1.805.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,00% 19/11/2026 [^] | 1.679.607 | 0,65 | EUR 1.356.000 | Adecco International Financial Services BV RegS 0,125% 21/9/2028 [^] | 1.157.943 | 0,45 |
| EUR 1.221.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,75% 16/3/2028 | 1.082.722 | 0,42 | EUR 947.000 | ASML Holding NV RegS 3,375% 19/9/2023 | 979.652 | 0,38 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|---------------|--|------------------------|--------------------|
| | Niederlande Fortsetzung | | | | Niederlande Fortsetzung | | |
| EUR 169.000 | BMW Finance NV RegS 0,50% 22/11/2022 | 169.509 | 0,07 | EUR 225.000 | RELX Finance BV RegS 0,50% 10/3/2028 | 202.444 | 0,08 |
| EUR 554.000 | BMW Finance NV RegS 24/3/2023 (Zero Coupon) | 552.748 | 0,21 | EUR 325.000 | Sagax Euro Mtn NL BV RegS 0,75% 26/1/2028 | 268.203 | 0,10 |
| EUR 715.000 | BMW Finance NV RegS 1,00% 14/11/2024 | 709.509 | 0,28 | EUR 600.000 | Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 20/2/2023 (Zero Coupon) | 599.934 | 0,23 |
| EUR 278.000 | BMW Finance NV RegS 1,00% 29/8/2025 | 273.844 | 0,11 | EUR 300.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 273.039 | 0,11 |
| EUR 1.000.000 | BMW Finance NV RegS 0,75% 13/7/2026 [*] | 964.000 | 0,37 | EUR 300.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 300.900 | 0,12 |
| EUR 675.000 | Coloplast Finance BV RegS 2,25% 19/5/2027 | 673.495 | 0,26 | EUR 600.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 586.254 | 0,23 |
| EUR 150.000 | CRH Funding BV RegS 1,625% 5/5/2030 | 138.055 | 0,05 | EUR 950.000 | TenneT Holding BV RegS 0,50% 9/6/2031 | 804.270 | 0,31 |
| EUR 300.000 | de Volksbank NV RegS 0,01% 16/9/2024 [*] | 291.216 | 0,11 | EUR 900.000 | TenneT Holding BV RegS 0,875% 16/6/2035 | 709.452 | 0,28 |
| EUR 800.000 | de Volksbank NV RegS FRN 4/5/2027 | 789.840 | 0,31 | EUR 1.385.000 | Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1,625% 18/10/2041 [*] | 1.079.566 | 0,42 |
| EUR 1.000.000 | de Volksbank NV RegS FRN 22/10/2030 | 949.340 | 0,37 | EUR 1.235.000 | Toyota Motor Finance Netherlands BV RegS 27/10/2025 (Zero Coupon) [*] | 1.161.456 | 0,45 |
| EUR 400.000 | Diageo Capital BV RegS 0,125% 28/9/2028 [*] | 353.500 | 0,14 | EUR 400.000 | Vonovia Finance BV RegS 1,125% 14/9/2034 [*] | 292.904 | 0,11 |
| EUR 200.000 | Digital Dutch Finco BV RegS 1,25% 1/2/2031 | 159.408 | 0,06 | EUR 400.000 | Vonovia Finance BV RegS 1,625% 7/10/2039 | 281.216 | 0,11 |
| EUR 242.000 | EDP Finance BV RegS 1,625% 26/1/2026 | 239.251 | 0,09 | EUR 1.200.000 | Vonovia Finance BV RegS 1,00% 28/1/2041 | 745.908 | 0,29 |
| USD 1.248.000 | Enel Finance International NV 2,65% 10/9/2024 | 1.137.883 | 0,44 | EUR 300.000 | Wintershall Dea Finance 2 BV RegS FRN 31/12/2099 | 241.116 | 0,09 |
| EUR 1.450.000 | Enel Finance International NV RegS 17/6/2027 (Zero Coupon) | 1.298.185 | 0,50 | | | 31.750.596 | 12,30 |
| EUR 550.000 | Enel Finance International NV RegS 0,875% 28/9/2034 | 419.144 | 0,16 | | Neuseeland | | |
| EUR 200.000 | Enel Finance International NV RegS 1,125% 17/10/2034 | 159.342 | 0,06 | EUR 2.114.000 | Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023 [*] | 2.110.617 | 0,82 |
| EUR 348.000 | Givaudan Finance Europe BV RegS 1,625% 22/4/2032 [*] | 314.400 | 0,12 | EUR 535.000 | Chorus Ltd RegS 0,875% 5/12/2026 | 500.038 | 0,19 |
| EUR 100.000 | Heineken NV RegS 2,25% 30/3/2030 | 98.694 | 0,04 | | | 2.610.655 | 1,01 |
| EUR 459.000 | Heineken NV RegS 1,75% 7/5/2040 | 365.782 | 0,14 | | Norwegen | | |
| GBP 100.000 | Holcim Sterling Finance Netherlands BV RegS 3,00% 12/5/2032 | 107.255 | 0,04 | EUR 1.100.000 | DNB Bank ASA RegS FRN 31/5/2026 | 1.092.817 | 0,42 |
| EUR 1.100.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 1.020.437 | 0,40 | EUR 700.000 | DNB Bank ASA RegS FRN 18/1/2028 | 646.695 | 0,25 |
| EUR 600.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 [*] | 599.736 | 0,23 | EUR 200.000 | DNB Boligkreditt AS RegS 0,625% 14/1/2026 | 194.716 | 0,07 |
| EUR 700.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 702.513 | 0,27 | EUR 500.000 | DNB Boligkreditt AS RegS 0,01% 8/10/2027 | 459.750 | 0,18 |
| EUR 600.000 | ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025 | 574.890 | 0,22 | EUR 250.000 | Telenor ASA RegS 25/9/2023 (Zero Coupon) | 247.275 | 0,10 |
| EUR 2.000.000 | ING Groep NV RegS FRN 18/2/2029 | 1.732.740 | 0,67 | | | 2.641.253 | 1,02 |
| EUR 900.000 | ING Groep NV RegS FRN 16/2/2031 | 823.266 | 0,32 | | Portugal | | |
| EUR 2.800.000 | ING Groep NV RegS FRN 26/5/2031 | 2.677.920 | 1,04 | EUR 300.000 | EDP - Energias de Portugal SA RegS 1,625% 15/4/2027 | 292.119 | 0,11 |
| EUR 300.000 | Koninklijke DSM NV RegS 0,625% 23/6/2032 | 250.347 | 0,10 | EUR 200.000 | EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 14/3/2082 [*] | 170.426 | 0,07 |
| EUR 508.000 | Mercedes-Benz International Finance BV RegS 0,85% 28/2/2025 | 499.933 | 0,19 | EUR 100.000 | EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 14/3/2082 | 78.435 | 0,03 |
| EUR 260.000 | Mercedes-Benz International Finance BV RegS 1,00% 11/11/2025 | 255.057 | 0,10 | | | 540.980 | 0,21 |
| EUR 1.000.000 | Nationale-Nederlanden Bank NV 0,50% 21/9/2028 | 869.150 | 0,34 | | Singapur | | |
| EUR 1.600.000 | Naturgy Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 1.402.752 | 0,54 | EUR 2.400.000 | DBS Group Holdings Ltd RegS FRN 11/4/2028 | 2.397.714 | 0,93 |
| EUR 310.000 | Nederlandse Gasunie NV RegS 1,00% 11/5/2026 | 300.988 | 0,12 | | | 2.397.714 | 0,93 |
| | | | | | Spanien | | |
| | | | | EUR 800.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 24/3/2026 | 780.928 | 0,30 |
| | | | | EUR 1.500.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 11/3/2027 | 1.418.895 | 0,55 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------------------|--|------------------------|--------------------|----------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Spanien Fortsetzung | | | | Schweiz Fortsetzung | | | |
| EUR 500.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 16/6/2028 | 431.255 | 0,17 | EUR 675.000 | UBS Group AG RegS FRN 3/11/2026 | 629.829 | 0,24 |
| EUR 600.000 | Banco de Sabadell SA RegS 2,50% 15/4/2031 ¹ | 534.114 | 0,21 | EUR 1.575.000 | UBS Group AG RegS FRN 5/11/2028 | 1.387.260 | 0,54 |
| EUR 300.000 | Banco Santander SA RegS 1,375% 14/12/2022 | 302.142 | 0,12 | | | 7.335.705 | 2,84 |
| EUR 800.000 | Banco Santander SA RegS FRN 31/12/2099 | 640.696 | 0,25 | Großbritannien | | | |
| EUR 300.000 | CaixaBank SA RegS 0,375% 3/2/2025 | 288.840 | 0,11 | EUR 2.205.000 | Barclays Plc RegS FRN 9/6/2025 | 2.143.458 | 0,83 |
| EUR 600.000 | CaixaBank SA RegS 1,125% 27/3/2026 | 577.686 | 0,22 | EUR 500.000 | Barclays Plc RegS FRN 24/1/2026 | 485.420 | 0,19 |
| EUR 800.000 | CaixaBank SA RegS FRN 18/11/2026 | 745.904 | 0,29 | GBP 149.000 | Barclays Plc RegS 3,00% 8/5/2026 | 170.604 | 0,07 |
| GBP 600.000 | CaixaBank SA RegS FRN 6/4/2028 | 688.694 | 0,27 | EUR 1.100.000 | Barclays Plc RegS FRN 28/1/2028 | 995.203 | 0,39 |
| EUR 400.000 | Cellnex Finance Co SA RegS 1,50% 8/6/2028 ¹ | 337.036 | 0,13 | EUR 238.000 | BP Capital Markets Plc RegS FRN 31/12/2099 | 231.791 | 0,09 |
| EUR 500.000 | Cellnex Finance Co SA RegS 2,00% 15/2/2033 | 372.930 | 0,14 | EUR 443.000 | BP Capital Markets Plc RegS FRN 31/12/2099 | 413.758 | 0,16 |
| EUR 200.000 | Cellnex Telecom SA RegS 1,75% 23/10/2030 | 158.018 | 0,06 | EUR 100.000 | British Telecommunications Plc RegS 1,00% 23/6/2024 | 99.144 | 0,04 |
| EUR 400.000 | Iberdrola Finanzas SA RegS FRN 31/12/2099 | 348.088 | 0,14 | EUR 783.000 | British Telecommunications Plc RegS 1,00% 21/11/2024 | 770.644 | 0,30 |
| EUR 600.000 | Santander Consumer Finance SA RegS 1,00% 27/2/2024 | 596.922 | 0,23 | EUR 1.475.000 | Cadent Finance Plc RegS 0,625% 19/3/2030 ¹ | 1.239.516 | 0,48 |
| EUR 400.000 | Santander Consumer Finance SA RegS 0,375% 27/6/2024 | 391.052 | 0,15 | EUR 874.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 0,125% 12/5/2023 ¹ | 871.256 | 0,34 |
| | | 8.613.200 | 3,34 | EUR 787.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 23/9/2023 (Zero Coupon) ¹ | 779.319 | 0,30 |
| Supranationale Anleihen | | | | EUR 444.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,375% 12/9/2029 | 425.299 | 0,16 |
| EUR 936.000 | European Union RegS 4/11/2025 (Zero Coupon) | 905.561 | 0,35 | EUR 1.700.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 24/9/2029 ¹ | 1.467.338 | 0,57 |
| | | 905.561 | 0,35 | EUR 225.000 | Lloyds Bank Corporate Markets Plc RegS 0,25% 4/10/2022 | 225.299 | 0,09 |
| Schweden | | | | EUR 734.000 | National Grid Electricity Transmission Plc RegS 0,823% 7/7/2032 | 596.625 | 0,23 |
| EUR 620.000 | Lansforsakringar Bank AB RegS 0,125% 19/2/2025 ¹ | 594.245 | 0,23 | EUR 300.000 | National Grid Plc RegS 0,553% 18/9/2029 | 255.135 | 0,10 |
| EUR 994.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 0,05% 1/7/2024 | 968.116 | 0,38 | EUR 475.000 | National Grid Plc RegS 2,949% 30/3/2030 | 473.741 | 0,18 |
| EUR 1.000.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS FRN 31/10/2028 | 992.430 | 0,38 | EUR 362.000 | Nationwide Building Society RegS 0,25% 14/9/2028 | 314.860 | 0,12 |
| EUR 450.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 1,375% 23/2/2029 | 418.608 | 0,16 | EUR 569.000 | Nationwide Building Society RegS 2,25% 25/6/2029 | 587.532 | 0,23 |
| EUR 725.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS FRN 1/6/2033 | 723.528 | 0,28 | EUR 1.400.000 | Nationwide Building Society RegS FRN 25/7/2029 ¹ | 1.377.950 | 0,53 |
| EUR 1.600.000 | Swedbank AB RegS 1,30% 17/2/2027 | 1.514.096 | 0,59 | EUR 775.000 | NatWest Markets Plc RegS 0,125% 12/11/2025 | 722.548 | 0,28 |
| EUR 600.000 | Swedbank AB RegS FRN 20/5/2027 | 552.864 | 0,21 | EUR 544.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 5/9/2082 ¹ | 477.142 | 0,18 |
| EUR 287.000 | Volvo Car AB RegS 2,00% 24/1/2025 | 278.118 | 0,11 | EUR 1.600.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 28/2/2025 ¹ | 1.561.808 | 0,60 |
| | | 6.042.005 | 2,34 | EUR 1.585.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 13/9/2029 | 1.364.019 | 0,53 |
| Schweiz | | | | EUR 400.000 | SSE Plc RegS 1,375% 4/9/2027 | 383.420 | 0,15 |
| EUR 2.963.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028 | 2.605.603 | 1,01 | EUR 1.190.000 | SSE Plc RegS 1,75% 16/4/2030 ¹ | 1.111.032 | 0,43 |
| EUR 700.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2032 | 644.511 | 0,25 | EUR 800.000 | SSE Plc RegS FRN 31/12/2099 | 774.216 | 0,30 |
| EUR 400.000 | UBS Group AG RegS 1,50% 30/11/2024 | 401.688 | 0,16 | USD 610.000 | Standard Chartered Plc RegS FRN 23/3/2025 | 542.426 | 0,21 |
| EUR 1.202.000 | UBS Group AG RegS FRN 17/4/2025 | 1.191.074 | 0,46 | | | | |
| EUR 500.000 | UBS Group AG RegS FRN 29/1/2026 | 475.740 | 0,18 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| EUR 200.000 | Swiss Re Finance UK Plc RegS FRN 4/6/2052 | 173.516 | 0,07 | EUR 183.000 | JPMorgan Chase & Co RegS 1,50% 26/10/2022 | 184.188 | 0,07 |
| EUR 800.000 | Yorkshire Building Society RegS 0,50% 1/7/2028 [^] | 700.312 | 0,27 | EUR 344.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 11/3/2027 | 330.171 | 0,13 |
| | | 21.734.331 | 8,42 | EUR 5.600.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 23/3/2030 | 5.383.621 | 2,09 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | EUR 556.000 | Levi Strauss & Co 3,375% 15/3/2027 | 534.088 | 0,21 |
| EUR 472.000 | AbbVie Inc 1,50% 15/11/2023 | 475.499 | 0,18 | EUR 174.000 | Morgan Stanley 1,00% 2/12/2022 | 174.924 | 0,07 |
| EUR 1.850.000 | Air Products and Chemicals Inc 0,80% 5/5/2032 | 1.564.545 | 0,61 | EUR 2.188.000 | Morgan Stanley FRN 26/7/2024 | 2.176.163 | 0,84 |
| EUR 1.613.000 | American Tower Corp 0,95% 5/10/2030 | 1.328.080 | 0,51 | EUR 1.100.000 | Morgan Stanley FRN 8/5/2026 | 1.102.580 | 0,43 |
| EUR 400.000 | American Tower Corp 1,00% 15/1/2032 | 317.252 | 0,12 | EUR 452.000 | National Grid North America Inc RegS 1,054% 20/1/2031 | 386.749 | 0,15 |
| USD 460.000 | American Tower Corp 4,05% 15/3/2032 | 404.570 | 0,16 | EUR 400.000 | Netflix Inc 4,625% 15/5/2029 | 405.011 | 0,16 |
| EUR 199.000 | American Tower Corp 1,25% 21/5/2033 | 157.254 | 0,06 | EUR 985.000 | Netflix Inc RegS 3,625% 15/6/2030 | 933.918 | 0,36 |
| EUR 1.975.000 | Bank of America Corp RegS FRN 27/4/2033 | 1.953.864 | 0,76 | USD 1.185.000 | Oracle Corp 2,875% 25/3/2031 | 937.499 | 0,36 |
| EUR 1.338.000 | Booking Holdings Inc 0,10% 8/3/2025 | 1.279.115 | 0,50 | USD 680.000 | Oracle Corp 3,60% 1/4/2050 | 458.489 | 0,18 |
| EUR 400.000 | Citigroup Inc RegS 0,75% 26/10/2023 | 399.352 | 0,15 | EUR 275.000 | PepsiCo Inc 1,05% 9/10/2050 | 182.182 | 0,07 |
| EUR 375.000 | Coca-Cola Co 0,40% 6/5/2030 | 323.445 | 0,13 | EUR 287.000 | Procter & Gamble Co 0,90% 4/11/2041 | 208.027 | 0,08 |
| EUR 625.000 | Coca-Cola Co 0,375% 15/3/2033 | 497.125 | 0,19 | EUR 1.100.000 | Prologis Euro Finance LLC 0,50% 16/2/2032 | 858.594 | 0,33 |
| EUR 365.000 | Coca-Cola Co 0,95% 6/5/2036 | 293.066 | 0,11 | EUR 751.000 | RELX Capital Inc 1,30% 12/5/2025 [^] | 740.201 | 0,29 |
| EUR 850.000 | Coca-Cola Co 1,10% 2/9/2036 | 691.645 | 0,27 | EUR 125.000 | Thermo Fisher Scientific Inc 0,125% 1/3/2025 | 120.224 | 0,05 |
| EUR 610.000 | Digital Euro Finco LLC RegS 1,125% 9/4/2028 | 536.225 | 0,21 | EUR 400.000 | Thermo Fisher Scientific Inc 2,375% 15/4/2032 | 395.730 | 0,15 |
| EUR 2.150.000 | Eli Lilly & Co 1,375% 14/9/2061 | 1.344.094 | 0,52 | EUR 488.000 | Thermo Fisher Scientific Inc 1,875% 1/10/2049 | 373.003 | 0,14 |
| EUR 600.000 | Equinix Inc 0,25% 15/3/2027 [^] | 538.686 | 0,21 | EUR 192.000 | Verizon Communications Inc 0,875% 2/4/2025 | 188.544 | 0,07 |
| EUR 191.000 | Fidelity National Information Services Inc 0,75% 21/5/2023 | 190.847 | 0,07 | EUR 186.000 | Verizon Communications Inc 2,625% 1/12/2031 | 186.971 | 0,07 |
| EUR 400.000 | Fidelity National Information Services Inc 0,625% 3/12/2025 | 379.788 | 0,15 | EUR 122.000 | Verizon Communications Inc 0,875% 19/3/2032 | 103.938 | 0,04 |
| EUR 550.000 | Fidelity National Information Services Inc 1,00% 3/12/2028 | 494.281 | 0,19 | EUR 1.075.000 | Verizon Communications Inc 1,30% 18/5/2033 | 936.121 | 0,36 |
| EUR 343.000 | Fiserv Inc 1,625% 1/7/2030 | 310.234 | 0,12 | EUR 752.000 | Verizon Communications Inc 2,875% 15/1/2038 | 737.366 | 0,29 |
| EUR 1.234.000 | General Motors Financial Co Inc RegS 0,65% 7/9/2028 | 1.035.128 | 0,40 | | | 43.121.151 | 16,70 |
| EUR 1.250.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 30/4/2024 | 1.237.462 | 0,48 | Gesamt Anleihen | | 240.894.244 | 93,32 |
| EUR 2.477.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 1,375% 15/5/2024 | 2.483.812 | 0,96 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 240.894.244 | 93,32 |
| EUR 116.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 1,625% 27/7/2026 | 112.802 | 0,04 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| EUR 1.000.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 2,00% 1/11/2028 | 959.800 | 0,37 | Irland | | | |
| EUR 2.500.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 0,875% 9/5/2029 | 2.198.700 | 0,85 | 116.719 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc) ⁻ | 11.467.049 | 4,44 |
| EUR 498.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 3,00% 12/2/2031 | 502.860 | 0,20 | | | 11.467.049 | 4,44 |
| EUR 100.000 | International Business Machines Corp 0,375% 31/1/2023 | 100.164 | 0,04 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 11.467.049 | 4,44 |
| EUR 1.066.000 | International Business Machines Corp 0,65% 11/2/2032 | 898.180 | 0,35 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 252.361.293 | 97,76 |
| EUR 2.121.000 | International Flavors & Fragrances Inc 1,80% 25/9/2026 | 2.074.974 | 0,80 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 5.790.610 | 2,24 |
| | | | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 258.151.903 | 100,00 |
| | | | | [^] Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |
| | | | | ⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9. | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|----------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | USD 5.850.000 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.38 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 172.249 | (74.011) |
| CCCDs | EUR 5.580.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (30.303) | 32.673 |
| CCCDs | EUR 7.242.813 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (178.667) | 178.977 |
| CCILs | EUR 219.000 | Fund receives Fixed 2,481% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2037 | (3.850) | (3.845) |
| CCILs | GBP 310.000 | Fund receives Fixed 3,718% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (58.082) | (58.074) |
| CCILs | GBP 160.000 | Fund receives Fixed 3,810% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (27.978) | (27.973) |
| CCILs | GBP 80.000 | Fund receives Fixed 3,850% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (13.554) | (13.552) |
| CCILs | GBP 170.000 | Fund receives Fixed 4,262% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (13.864) | (13.291) |
| CCILs | GBP 280.000 | Fund receives Fixed 4,324% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2032 | (14.877) | (14.870) |
| CCILs | GBP 210.000 | Fund receives Fixed 4,328% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2032 | (12.814) | (12.809) |
| CCILs | GBP 220.000 | Fund receives Fixed 4,371% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2032 | (10.252) | (10.247) |
| CCILs | GBP 340.000 | Fund receives Fixed 4,435% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (18.325) | (18.316) |
| CCILs | GBP 415.000 | Fund receives Fixed 4,810% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2026 | (27.376) | (27.369) |
| CCILs | EUR 600.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,018% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 7.508 | 7.515 |
| CCILs | GBP 415.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,070% | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2024 | 28.969 | 28.973 |
| CCILs | GBP 270.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,100% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2027 | 4.059 | 4.077 |
| CCIRS | EUR 15.175.500 | Fund receives Fixed 0,478% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/10/2026 | (622.218) | (622.069) |
| CCIRS | EUR 15.175.500 | Fund receives Fixed 0,541% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/10/2026 | (581.674) | (581.525) |
| CCIRS | EUR 14.949.000 | Fund receives Fixed 0,638% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/10/2026 | (511.090) | (510.943) |
| CCIRS | EUR 1.587.000 | Fund receives Fixed 0,666% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 16/2/2027 | (59.559) | (59.544) |
| CCIRS | EUR 2.988.000 | Fund receives Fixed 0,800% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2032 | (279.388) | (278.739) |
| CCIRS | EUR 5.630.000 | Fund receives Fixed 1,532% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2027 | 7.851 | 7.906 |
| CCIRS | EUR 1.070.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,797% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2052 | 231.680 | 229.908 |
| CDS | EUR 650.000 | Fund receives default protection on WPP Finance SA and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 3.369 | 3.369 |
| CDS | EUR 332.000 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 8.803 | 5.107 |
| CDS | EUR 153.846 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 3.099 | 2.366 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 2.828.049) | | | | | (1.996.284) | (1.826.306) |

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| 29 | AUD | 90 Day Bank Bill Futures December 2022 | Dezember 2022 | 19.287.986 | (88.349) |
| (276) | EUR | Euro BOBL Futures June 2022 | Juni 2022 | 34.886.400 | 994.581 |
| (4) | EUR | Euro BTP Futures June 2022 | Juni 2022 | 507.480 | 66.936 |
| 71 | EUR | Euro Bund Futures June 2022 | Juni 2022 | 10.755.790 | (155.094) |
| (1) | EUR | Euro Bund Futures September 2022 | September 2022 | 151.880 | 1.499 |
| (15) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 2.439.600 | 282.823 |
| (2) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures September 2022 | September 2022 | 348.960 | 7.799 |
| 111 | EUR | Euro Schatz Futures June 2022 | Juni 2022 | 12.220.545 | (34.989) |
| (28) | EUR | Euro-OAT Futures June 2022 | Juni 2022 | 4.032.560 | 58.682 |
| (4) | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2022 | September 2022 | 546.313 | 8.881 |
| (9) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 1.078.530 | 11.407 |
| (2) | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 210.750 | 814 |
| (6) | USD | US Ultra Bond Futures September 2022 | September 2022 | 869.370 | 4.095 |
| Gesamt | | | | | 1.159.085 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|-----------------------|----------------|---------------|---------------|------------------------------------|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 5.208.000 | Call | OTC EUR/USD | Morgan Stanley | EUR 1,06 | 04/08/2022 | 22.316 | 120.336 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 0) | | | | | | 22.316 | 120.336 |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|--|---------------|---------------|---------------|------------------------------------|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| 6.800.000 | Call | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 from 15/6/2022 | Barclays Bank | EUR 0,90 | 15/06/2022 | 3.069 | 14.289 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 3.741.383) | | | | | | 3.069 | 14.289 |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------|--|---------------|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (16.000.000) | Call | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 12/10/2023; and pays 1,37% Fixed annually from 6/4/2023 | Goldman Sachs | EUR 1,37 | 06/04/2023 | 180.343 | (130.858) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|---|--------------|---|---------------|---------------|--------------------|---|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (16.000.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,37% Fixed annually from 6/4/2023; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 12/10/2023 | Goldman Sachs | EUR 1,37 | 06/04/2023 | (164.403) | (475.603) |
| (6.800.000) | Put | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 from 15/6/2022 | Barclays Bank | EUR 1,10 | 15/06/2022 | 13.478 | (1.318) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 16.383.126) | | | | | | 29.418 | (607.779) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-----------|---------|-----------|--|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| CNH | 2.000.000 | USD | 305.099 | Citibank | 15/6/2022 | (5.209) |
| EUR | 13.596 | AUD | 20.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 214 |
| EUR | 33.613 | DKK | 250.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 8 |
| EUR | 249.758 | GBP | 210.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 3.071 |
| EUR | 240.304 | GBP | 205.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (508) |
| EUR | 492.065 | GBP | 420.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (1.307) |
| EUR | 239.708 | GBP | 205.000 | HSBC | 15/6/2022 | (1.105) |
| EUR | 1.053.507 | GBP | 880.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 21.254 |
| EUR | 671.890 | NOK | 6.500.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 28.192 |
| EUR | 189.112 | NZD | 300.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 7.392 |
| EUR | 390.000 | USD | 431.856 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (12.889) |
| EUR | 1.080.000 | USD | 1.188.998 | HSBC | 15/6/2022 | (29.246) |
| EUR | 640.000 | USD | 695.450 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (8.802) |
| EUR | 6.043.347 | USD | 6.600.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | (104.256) |
| GBP | 210.000 | EUR | 247.214 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (528) |
| GBP | 205.000 | EUR | 240.312 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 501 |
| NOK | 6.500.000 | EUR | 660.817 | Natwest Markets | 15/6/2022 | (17.119) |
| NOK | 6.500.000 | USD | 717.257 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (25.449) |
| NZD | 1.430.000 | USD | 986.595 | Bank of America Merrill Lynch Standard | 15/6/2022 | (52.486) |
| USD | 628.635 | CNH | 4.000.000 | Chartered Bank | 15/6/2022 | 27.619 |
| USD | 443.970 | EUR | 420.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (5.809) |
| USD | 1.114.567 | EUR | 1.050.000 | HSBC | 15/6/2022 | (10.193) |
| USD | 675.909 | EUR | 640.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | (9.428) |
| USD | 709.403 | NOK | 6.287.397 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 39.176 |
| USD | 23.990 | NOK | 212.603 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 1.327 |
| USD | 519.752 | NZD | 750.000 | HSBC | 15/6/2022 | 29.680 |
| USD | 444.067 | NZD | 680.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 1.558 |
| | | | | | | (124.342) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|---|------------|---------|-----------|--------------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf SEK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 130.420 | SEK | 1.372.949 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (44) |
| SEK | 26.394.153 | EUR | 2.518.178 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (10.075) |
| | | | | | | (10.119) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 25.194.799) | | | | | | (134.461) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|-----------------|
| Finanzen | 53,67 |
| Versorger | 11,37 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 7,38 |
| Kommunikation | 5,88 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 4,44 |
| Zyklische Konsumgüter | 4,36 |
| Industrie | 3,16 |
| Technologie | 2,85 |
| Grundstoffe | 2,41 |
| Energie | 1,42 |
| Staatsanleihen | 0,82 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 97,76 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 2,24 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|-------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | | | |
| ANLEIHEN | | | | | | | |
| | Andorra | | | Kanada | | | |
| EUR 800.000 | Andorra International Bond RegS 1,25% 23/2/2027 | 762.184 | 0,48 | EUR 725.000 | Bank of Montreal RegS 1,00% 5/4/2026 | 713.038 | 0,45 |
| | | 762.184 | 0,48 | EUR 600.000 | Bank of Nova Scotia RegS 0,01% 15/12/2027 | 548.100 | 0,34 |
| | Australien | | | EUR 600.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce RegS 0,375% 10/3/2026 | 576.618 | 0,36 |
| EUR 800.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd RegS 0,25% 17/3/2025 | 777.704 | 0,49 | EUR 200.000 | Federation des Caisses Desjardins du Quebec RegS 0,25% 8/2/2027 | 188.277 | 0,12 |
| EUR 600.000 | Commonwealth Bank of Australia RegS 0,75% 28/2/2028 | 569.010 | 0,36 | EUR 646.000 | National Bank of Canada RegS 0,25% 24/7/2023 | 643.700 | 0,41 |
| EUR 264.000 | Macquarie Group Ltd RegS 0,35% 3/3/2028 | 228.706 | 0,14 | EUR 450.000 | Royal Bank of Canada RegS 0,125% 23/7/2024 | 438.674 | 0,28 |
| EUR 1.300.000 | National Australia Bank Ltd RegS 0,625% 16/3/2027 | 1.241.409 | 0,78 | EUR 500.000 | Royal Bank of Canada RegS 0,125% 26/4/2027 | 465.958 | 0,29 |
| EUR 150.000 | Toyota Finance Australia Ltd RegS 0,064% 13/1/2025 | 144.256 | 0,09 | EUR 540.000 | Toronto-Dominion Bank RegS 9/2/2024 (Zero Coupon) | 531.932 | 0,33 |
| | | 2.961.085 | 1,86 | EUR 570.000 | Toronto-Dominion Bank RegS 0,864% 24/3/2027 | 551.276 | 0,35 |
| | Österreich | | | | | 4.657.573 | 2,93 |
| EUR 200.000 | Erste Group Bank AG RegS 0,01% 12/7/2028 | 181.192 | 0,11 | Zypern | | | |
| EUR 100.000 | Kommunalkredit Austria AG RegS 0,25% 14/5/2024 | 96.790 | 0,06 | EUR 160.000 | Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023 | 166.062 | 0,10 |
| EUR 200.000 | Raiffeisen Bank International AG RegS 1,50% 24/5/2027 | 197.676 | 0,13 | EUR 1.376.000 | Cyprus Government International Bond RegS 0,625% 3/12/2024 | 1.349.072 | 0,85 |
| EUR 1.100.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 1,75% 20/10/2023 | 1.124.134 | 0,71 | EUR 180.000 | Cyprus Government International Bond RegS 9/2/2026 (Zero Coupon) | 169.315 | 0,11 |
| EUR 1.750.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 15/7/2024 (Zero Coupon) | 1.731.730 | 1,09 | EUR 447.000 | Cyprus Government International Bond RegS 0,95% 20/1/2032 | 379.673 | 0,24 |
| EUR 904.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,90% 20/2/2032 | 842.826 | 0,53 | | | 2.064.122 | 1,30 |
| EUR 449.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 1,85% 23/5/2049 | 440.195 | 0,28 | Dänemark | | | |
| | | 4.614.543 | 2,91 | EUR 275.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 17/2/2027 | 263.095 | 0,17 |
| | Belgien | | | DKK 1.006.175 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/10/2053 | 108.741 | 0,07 |
| EUR 700.000 | Belfius Bank SA RegS 0,01% 15/10/2025 | 660.156 | 0,41 | DKK 3.739.827 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | 412.972 | 0,26 |
| EUR 600.000 | Belfius Bank SA RegS 28/8/2026 (Zero Coupon) | 551.412 | 0,35 | DKK 1.593.651 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | 181.335 | 0,11 |
| EUR 600.000 | Elia System Operator SA RegS 1,375% 14/1/2026 | 588.702 | 0,37 | | | 966.143 | 0,61 |
| EUR 100.000 | KBC Bank NV RegS 3/12/2025 (Zero Coupon) | 95.457 | 0,06 | Finnland | | | |
| EUR 1.000.000 | KBC Group NV RegS FRN 10/9/2026 | 932.210 | 0,59 | EUR 230.000 | CRH Finland Services Oyj RegS 0,875% 5/11/2023 | 229.039 | 0,14 |
| EUR 200.000 | KBC Group NV RegS FRN 1/3/2027 | 184.774 | 0,12 | EUR 870.000 | Finland Government Bond RegS 15/9/2023 (Zero Coupon) | 867.903 | 0,55 |
| EUR 400.000 | KBC Group NV RegS FRN 7/12/2031 | 351.528 | 0,22 | EUR 1.354.000 | Finland Government Bond RegS 1,50% 15/9/2032 | 1.328.937 | 0,84 |
| EUR 680.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,20% 22/10/2023 | 680.109 | 0,43 | EUR 250.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,625% 27/7/2027 | 227.230 | 0,14 |
| EUR 1.300.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 2,60% 22/6/2024 | 1.355.536 | 0,85 | EUR 600.000 | OP Mortgage Bank RegS 1,00% 5/10/2027 | 583.380 | 0,37 |
| EUR 800.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,50% 22/10/2024 | 797.480 | 0,50 | | | 3.236.489 | 2,04 |
| | | 6.197.364 | 3,90 | Frankreich | | | |
| | | | | EUR 300.000 | AXA Home Loan SFH SA RegS 0,75% 22/10/2026 | 290.691 | 0,18 |
| | | | | EUR 500.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,75% 15/6/2023 | 501.120 | 0,32 |
| | | | | EUR 300.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,25% 29/6/2028 | 266.556 | 0,17 |
| | | | | EUR 300.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 4/6/2026 | 285.264 | 0,18 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-------------------------------|--|------------------------|--------------------|--------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Frankreich Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| EUR 500.000 | BPCE SA RegS 0,125% 4/12/2024 | 486.450 | 0,31 | EUR 1.262.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 0,50% 15/2/2025 [*] | 1.259.552 | 0,79 |
| EUR 900.000 | BPCE SA RegS 0,25% 15/1/2026 | 849.618 | 0,54 | EUR 404.000 | Commerzbank AG RegS 0,50% 15/3/2027 | 385.582 | 0,24 |
| EUR 600.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 21/1/2027 | 560.316 | 0,35 | EUR 700.000 | Commerzbank AG RegS FRN 29/12/2031 | 599.627 | 0,38 |
| EUR 600.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 10/11/2027 | 551.106 | 0,35 | EUR 600.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,125% 5/9/2024 | 577.212 | 0,36 |
| EUR 700.000 | Cie de Financement Foncier SA RegS 0,25% 11/4/2023 | 699.748 | 0,44 | EUR 300.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 17/11/2025 | 285.420 | 0,18 |
| EUR 600.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,625% 15/3/2024 | 592.326 | 0,37 | EUR 200.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 27/10/2025 | 186.238 | 0,12 |
| EUR 600.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA RegS 0,875% 31/8/2027 | 579.228 | 0,36 | EUR 500.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,10% 2/2/2026 [*] | 460.300 | 0,29 |
| EUR 700.000 | Credit Mutuel - CIC Home Loan SFH SA RegS 0,25% 30/4/2024 | 690.032 | 0,43 | EUR 400.000 | DZ HYP AG RegS 0,50% 13/11/2025 | 389.080 | 0,25 |
| EUR 600.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,875% 7/5/2027 | 560.556 | 0,35 | EUR 342.000 | DZ HYP AG RegS 0,01% 26/10/2026 | 321.391 | 0,20 |
| EUR 600.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,375% 3/10/2028 | 526.752 | 0,33 | EUR 200.000 | E.ON SE RegS 1,00% 7/10/2025 | 195.506 | 0,12 |
| EUR 800.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA RegS 0,625% 4/3/2027 | 768.440 | 0,48 | EUR 300.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,625% 3/11/2023 | 302.109 | 0,19 |
| EUR 400.000 | Dassault Systemes SE RegS 16/9/2024 (Zero Coupon) | 387.640 | 0,24 | EUR 800.000 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 1,625% 9/7/2024 | 788.976 | 0,50 |
| EUR 600.000 | Engie SA RegS 1,375% 27/3/2025 | 594.972 | 0,37 | EUR 618.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 15/11/2024 (Zero Coupon) | 607.488 | 0,38 |
| EUR 100.000 | FCT Noria '2021-1 C' RegS FRN 25/10/2049 | 97.443 | 0,06 | EUR 1.424.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 15/6/2029 (Zero Coupon) | 1.289.816 | 0,81 |
| EUR 1.900.000 | France Government Bond OAT RegS 25/3/2024 (Zero Coupon) | 1.885.275 | 1,19 | EUR 900.000 | Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 0,125% 27/6/2023 | 896.985 | 0,56 |
| EUR 2.150.000 | France Government Bond OAT RegS 2,25% 25/5/2024 | 2.223.508 | 1,40 | EUR 220.000 | Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 0,875% 15/9/2025 | 217.045 | 0,14 |
| EUR 9.100.000 | France Government Bond OAT RegS 1,75% 25/11/2024 | 9.346.337 | 5,89 | EUR 300.000 | Landesbank Hessen- Thueringen Girozentrale RegS 0,01% 19/7/2027 | 278.091 | 0,18 |
| EUR 2.100.000 | France Government Bond OAT RegS 25/2/2025 (Zero Coupon) | 2.056.593 | 1,30 | EUR 300.000 | Merck Financial Services GmbH RegS 0,125% 16/7/2025 | 287.337 | 0,18 |
| EUR 508.158 | Harmony French Home Loans FCT '2021-1 A' RegS FRN 27/5/2061 | 508.161 | 0,32 | EUR 1.276.000 | Muenchener Hypothekenbank eG RegS 0,25% 13/12/2023 | 1.265.320 | 0,80 |
| EUR 600.000 | Schneider Electric SE RegS 12/6/2023 (Zero Coupon) [*] | 596.184 | 0,38 | EUR 900.000 | Norddeutsche Landesbank- Girozentrale RegS 0,01% 23/9/2026 | 847.179 | 0,53 |
| EUR 800.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,01% 2/12/2026 | 749.768 | 0,47 | EUR 100.000 | Red & Black Auto Germany 8 UG 'B' RegS FRN 15/9/2030 | 98.693 | 0,06 |
| EUR 500.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,125% 18/7/2029 | 447.370 | 0,28 | EUR 500.000 | State of Lower Saxony RegS 15/9/2025 (Zero Coupon) | 481.370 | 0,30 |
| EUR 130.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 29/12/2049 | 127.451 | 0,08 | EUR 667.000 | State of Lower Saxony RegS 0,01% 17/3/2026 | 637.092 | 0,40 |
| EUR 340.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 299.241 | 0,19 | EUR 625.000 | UniCredit Bank AG RegS 0,01% 28/9/2026 | 588.213 | 0,37 |
| EUR 230.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 224.984 | 0,14 | EUR 500.000 | UniCredit Bank AG RegS 0,50% 23/2/2027 | 477.565 | 0,30 |
| EUR 400.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 378.740 | 0,24 | EUR 100.000 | Vonovia SE RegS 1,375% 28/1/2026 | 96.557 | 0,06 |
| | | 28.131.870 | 17,71 | EUR 500.000 | Vonovia SE RegS 0,375% 16/6/2027 | 441.350 | 0,28 |
| Deutschland | | | | | | 18.289.799 | 11,52 |
| EUR 681.000 | Berlin Hyp AG 0,125% 23/10/2023 | 676.104 | 0,43 | | | | |
| EUR 656.000 | Berlin Hyp AG RegS 0,01% 24/8/2026 | 618.621 | 0,39 | | | | |
| EUR 1.200.000 | Bertelsmann SE & Co KGaA RegS FRN 23/4/2075 | 1.200.912 | 0,76 | | | | |
| EUR 1.544.000 | Bundesobligation RegS 5/4/2024 (Zero Coupon) | 1.533.068 | 0,97 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Griechenland | | | | Italien Fortsetzung | | |
| EUR 943.000 | Hellenic Republic Government Bond RegS 12/2/2026 (Zero Coupon) | 862.091 | 0,54 | EUR 1.300.000 | UniCredit SpA RegS 0,325% 19/1/2026 [^] | 1.194.154 | 0,75 |
| | | 862.091 | 0,54 | EUR 500.000 | UniCredit SpA RegS FRN 16/6/2026 | 479.280 | 0,30 |
| | | | | | | 20.138.432 | 12,68 |
| | Island | | | | Japan | | |
| EUR 400.000 | Iceland Government International Bond RegS 0,10% 20/6/2024 | 389.288 | 0,24 | EUR 552.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd RegS 2,25% 21/11/2026 | 554.473 | 0,35 |
| EUR 210.000 | Iceland Government International Bond RegS 0,625% 3/6/2026 | 200.619 | 0,13 | | | 554.473 | 0,35 |
| | | 589.907 | 0,37 | | Jersey | | |
| | Irland | | | EUR 660.000 | Aptiv Plc 1,50% 10/3/2025 | 650.892 | 0,41 |
| GBP 399.858 | Agora Securities UK '2021-1X A' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 459.810 | 0,29 | | | 650.892 | 0,41 |
| EUR 325.000 | AIB Group Plc RegS FRN 4/4/2028 | 313.495 | 0,20 | | Luxemburg | | |
| EUR 518.850 | Haus European Loan Conduit No 39 DAC 'A1' RegS FRN 28/7/2051 | 502.312 | 0,31 | EUR 450.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0,632% 4/6/2023 | 449.437 | 0,28 |
| EUR 550.000 | Ireland Government Bond 5,40% 13/3/2025 | 622.061 | 0,39 | EUR 364.000 | European Financial Stability Facility RegS 1,75% 27/6/2024 | 371.367 | 0,23 |
| EUR 750.000 | Ireland Government Bond RegS 3,40% 18/3/2024 | 789.645 | 0,50 | EUR 1.479.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,625% 16/10/2026 | 1.444.510 | 0,91 |
| EUR 286.714 | Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC '1X A' RegS FRN 17/8/2033 | 283.130 | 0,18 | EUR 225.000 | Segro Capital Sarl RegS 1,25% 23/3/2026 | 216.709 | 0,14 |
| GBP 1.757 | Taurus '2021-UK4X A' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 2.029 | 0,00 | | | 2.482.023 | 1,56 |
| | | 2.972.482 | 1,87 | | Montenegro | | |
| | Italien | | | EUR 751.000 | Montenegro Government International Bond RegS 2,875% 16/12/2027 | 617.581 | 0,39 |
| EUR 160.000 | Autoflorence 2 Srl 'B' RegS FRN 24/12/2044 | 158.951 | 0,10 | | | 617.581 | 0,39 |
| EUR 100.000 | Brignole Co '2021 B' Srl RegS FRN 24/7/2036 | 97.645 | 0,06 | | Niederlande | | |
| EUR 500.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,50% 5/3/2024 | 495.985 | 0,31 | EUR 497.000 | BMW Finance NV RegS 0,625% 6/10/2023 | 495.917 | 0,31 |
| EUR 540.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,00% 4/7/2024 | 532.510 | 0,34 | EUR 150.000 | Coloplast Finance BV RegS 2,25% 19/5/2027 | 149.665 | 0,09 |
| EUR 500.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,625% 24/2/2026 | 459.085 | 0,29 | EUR 500.000 | de Volksbank NV RegS 0,75% 25/6/2023 | 500.640 | 0,32 |
| EUR 3.900.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,30% 15/8/2023 | 3.888.495 | 2,45 | EUR 500.000 | de Volksbank NV RegS 0,01% 16/9/2024 | 485.360 | 0,31 |
| EUR 2.050.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,95% 1/3/2023 | 2.061.828 | 1,30 | EUR 300.000 | de Volksbank NV RegS FRN 4/5/2027 | 296.190 | 0,19 |
| EUR 900.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,60% 15/6/2023 | 902.151 | 0,57 | EUR 200.000 | Deutsche Telekom International Finance BV RegS 0,625% 13/12/2024 | 196.158 | 0,12 |
| EUR 1.250.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 15/1/2024 (Zero Coupon) | 1.229.625 | 0,77 | EUR 318.076 | Domi '2021-1 A' BV RegS FRN 15/6/2053 | 315.588 | 0,20 |
| EUR 1.700.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,50% 1/3/2024 | 1.803.088 | 1,14 | EUR 386.190 | Dutch Property Finance '2021-2 A' BV RegS FRN 28/4/2059 | 383.534 | 0,24 |
| EUR 1.050.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,75% 1/7/2024 | 1.058.610 | 0,67 | EUR 550.000 | Enel Finance International NV RegS 28/5/2026 (Zero Coupon) | 505.367 | 0,32 |
| EUR 4.800.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 15/12/2024 (Zero Coupon) | 4.608.480 | 2,90 | EUR 572.000 | Enel Finance International NV RegS 17/6/2027 (Zero Coupon) | 512.112 | 0,32 |
| EUR 500.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,50% 1/6/2025 | 497.180 | 0,31 | EUR 300.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 278.301 | 0,18 |
| EUR 230.000 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA RegS 1,00% 8/9/2027 [^] | 210.209 | 0,13 | EUR 300.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 301.077 | 0,19 |
| EUR 450.000 | UniCredit SpA RegS 6,95% 31/10/2022 | 461.156 | 0,29 | EUR 200.000 | ING Bank NV RegS 0,50% 17/2/2027 | 191.252 | 0,12 |
| | | | | EUR 600.000 | ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025 | 574.890 | 0,36 |
| | | | | EUR 200.000 | ING Groep NV RegS FRN 16/2/2027 | 191.186 | 0,12 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Niederlande Fortsetzung | | | | Spanien | | |
| EUR 200.000 | ING Groep NV RegS FRN 29/9/2028 | 176.606 | 0,11 | EUR 200.000 | Autonoria Spain 2021 FT 'B' RegS FRN 31/1/2039 | 196.438 | 0,12 |
| EUR 300.000 | ING Groep NV RegS FRN 15/2/2029 | 300.312 | 0,19 | EUR 1.000.000 | Banco de Sabadell SA RegS 0,875% 22/7/2025 | 951.400 | 0,60 |
| EUR 108.000 | Jubilee Place 'B' RegS FRN 17/1/2059 | 105.878 | 0,07 | EUR 200.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 24/3/2026 | 195.232 | 0,12 |
| EUR 3.300.000 | Netherlands Government Bond RegS 15/1/2024 (Zero Coupon) | 3.282.807 | 2,07 | EUR 300.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 11/3/2027 | 283.779 | 0,18 |
| EUR 355.000 | NN Group NV RegS FRN 8/4/2044 | 366.907 | 0,23 | EUR 600.000 | Banco Santander SA 0,01% 27/2/2025 | 579.378 | 0,37 |
| EUR 230.000 | RELX Finance BV RegS 18/3/2024 (Zero Coupon) | 224.899 | 0,14 | EUR 600.000 | CaixaBank SA RegS 0,375% 3/2/2025 | 577.680 | 0,36 |
| EUR 500.000 | Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 20/2/2023 (Zero Coupon) | 499.945 | 0,31 | GBP 200.000 | CaixaBank SA RegS FRN 6/4/2028 | 229.565 | 0,14 |
| EUR 100.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 100.300 | 0,06 | EUR 2.015.000 | Instituto de Credito Oficial RegS 0,75% 31/10/2023 | 2.020.803 | 1,27 |
| EUR 200.000 | TenneT Holding BV RegS 1,625% 17/11/2026 | 198.508 | 0,12 | EUR 1.000.000 | Instituto de Credito Oficial RegS 1,30% 31/10/2026 | 995.980 | 0,63 |
| EUR 300.000 | TenneT Holding BV RegS FRN 31/12/2099 | 301.611 | 0,19 | EUR 600.000 | Santander Consumer Finance SA RegS 0,375% 27/6/2024 | 586.578 | 0,37 |
| EUR 200.000 | Toyota Motor Finance Netherlands BV RegS 27/10/2025 (Zero Coupon) | 188.090 | 0,12 | EUR 2.432.000 | Spain Government Bond 31/1/2025 (Zero Coupon) | 2.367.041 | 1,49 |
| EUR 300.000 | Vonovia Finance BV RegS 0,125% 6/4/2023* | 298.233 | 0,19 | EUR 3.244.000 | Spain Government Bond RegS 4,40% 31/10/2023 | 3.424.691 | 2,16 |
| | | 11.421.333 | 7,19 | EUR 1.750.000 | Spain Government Bond RegS 3,80% 30/4/2024 | 1.852.813 | 1,17 |
| | | | | | | 14.261.378 | 8,98 |
| | Neuseeland | | | | Supranationale Anleihen | | |
| EUR 230.000 | Chorus Ltd RegS 0,875% 5/12/2026 | 214.970 | 0,14 | EUR 592.000 | European Investment Bank RegS 13/3/2026 (Zero Coupon) | 568.343 | 0,36 |
| | | 214.970 | 0,14 | EUR 262.000 | European Investment Bank RegS 0,375% 14/4/2026 | 254.821 | 0,16 |
| | | | | EUR 980.174 | European Stability Mechanism RegS 14/3/2025 (Zero Coupon) | 954.376 | 0,60 |
| | | | | EUR 441.078 | European Stability Mechanism RegS 1,00% 23/9/2025 | 440.399 | 0,28 |
| | | | | | | 2.217.939 | 1,40 |
| | Norwegen | | | | Schweden | | |
| EUR 660.000 | DNB Bank ASA RegS 0,05% 14/11/2023 | 651.618 | 0,41 | EUR 932.000 | Nordea Bank AB RegS FRN 18/8/2031 | 843.852 | 0,53 |
| EUR 275.000 | DNB Bank ASA RegS FRN 18/1/2028 | 254.059 | 0,16 | EUR 540.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 0,05% 1/7/2024 | 525.938 | 0,33 |
| EUR 750.000 | DNB Boligkreditt AS RegS 0,625% 19/6/2025 | 735.292 | 0,46 | EUR 230.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 0,375% 3/7/2023 | 229.239 | 0,15 |
| EUR 300.000 | DNB Boligkreditt AS RegS 0,625% 14/1/2026 | 292.074 | 0,19 | EUR 450.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 0,125% 18/6/2024 | 439.884 | 0,28 |
| EUR 731.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,50% 30/1/2025 | 717.009 | 0,45 | EUR 327.000 | Swedbank AB RegS 0,25% 2/11/2026 | 302.668 | 0,19 |
| | | 2.650.052 | 1,67 | EUR 300.000 | Swedbank AB RegS 1,30% 17/2/2027 | 283.893 | 0,18 |
| | | | | EUR 150.000 | Volvo Treasury AB RegS 1,625% 18/9/2025 | 149.466 | 0,09 |
| | | | | | | 2.774.940 | 1,75 |
| | Portugal | | | | Schweiz | | |
| EUR 100.000 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Viriato Finance No 1 'B' RegS FRN 28/10/2040 | 98.699 | 0,06 | EUR 400.000 | Credit Suisse AG RegS 2,125% 31/5/2024 | 400.860 | 0,25 |
| | | 98.699 | 0,06 | EUR 800.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2026 | 804.528 | 0,51 |
| | | | | EUR 325.000 | UBS Group AG RegS FRN 3/11/2026 | 303.251 | 0,19 |
| | | | | EUR 1.010.000 | UBS Group AG RegS 0,25% 24/2/2028 | 884.497 | 0,56 |
| | | | | | | 2.393.136 | 1,51 |
| | Rumänien | | | | | | |
| EUR 425.000 | Romanian Government International Bond RegS 2,125% 7/3/2028 | 375.328 | 0,24 | | | | |
| | | 375.328 | 0,24 | | | | |
| | Singapur | | | | | | |
| EUR 540.000 | DBS Group Holdings Ltd RegS FRN 11/4/2028 | 539.486 | 0,34 | | | | |
| | | 539.486 | 0,34 | | | | |
| | Slowakei | | | | | | |
| EUR 400.000 | Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,25% 26/3/2024 | 394.348 | 0,25 | | | | |
| | | 394.348 | 0,25 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-------------|---|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| | Vereinigte Arabische Emirate | | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | |
| EUR 825.000 | First Abu Dhabi Bank PJSC RegS 1,625% 7/4/2027 | 797.794 | 0,50 | EUR 230.000 | AbbVie Inc 1,25% 1/6/2024 | 229.577 | 0,14 |
| | | 797.794 | 0,50 | USD 175.000 | American Tower Corp 3,65% 15/3/2027 | 158.860 | 0,10 |
| | Großbritannien | | | EUR 1.100.000 | Bank of America Corp RegS FRN 22/9/2026 | 1.103.025 | 0,69 |
| EUR 450.000 | Barclays Plc RegS FRN 9/6/2025 | 437.440 | 0,27 | EUR 250.000 | Becton Dickinson and Co 0,034% 13/8/2025 | 235.778 | 0,15 |
| GBP 100.000 | Barley Hill NO 2 Plc 'B' RegS FRN 27/8/2058 | 117.053 | 0,07 | EUR 230.000 | Citigroup Inc RegS 0,75% 26/10/2023 | 229.627 | 0,15 |
| GBP 113.000 | Canada Square Funding '2021- 2 B' Plc RegS FRN 17/6/2058 | 129.521 | 0,08 | EUR 200.000 | Citigroup Inc RegS FRN 6/7/2026 | 195.048 | 0,12 |
| EUR 540.000 | Diageo Finance Plc RegS 1,875% 27/3/2027 | 540.534 | 0,34 | EUR 450.000 | Fidelity National Information Services Inc 0,75% 21/5/2023 | 449.640 | 0,28 |
| GBP 200.000 | Dowson '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/10/2028 | 231.975 | 0,15 | EUR 618.000 | Fidelity National Information Services Inc 0,625% 3/12/2025 | 586.772 | 0,37 |
| GBP 317.000 | Economic Master Issuer Plc '2021-1X A' RegS FRN 25/6/2073 | 368.670 | 0,23 | EUR 660.000 | Fiserv Inc 0,375% 1/7/2023 | 656.033 | 0,41 |
| GBP 306.596 | Elvet Mortgages '2021-1 A' Plc FRN 22/10/2063 | 358.222 | 0,23 | EUR 800.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 30/4/2024 | 791.976 | 0,50 |
| GBP 505.141 | Finsbury Square '2021-1GRX AGRN' RegS FRN 16/12/2067 | 575.550 | 0,36 | EUR 230.000 | International Business Machines Corp 1,25% 26/5/2023 | 231.194 | 0,15 |
| GBP 217.000 | Finsbury Square '2021-2X B' Plc RegS FRN 16/12/2071 | 247.589 | 0,16 | EUR 450.000 | JPMorgan Chase & Co RegS 1,50% 26/10/2022 | 452.921 | 0,29 |
| EUR 230.000 | Lloyds Bank Corporate Markets Plc RegS 0,25% 4/10/2022 | 230.306 | 0,14 | EUR 630.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 11/3/2027 | 604.674 | 0,38 |
| GBP 229.670 | London Wall Mortgage Capital Plc '2021-FL1 A' RegS FRN 15/5/2051 | 266.482 | 0,17 | EUR 230.000 | National Grid North America Inc RegS 0,75% 8/8/2023 | 229.220 | 0,14 |
| EUR 186.000 | Nationwide Building Society RegS 0,25% 14/9/2028 | 161.779 | 0,10 | EUR 230.000 | Thermo Fisher Scientific Inc 0,125% 1/3/2025 | 221.212 | 0,14 |
| EUR 300.000 | NatWest Markets Plc RegS 2,00% 27/8/2025 | 298.095 | 0,19 | USD 471.000 | Verizon Communications Inc 2,355% 15/3/2032 | 376.970 | 0,24 |
| EUR 275.000 | NatWest Markets Plc RegS 0,125% 12/11/2025 | 256.388 | 0,16 | | | 6.752.527 | 4,25 |
| GBP 351.000 | Newday Funding Master Issuer Plc '2022-1X A1' RegS FRN 15/4/2030 | 412.593 | 0,26 | Gesamt Anleihen | | 153.539.813 | 96,68 |
| EUR 100.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 5/12/2079 | 95.678 | 0,06 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 153.539.813 | 96,68 |
| GBP 500.000 | Pierpont BTL '2021-1 B' Plc RegS FRN 22/12/2053 | 571.221 | 0,36 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| EUR 900.000 | Royal Bank of Scotland Group Plc RegS FRN 15/11/2025 | 871.218 | 0,55 | Irland | | | |
| EUR 700.000 | Santander UK Plc RegS 1,125% 12/3/2027 | 685.293 | 0,43 | 23.219 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc)^ | 2.281.104 | 1,44 |
| EUR 375.000 | SSE Plc RegS FRN 31/12/2099 | 362.914 | 0,23 | | | 2.281.104 | 1,44 |
| USD 210.000 | Standard Chartered Plc RegS FRN 23/3/2025 | 186.737 | 0,12 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 2.281.104 | 1,44 |
| GBP 100.000 | Together Asset Backed Securitisation '2021-1ST1 B' Plc RegS FRN 12/7/2063 | 113.445 | 0,07 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 155.820.917 | 98,12 |
| GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 113.809 | 0,07 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 2.991.908 | 1,88 |
| GBP 100.000 | Tower Bridge Funding ' 2022-1X B' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 113.598 | 0,07 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 158.812.825 | 100,00 |
| GBP 137.000 | Twin Bridges '2021-2 B' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 152.720 | 0,10 | | | | |
| | | 7.898.830 | 4,97 | | | | |

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

- Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9.

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|---------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCDS | EUR 1.750.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 36 Version 1 | Bank of America Merrill Lynch | 20/12/2026 | (5.287) | 15.172 |
| CCILS | EUR 269.000 | Fund receives Fixed 2,481% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | BNP Paribas | 15/5/2037 | (4.729) | (4.722) |
| CCILS | GBP 830.000 | Fund receives Fixed 3,650% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | BNP Paribas | 15/4/2031 | (172.368) | (172.348) |
| CCILS | GBP 90.000 | Fund receives Fixed 3,658% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | BNP Paribas | 15/4/2031 | (18.600) | (18.598) |
| CCILS | GBP 290.000 | Fund receives Fixed 3,718% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | BNP Paribas | 15/7/2031 | (54.334) | (54.327) |
| CCILS | GBP 150.000 | Fund receives Fixed 4,262% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | BNP Paribas | 15/12/2031 | (12.233) | (11.728) |
| CCILS | GBP 430.000 | Fund receives Fixed 4,324% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | BNP Paribas | 15/2/2032 | (22.847) | (22.837) |
| CCILS | GBP 180.000 | Fund receives Fixed 4,328% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | BNP Paribas | 15/1/2032 | (10.984) | (10.979) |
| CCILS | GBP 270.000 | Fund receives Fixed 4,371% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | BNP Paribas | 15/2/2032 | (12.582) | (12.576) |
| CCILS | GBP 550.000 | Fund receives Fixed 4,810% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | BNP Paribas | 15/11/2026 | (36.280) | (36.272) |
| CCILS | EUR 750.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,018% | BNP Paribas | 15/5/2027 | 9.385 | 9.394 |
| CCILS | GBP 550.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,070% | BNP Paribas | 15/11/2024 | 38.395 | 38.399 |
| CCILS | GBP 300.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,100% | BNP Paribas | 15/3/2027 | 4.510 | 4.530 |
| CCIRS | EUR 820.000 | Fund receives Fixed 0,088% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | BNP Paribas | 25/5/2031 | (117.797) | (117.783) |
| CCIRS | EUR 4.080.000 | Fund receives Fixed -0,103% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | BNP Paribas | 15/8/2026 | (257.556) | (257.516) |
| CCIRS | EUR 1.020.000 | Fund receives Fixed 0,180% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | BNP Paribas | 25/5/2031 | (138.630) | (138.613) |
| CCIRS | EUR 1.780.000 | Fund receives Fixed 0,424% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | BNP Paribas | 15/2/2027 | (86.974) | (86.957) |
| CCIRS | EUR 1.060.000 | Fund receives Fixed 0,730% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | BNP Paribas | 25/5/2031 | (95.386) | (95.336) |
| CCIRS | EUR 980.000 | Fund receives Fixed 0,813% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | BNP Paribas | 15/2/2031 | (76.762) | (76.745) |
| CCIRS | EUR 520.000 | Fund receives Fixed 0,817% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | BNP Paribas | 15/2/2031 | (40.567) | (40.559) |
| CCIRS | EUR 1.210.000 | Fund receives Fixed 0,906% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | BNP Paribas | 23/2/2037 | (172.912) | (172.886) |
| CCIRS | EUR 1.940.000 | Fund receives Fixed 1,699% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | BNP Paribas | 15/2/2031 | (12.814) | (12.784) |
| CCIRS | EUR 1.000.000 | Fund receives Fixed 1,762% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | BNP Paribas | 15/2/2031 | (1.493) | (1.477) |
| CCIRS | EUR 1.735.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,538% | BNP Paribas | 23/2/2027 | 75.303 | 75.320 |
| CCIRS | EUR 195.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,581% | BNP Paribas | 23/2/2072 | 57.844 | 57.852 |
| CCIRS | GBP 35.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,280% | BNP Paribas | 1/4/2072 | 7.232 | 7.235 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 1.552.942) | | | | | (1.158.466) | (1.137.141) |

CCDS: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps
 CCILS: Zentral abgewickelte inflationsgebundene Swaps
 CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| 79 | AUD | 90 Day Bank Bill Futures December 2022 | Dezember 2022 | 52.543.136 | (150.544) |
| (262) | EUR | Euro BOBL Futures June 2022 | Juni 2022 | 33.116.800 | 1.315.360 |
| 64 | EUR | Euro BTP Futures June 2022 | Juni 2022 | 7.007.360 | (153.280) |
| (9) | EUR | Euro BTP Futures June 2022 | Juni 2022 | 1.141.830 | 150.555 |
| (25) | EUR | Euro Bund Futures June 2022 | Juni 2022 | 3.787.250 | 61.628 |
| (7) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 1.138.480 | 116.578 |
| 377 | EUR | Euro Schatz Futures June 2022 | Juni 2022 | 41.505.815 | (315.583) |
| (60) | EUR | Euro-OAT Futures June 2022 | Juni 2022 | 8.641.200 | 382.885 |
| (5) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 599.184 | 6.252 |
| (22) | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 2.318.247 | 8.328 |
| Gesamt | | | | | 1.422.179 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Netto(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|-----------------------|-------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 520.000 | Call | OTC USD/CNH | BNP Paribas | USD 6,90 | 18/08/2022 | (1.455) | 1.868 |
| 520.000 | Call | OTC USD/CNH | BNP Paribas | USD 6,90 | 18/08/2022 | (488) | 1.868 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 196.308) | | | | | | (1.943) | 3.736 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn EUR | Marktwert EUR |
|---|-----------|-----------------------|-------------|---------------|---------------|------------------------------------|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (520.000) | Call | OTC USD/CNH | BNP Paribas | USD 7,10 | 18/08/2022 | 469 | (719) |
| (520.000) | Call | OTC USD/CNH | BNP Paribas | USD 7,10 | 18/08/2022 | 145 | (719) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 67.032) | | | | | | 614 | (1.438) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------|---------|-----------|----------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISETERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 270.000 | EUR | 183.495 | JP Morgan | 14/7/2022 | (2.849) |
| DKK | 2.812.000 | EUR | 377.992 | UBS | 14/7/2022 | (7) |
| EUR | 47.181 | AUD | 70.000 | Bank of America | 14/7/2022 | 347 |
| EUR | 54.890 | AUD | 80.000 | Merrill Lynch | 14/7/2022 | 1.365 |
| EUR | 81.186 | AUD | 120.000 | Royal Bank of Canada | 14/7/2022 | 899 |
| EUR | 1.191.274 | DKK | 8.860.000 | UBS | 14/7/2022 | 325 |
| EUR | 300.733 | GBP | 255.000 | Bank of America | 14/7/2022 | 1.185 |
| EUR | 152.388 | GBP | 130.000 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | (322) |
| EUR | 304.601 | GBP | 260.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (820) |
| | | | | JP Morgan | 15/6/2022 | |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------|---------|-----------|----------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISETERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 383.886 | GBP | 320.000 | Bank of America | 14/7/2022 | 8.522 |
| EUR | 5.315.424 | GBP | 4.440.000 | Merrill Lynch | 14/7/2022 | 107.239 |
| EUR | 179.662 | GBP | 150.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 3.710 |
| EUR | 382.284 | NOK | 3.700.000 | UBS | 14/7/2022 | 15.871 |
| EUR | 44.136 | NZD | 70.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 1.735 |
| EUR | 370.000 | USD | 411.038 | Bank of America | 14/7/2022 | 1.735 |
| EUR | 120.000 | USD | 133.363 | Merrill Lynch | 14/7/2022 | 1.735 |
| EUR | 370.000 | USD | 402.057 | Bank of America | 15/6/2022 | (13.468) |
| EUR | 370.000 | USD | 402.057 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | (4.418) |
| EUR | 370.000 | USD | 402.057 | JP Morgan | 15/6/2022 | (4.418) |
| EUR | 370.000 | USD | 403.666 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (5.089) |
| EUR | 370.000 | USD | 403.666 | Royal Bank of Canada | 15/6/2022 | (6.590) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|---|-----------|---------|-----------|-------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 9.411 | USD | 10.000 | Bank of America Merrill Lynch | 14/7/2022 | 96 |
| EUR | 631.804 | USD | 690.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | (10.899) |
| GBP | 130.000 | EUR | 153.038 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (327) |
| GBP | 127.500 | EUR | 149.434 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 340 |
| GBP | 900.000 | EUR | 1.067.819 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | (12.106) |
| NOK | 3.700.000 | EUR | 376.229 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (9.816) |
| NOK | 3.700.000 | USD | 408.821 | JP Morgan | 15/6/2022 | (14.987) |
| NZD | 390.000 | USD | 270.221 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (15.387) |
| NZD | 400.000 | USD | 275.021 | JP Morgan | 15/6/2022 | (13.796) |
| USD | 264.280 | EUR | 250.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (3.446) |
| USD | 401.321 | EUR | 380.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | (5.598) |
| USD | 637.002 | EUR | 600.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (5.724) |
| USD | 417.589 | NOK | 3.700.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 23.166 |
| USD | 261.372 | NZD | 400.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 1.062 |
| USD | 270.362 | NZD | 390.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 15.518 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 17.175.162) | | | | | | 55.731 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|---------------------------------------|---------------|
| Staatsanleihen | 43,67 |
| Finanzen | 37,81 |
| Mit Hypotheken besicherte Wertpapiere | 3,58 |
| Versorger | 3,04 |
| Industrie | 1,70 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 1,67 |
| Kommunikation | 1,46 |
| Technologie | 1,45 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 1,44 |
| Zyklische Konsumgüter | 1,02 |
| Asset Backed Securities (ABS) | 0,87 |
| Energie | 0,41 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 98,12 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 1,88 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|----------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Schweiz Fortsetzung | | | |
| | | | | EUR 75.000.000 | Credit Suisse AG 6/9/2022 (Zero Coupon) | 75.063.195 | 4,91 |
| | | | | EUR 34.000.000 | Zuercher Kantonalbank 8/8/2022 (Zero Coupon) | 34.039.688 | 2,22 |
| | | | | | | 160.146.514 | 10,47 |
| | | | | Gesamt Einlagenzertifikate | | 240.203.325 | 15,70 |
| STAMMAKTIE | | | | KURZFRISTIGE TITEL | | | |
| Belgien | | | | Frankreich | | | |
| 454.749 | Azelis Group NV | 10.841.216 | 0,71 | EUR 24.500.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 8/9/2022 (Zero Coupon) | 24.562.830 | 1,60 |
| | | 10.841.216 | 0,71 | EUR 20.000.000 | Barclays Bank Plc 4/7/2022 (Zero Coupon) | 20.014.236 | 1,31 |
| Dänemark | | | | EUR 35.500.000 | CA Consumer Finance SA 31/5/2022 (Zero Coupon) | 35.506.924 | 2,32 |
| 254.186 | DSV PANALPINA A/S | 38.694.729 | 2,53 | EUR 15.000.000 | Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA 3/8/2022 (Zero Coupon) | 15.011.037 | 0,98 |
| 430.517 | Novo Nordisk A/S 'B' | 44.501.906 | 2,91 | EUR 5.000.000 | Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA 11/8/2022 (Zero Coupon) | 5.003.751 | 0,33 |
| 481.346 | Royal Unibrew A/S | 39.274.261 | 2,57 | EUR 55.000.000 | Loreal SA 15/6/2022 (Zero Coupon) | 55.011.904 | 3,60 |
| 690.793 | Tryg A/S | 15.168.025 | 0,99 | EUR 10.000.000 | Natixis SA RegS 9/8/2022 (Zero Coupon) | 10.007.482 | 0,65 |
| | | 137.638.921 | 9,00 | | | 165.118.164 | 10,79 |
| Irland | | | | Deutschland | | | |
| 113.070 | Linde Plc | 34.164.101 | 2,23 | EUR 10.000.000 | Standard Chartered Bank 8/9/2022 (Zero Coupon) | 10.006.192 | 0,65 |
| | | 34.164.101 | 2,23 | | | 10.006.192 | 0,65 |
| Luxemburg | | | | Luxemburg | | | |
| 1.732.840 | Tenaris SA | 27.517.499 | 1,80 | EUR 14.500.000 | Albion Capital Corp SA RegS 16/6/2022 (Zero Coupon) | 14.502.419 | 0,95 |
| | | 27.517.499 | 1,80 | EUR 5.000.000 | Archer-Daniels-Midland Co 24/6/2022 (Zero Coupon) | 5.001.630 | 0,33 |
| Niederlande | | | | EUR 15.000.000 | Colgate-Palmolive Co 23/6/2022 (Zero Coupon) | 15.004.677 | 0,98 |
| 29.140 | ASML Holding NV | 15.738.514 | 1,03 | EUR 20.000.000 | Collateralized Commercial Paper III Co LLC RegS 11/7/2022 (Zero Coupon) | 20.011.139 | 1,31 |
| 149.017 | IMCD NV | 20.862.380 | 1,36 | EUR 24.500.000 | Collateralized Commercial Paper III Co LLC RegS 14/7/2022 (Zero Coupon) | 24.514.669 | 1,60 |
| | | 36.600.894 | 2,39 | EUR 25.500.000 | Erste Group Bank AG 1/6/2022 (Zero Coupon) | 25.500.000 | 1,67 |
| Schweiz | | | | EUR 25.500.000 | Erste Group Bank AG 1/6/2022 (Zero Coupon) | 25.502.826 | 1,67 |
| 1.568 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | 14.568.460 | 0,95 | EUR 33.500.000 | ING Bank NV 31/8/2022 (Zero Coupon) | 33.530.523 | 2,19 |
| 89.863 | Lonza Group AG Reg | 50.585.211 | 3,31 | EUR 9.500.000 | LMA SA 23/6/2022 (Zero Coupon) | 9.502.675 | 0,62 |
| 11.895 | Partners Group Holding AG^ | 11.954.433 | 0,78 | EUR 15.000.000 | LMA SA 25/8/2022 (Zero Coupon) | 15.010.278 | 0,98 |
| 72.462 | Sika AG Reg^ | 18.808.769 | 1,23 | EUR 49.500.000 | Macquarie Bank Ltd RegS 7/6/2022 (Zero Coupon) | 49.504.716 | 3,23 |
| 31.853 | Sonova Holding AG Reg | 10.555.024 | 0,69 | EUR 16.000.000 | Matchpoint Finance Plc 5/7/2022 (Zero Coupon) | 16.006.805 | 1,04 |
| 128.580 | Straumann Holding AG Reg | 15.361.585 | 1,00 | EUR 15.000.000 | Matchpoint Finance Plc RegS 6/6/2022 (Zero Coupon) | 15.001.002 | 0,98 |
| | | 121.833.482 | 7,96 | EUR 27.000.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 28/7/2022 (Zero Coupon) | 27.022.072 | 1,76 |
| Großbritannien | | | | EUR 40.000.000 | Procter & Gamble Co 16/8/2022 (Zero Coupon) | 40.029.580 | 2,62 |
| 350.878 | Dechra Pharmaceuticals Plc | 14.984.479 | 0,98 | | | | |
| 277.377 | InterContinental Hotels Group Plc | 16.167.866 | 1,06 | | | | |
| 986.306 | RELX Plc | 26.354.097 | 1,72 | | | | |
| | | 57.506.442 | 3,76 | | | | |
| Gesamt Stammaktien | | | | 426.102.555 27,85 | | | |
| EINLAGENZERTIFIKATE | | | | Frankreich | | | |
| EUR 10.000.000 | Credit Agricole SA 16/8/2022 (Zero Coupon) | 10.008.816 | 0,65 | | | | |
| | | 10.008.816 | 0,65 | | | | |
| Japan | | | | Schweiz | | | |
| EUR 25.000.000 | Mizuho Bank Ltd 12/7/2022 (Zero Coupon) | 25.014.972 | 1,64 | EUR 51.000.000 | Basler Kantonalbank 19/7/2022 (Zero Coupon) | 51.043.631 | 3,34 |
| EUR 30.000.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 14/7/2022 (Zero Coupon) | 30.019.872 | 1,96 | | | | |
| EUR 15.000.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 18/8/2022 (Zero Coupon) | 15.013.151 | 0,98 | | | | |
| | | 70.047.995 | 4,58 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---|---|------------------------|--------------------|
| Luxemburg Fortsetzung | | | |
| EUR 5.000.000 | SAP SE 28/7/2022 (Zero Coupon) | 5.003.645 | 0,33 |
| EUR 5.000.000 | Satellite SASU 3/6/2022 (Zero Coupon) | 5.000.139 | 0,33 |
| EUR 20.000.000 | Satellite SASU 21/7/2022 (Zero Coupon) | 20.011.678 | 1,31 |
| EUR 18.000.000 | Svenska Handelsbanken AB 9/6/2022 (Zero Coupon) | 18.002.266 | 1,18 |
| EUR 40.000.000 | Svenska Handelsbanken AB 26/9/2022 (Zero Coupon) | 40.031.877 | 2,62 |
| EUR 8.000.000 | Toyota Motor Finance RegS 15/7/2022 (Zero Coupon) | 8.004.697 | 0,52 |
| | | 431.699.313 | 28,22 |
| Niederlande | | | |
| EUR 27.000.000 | PACCAR Financial Europe BV 13/6/2022 (Zero Coupon) | 27.004.501 | 1,77 |
| | | 27.004.501 | 1,77 |
| Schweiz | | | |
| EUR 30.000.000 | Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 9/8/2022 (Zero Coupon) | 30.036.000 | 1,96 |
| | | 30.036.000 | 1,96 |
| Großbritannien | | | |
| EUR 20.000.000 | Barclays Bank Plc 4/7/2022 (Zero Coupon) | 20.010.136 | 1,31 |
| EUR 42.000.000 | Mizuho International Plc 26/8/2022 (Zero Coupon) | 42.035.394 | 2,75 |
| | | 62.045.530 | 4,06 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| EUR 54.000.000 | Nieuw Amsterdam Receivables Corp 1/7/2022 (Zero Coupon) | 54.021.617 | 3,53 |
| | | 54.021.617 | 3,53 |
| Gesamt kurzfristige Titel | | 779.931.317 | 50,98 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 1.446.237.197 | 94,53 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Irland | | | |
| 1.254.834 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc)^ | 123.281.272 | 8,06 |
| | | 123.281.272 | 8,06 |
| Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 123.281.272 | 8,06 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 1.569.518.469 | 102,59 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | | (39.634.567) | (2,59) |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 1.529.883.902 | 100,00 |

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

~ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9.

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|--------------------------------|--|-----------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (194.849) | HeidelbergCement AG | Citibank | (210.437) |
| | Belgien | | | (294.255) | HelloFresh SE | JP Morgan | (432.153) |
| (282.015) | Colruyt SA | Citibank | 177.670 | (126.455) | Henkel AG & Co KGaA (Pref) | JP Morgan | (182.095) |
| (696.165) | Proximus SADP | Citibank | 90.501 | (215.744) | LANXESS AG | Barclays Bank | (1.398.021) |
| (76.863) | Solvay SA | JP Morgan | (142.457) | (132.909) | SAP SE | Bank of America | |
| (263.021) | Umicore SA | Bank of America | | (397.855) | Siemens Energy AG | Merrill Lynch | 68.238 |
| | | Merrill Lynch | (402.758) | (21.000) | SLM Solutions Group AG | BNP Paribas | 620.654 |
| | | | (277.044) | (18.000) | SLM Solutions Group AG | Bank of America | |
| | Dänemark | | | (1.217.518) | thyssenkrupp AG | Merrill Lynch | (29.453) |
| (747.796) | Ambu A/S 'B' | Bank of America | (878.530) | (60.167) | Varta AG | Bank of America | |
| (3.765) | AP Moller - Maersk A/S 'B' | Merrill Lynch | | (41.853) | Volkswagen AG | Merrill Lynch | (18.000) |
| | | Bank of America | (131.583) | (107.366) | Zalando SE | Citibank | (788.952) |
| (264.672) | Demant A/S | Merrill Lynch | (544.016) | | | Citibank | (327.308) |
| (322.436) | FLSmidth & Co A/S | JP Morgan | (307.726) | | | Bank of America | |
| (222.761) | GN Store Nord A/S | Citibank | | | | Merrill Lynch | (734.520) |
| | | Bank of America | (992.587) | | | Barclays Bank | (250.163) |
| (104.803) | Netcompany Group A/S | Merrill Lynch | (1.064.535) | | | | (7.842.443) |
| (97.786) | Orsted A/S | JP Morgan | (124.871) | | Italien | | |
| (157.272) | SimCorp A/S | Barclays Bank | (1.746.198) | (422.766) | Azimut Holding SpA | Citibank | (101.464) |
| | | JP Morgan | (5.790.046) | (140.208) | Saipem SpA | Bank of America | |
| | | | | (1.018.167) | Saipem SpA | Merrill Lynch | (20.148) |
| | Finnland | | | (330.786) | Saipem SpA | Citibank | (252.505) |
| (360.320) | Konecranes Oyj | Citibank | (307.246) | | | JP Morgan | (201.905) |
| (1.559.669) | Outokumpu Oyj | Bank of America | | | | | (576.022) |
| | | Merrill Lynch | (991.950) | | Niederlande | | |
| (90.866) | QT Group Oyj | Citibank | (408.213) | (270.240) | APERAM SA | Citibank | (578.314) |
| | | | (1.707.409) | (266.098) | Signify NV | JP Morgan | (335.283) |
| | Frankreich | | | (139.689) | Unibail-Rodamco-Westfield (REIT) | Bank of America | |
| (396.363) | Alstom SA | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 604.853 |
| 112.361 | Alten SA | Merrill Lynch | (967.126) | | | | (308.744) |
| (30.304) | Arkema SA | Bank of America | 471.916 | | Norwegen | | |
| (367.325) | Bouygues SA | Merrill Lynch | 471.916 | (4.688.898) | AutoStore Holdings Ltd | Citibank | (1.080.176) |
| (388.706) | Casino Guichard | JP Morgan | 83.198 | (1.063.555) | AutoStore Holdings Ltd | JP Morgan | (367.676) |
| | Perrachon SA | Citibank | (47.752) | (1.076.030) | Scatec ASA | Citibank | 106.122 |
| (54.319) | Casino Guichard | Bank of America | 366.276 | | | | (1.341.730) |
| | Perrachon SA | Merrill Lynch | 366.276 | | Portugal | | |
| 251.159 | Legrand SA | Citibank | (38.023) | (1.504.357) | CTT-Correios de Portugal SA | Citibank | (30.087) |
| 59.624 | L'Oreal SA | Barclays Bank | 251.159 | | | | (30.087) |
| | | Bank of America | | | Spanien | | |
| 37.145 | LVMH Moet Hennessy | Merrill Lynch | 74.530 | (16.150) | Acciona SA | Barclays Bank | 83.980 |
| | Louis Vuitton SE | JP Morgan | 2.050.404 | (402.605) | ACS Actividades de Construccion y Servicios SA | Barclays Bank | (305.980) |
| (545.867) | Orange SA | Bank of America | 41.486 | (6.914.610) | Mapfre SA | JP Morgan | (199.594) |
| 96.882 | Pernod Ricard SA | Merrill Lynch | 668.486 | (639.149) | Red Electrica Corp SA | Bank of America | |
| (116.270) | Publicis Groupe SA | JP Morgan | | | | Merrill Lynch | (6.391) |
| | | Bank of America | 81.888 | (1.336.949) | Telefonica SA | Citibank | (347.607) |
| 80.834 | Teleperformance | Merrill Lynch | 234.419 | | | | (775.592) |
| | | Citibank | 3.270.861 | | Schweden | | |
| | Deutschland | | | 494.368 | AddTech AB 'B' | Bank of America | |
| (63.895) | Adidas AG | JP Morgan | (723.291) | 1.572.544 | Atlas Copco AB 'B' | Merrill Lynch | 343.017 |
| (892.841) | Auto1 Group SE | Bank of America | | (1.385.644) | Elektro AB 'B' | JP Morgan | 946.873 |
| | | Merrill Lynch | (995.518) | (75.665) | Evolution AB | JP Morgan | (1.749.009) |
| (199.011) | BASF SE | JP Morgan | (800.024) | | | Bank of America | |
| (232.527) | Delivery Hero SE | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (220.069) |
| | | Merrill Lynch | (1.395.162) | | | Bank of America | |
| (232.491) | Evonik Industries AG | JP Morgan | 105.200 | (667.249) | Hennes & Mauritz AB 'B' | Merrill Lynch | (240.998) |
| (524.911) | flatexDEGIRO AG | Citibank | (363.883) | 1.108.811 | Hexagon AB 'B' | BNP Paribas | 542.759 |
| (124.448) | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | Bank of America | 12.445 | (409.563) | Intrum AB | Citibank | 70.071 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|---|----------------------------------|---|
| Deutschland Fortsetzung | | | |
| (461.697) | Kinnevik AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (811.460) |
| (3.623.506) | Storskogen Group AB 'B' | JP Morgan | 285.863 |
| 293.602 | Thule Group AB | BNP Paribas | 97.672 |
| (342.090) | Volvo Car AB 'B' | Barclays Bank | 179.482 |
| (481.010) | Volvo Car AB 'B' | JP Morgan | (421.986) |
| | | | (977.785) |
| Schweiz | | | |
| (189.417) | ams-OSRAM AG | JP Morgan | (237.724) |
| (264.787) | Dufry AG Reg | BNP Paribas | (143.619) |
| (213.034) | Landis+Gyr Group AG | Barclays Bank | (155.444) |
| (49.529) | Swatch Group AG | Bank of America Merrill Lynch | (28.912) |
| (168.186) | Swiss Re AG | Bank of America Merrill Lynch | 379.614 |
| 30.449 | VAT Group AG | JP Morgan | 716.890 |
| (65.407) | Zur Rose Group AG | Bank of America Merrill Lynch | (477.254) |
| | | | 53.551 |
| Großbritannien | | | |
| (3.897.882) | Ashmore Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (797.037) |
| 167.523 | Ashtead Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 594.541 |
| (812.279) | Aston Martin Lagonda Global Holdings Plc | Barclays Bank | (408.554) |
| 223.753 | AstraZeneca Plc | JP Morgan | (55.355) |
| 135.340 | Auto Trader Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 48.987 |
| (366.953) | AVEVA Group Plc | JP Morgan | (892.650) |
| (164.024) | Burberry Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (223.597) |
| 1.050.408 | Compass Group Plc | Citibank | 524.623 |
| (2.780.857) | DS Smith Plc | Bank of America Merrill Lynch | (101.307) |
| 338.150 | Experian Plc | Citibank | 254.326 |
| (1.213.990) | Hargreaves Lansdown Plc | BNP Paribas | 1.288.284 |
| (4.575.084) | J Sainsbury Plc | Citibank | 99.701 |
| 12.379.146 | JD Sports Fashion Plc | Citibank | (145.476) |
| (449.274) | Just Eat Takeaway.com NV | Citibank | (573.067) |
| (2.625.066) | Kingfisher Plc | BNP Paribas | (256.047) |
| (2.241.169) | Network International Holdings Plc | Barclays Bank | 126.420 |
| (864.941) | Ocado Group Plc | JP Morgan | (1.418.968) |
| 2.154.422 | Rightmove Plc | Bank of America Merrill Lynch | 962.088 |
| (9.860.144) | Rolls-Royce Holdings Plc | JP Morgan | (946.686) |
| (2.775.195) | Royal Mail Plc | Bank of America Merrill Lynch | 652.265 |
| 89.296 | Spirax-Sarco Engineering Plc | Citibank | 157.407 |
| (5.334.031) | Standard Life Aberdeen Plc | Citibank | (267.974) |
| (2.130.162) | TUI AG | Bank of America Merrill Lynch | 1.144.009 |
| (566.837) | TUI AG | JP Morgan | 146.549 |
| (2.578.324) | Wise Plc 'A' | JP Morgan | (1.134.394) |
| (224.254) | Wizz Air Holdings Plc | BNP Paribas | 234.548 |
| (560.900) | WPP Plc | Bank of America Merrill Lynch | (37.642) |
| | | | (1.025.006) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 1.007.189.891) | | | (17.327.496) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISETERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 83.801.920 | CHF | 87.716.056 | Deutsche Bank | 17/6/2022 | (1.540.969) |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 24.331.247 | EUR | 23.375.118 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 297.727 |
| EUR | 1.297.845 | CHF | 1.350.997 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (16.596) |
| | | | | | | 281.131 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 517.764 | GBP | 443.773 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (3.533) |
| GBP | 8.100.610 | EUR | 9.455.068 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 60.687 |
| | | | | | | 57.154 |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 218.875 | USD | 231.254 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 3.133 |
| USD | 11.565.215 | EUR | 10.906.961 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (117.483) |
| | | | | | | (114.350) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 131.372.446) | | | | | | (1.317.034) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|---------------------------------------|--------------|
| Finanzen | 57,35 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 14,46 |
| Zyklische Konsumgüter | 10,85 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 8,06 |
| Industrie | 7,33 |
| Grundstoffe | 2,23 |
| Technologie | 1,36 |
| Mit Hypotheken besicherte Wertpapiere | 0,95 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 102,59 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | (2,59) |
| | 100,00 |

BlackRock European Opportunities Extension Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Schweiz Fortsetzung | | | |
| | | | | 25.289 | Tecan Group AG Reg | 7.730.402 | 1,28 |
| | | | | 9.452 | VAT Group AG | 2.628.150 | 0,43 |
| | | | | | | 88.053.097 | 14,57 |
| STAMMAKTIEEN | | | | Großbritannien | | | |
| | Belgien | | | 1.250.894 | BP Plc | 6.448.211 | 1,07 |
| 219.145 | Azelis Group NV | 5.224.417 | 0,86 | 332.205 | Computacenter Plc | 9.995.458 | 1,65 |
| 151.626 | KBC Group NV | 8.851.926 | 1,46 | 576.827 | FDM Group Holdings Plc | 6.328.997 | 1,05 |
| 233.174 | Kinepolis Group NV | 11.593.411 | 1,92 | 150.109 | InterContinental Hotels Group Plc | 8.749.616 | 1,45 |
| 1.955 | Lotus Bakeries NV | 8.914.800 | 1,48 | 6.427.171 | JD Sports Fashion Plc | 9.263.775 | 1,53 |
| | | 34.584.554 | 5,72 | 726.406 | RELX Plc | 19.409.568 | 3,21 |
| | Dänemark | | | | | 60.195.625 | 9,96 |
| 177.473 | DSV PANALPINA A/S | 27.016.711 | 4,47 | Gesamt Stammaktien | | 540.242.464 | 89,39 |
| 27.599 | Genmab A/S | 7.861.154 | 1,30 | | | | |
| 382.819 | Novo Nordisk A/S 'B' | 39.571.434 | 6,55 | EINLAGENZERTIFIKATE | | | |
| 385.843 | Royal Unibrew A/S | 31.481.925 | 5,21 | Schweiz | | | |
| 748.435 | Tryg A/S | 16.433.694 | 2,72 | EUR 5.000.000 | Zuercher Kantonalbank 15/8/2022 (Zero Coupon) | 5.006.242 | 0,83 |
| | | 122.364.918 | 20,25 | | | 5.006.242 | 0,83 |
| | Finnland | | | Gesamt Einlagenzertifikate | | 5.006.242 | 0,83 |
| 926.358 | Nordea Bank Abp | 8.778.422 | 1,45 | | | | |
| | | 8.778.422 | 1,45 | KURZFRISTIGE TITEL | | | |
| | Frankreich | | | | | | |
| 105.657 | Alten SA | 13.143.731 | 2,17 | Frankreich | | | |
| 6.724 | Hermes International | 7.382.952 | 1,22 | EUR 10.000.000 | Svenska Handelsbanken AB 12/9/2022 (Zero Coupon) | 10.009.811 | 1,66 |
| 170.000 | Sanofi | 16.821.500 | 2,78 | | | 10.009.811 | 1,66 |
| 28.298 | Sartorius Stedim Biotech | 9.216.658 | 1,53 | Gesamt kurzfristige Titel | | 10.009.811 | 1,66 |
| 90.219 | Schneider Electric SE | 11.658.099 | 1,93 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 555.258.517 | 91,88 |
| 20.491 | Teleperformance | 6.331.719 | 1,05 | | | | |
| 99.217 | Vinci SA | 8.928.538 | 1,48 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| 29.794 | Virbac SA | 11.187.647 | 1,85 | | | | |
| | | 84.670.844 | 14,01 | Irland | | | |
| | Deutschland | | | 474.366 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc) ⁻ | 46.604.166 | 7,71 |
| 63.960 | Amadeus Fire AG | 8.672.976 | 1,44 | | | 46.604.166 | 7,71 |
| 1.142.839 | Commerzbank AG | 9.195.283 | 1,52 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 46.604.166 | 7,71 |
| | | 17.868.259 | 2,96 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 601.862.683 | 99,59 |
| | Irland | | | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 2.493.068 | 0,41 |
| 72.494 | Linde Plc | 21.904.062 | 3,63 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 604.355.751 | 100,00 |
| | | 21.904.062 | 3,63 | | | | |
| | Luxemburg | | | [^] Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |
| 793.217 | Tenaris SA | 12.596.286 | 2,08 | ⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9. | | | |
| | | 12.596.286 | 2,08 | | | | |
| | Niederlande | | | | | | |
| 4.871 | Adyen NV | 7.020.085 | 1,16 | | | | |
| 11.404 | ASML Holding NV | 6.159.301 | 1,02 | | | | |
| 607.595 | Davide Campari-Milano NV [*] | 6.045.570 | 1,00 | | | | |
| 132.974 | IMCD NV | 18.616.360 | 3,08 | | | | |
| | | 37.841.316 | 6,26 | | | | |
| | Schweden | | | | | | |
| 323.261 | AddLife AB 'B' [^] | 7.453.951 | 1,23 | | | | |
| 594.253 | AddTech AB 'B' | 9.449.520 | 1,56 | | | | |
| 524.467 | Assa Abloy AB 'B' | 12.118.408 | 2,01 | | | | |
| 309.365 | Hemnet Group AB | 4.181.318 | 0,69 | | | | |
| 1.077.029 | Hexagon AB 'B' | 12.376.451 | 2,05 | | | | |
| 185.820 | Thule Group AB [*] | 5.805.433 | 0,96 | | | | |
| | | 51.385.081 | 8,50 | | | | |
| | Schweiz | | | | | | |
| 225.254 | Alcon Inc | 15.853.138 | 2,62 | | | | |
| 86.792 | BV Holding AG | 4.703.261 | 0,78 | | | | |
| 39.849 | Cie Financiere Richemont SA 'A' Reg | 4.090.102 | 0,68 | | | | |
| 59.126 | Lonza Group AG Reg [^] | 33.282.900 | 5,51 | | | | |
| 6.290 | Partners Group Holding AG [*] | 6.321.428 | 1,05 | | | | |
| 112.527 | Straumann Holding AG Reg | 13.443.716 | 2,22 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Opportunities Extension Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------------|--|-------------------------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (27.203) | Henkel AG & Co KGaA (Pref) | Bank of America Merrill Lynch | 16.322 |
| Belgien | | | | (22.408) | SAP SE | Citibank | 6.570 |
| (49.467) | Colruyt SA | Bank of America Merrill Lynch | 165.714 | (99.689) | Siemens Energy AG | JP Morgan | (131.589) |
| (117.486) | Proximus SADP | Bank of America Merrill Lynch | 41.708 | (243.722) | thyssenkrupp AG | Citibank | (157.932) |
| (32.759) | Umicore SA | JP Morgan | (104.501) | (9.441) | Volkswagen AG | Bank of America Merrill Lynch | (165.690) |
| | | | 102.921 | (34.711) | Zalando SE | Barclays Bank | (80.877) |
| | | | | | | | (1.461.164) |
| Dänemark | | | | Italien | | | |
| (119.049) | Ambu A/S 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (139.862) | (76.501) | Azimut Holding SpA | JP Morgan | (43.396) |
| (555) | AP Moller - Maersk A/S 'B' | Citibank | 28.349 | (120.016) | Saipem SpA | Bank of America Merrill Lynch | (17.246) |
| (54.565) | FLSmidth & Co A/S | Bank of America Merrill Lynch | (76.280) | (204.271) | Saipem SpA | Citibank | (50.659) |
| (47.792) | GN Store Nord A/S | Bank of America Merrill Lynch | (247.139) | (41.875) | Saipem SpA | JP Morgan | (25.558) |
| (21.153) | Netcompany Group A/S | Citibank | (65.397) | | | | (136.859) |
| (12.338) | Orsted A/S | Bank of America Merrill Lynch | (105.976) | Niederlande | | | |
| (29.110) | SimCorp A/S | Bank of America Merrill Lynch | (128.345) | (53.928) | APERAM SA | Bank of America Merrill Lynch | (251.844) |
| | | | (734.650) | 59.946 | Koninklijke DSM NV | Barclays Bank | 998.101 |
| Finnland | | | | (53.567) | Signify NV | Bank of America Merrill Lynch | (60.531) |
| (84.031) | Konecranes Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (163.017) | (168.491) | TomTom NV | Barclays Bank | 68.239 |
| (140.902) | Lassila & Tikanoja Oyj | JP Morgan | (73.269) | (30.709) | Unibail-Rodamco-Westfield (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 132.970 |
| (301.439) | Outokumpu Oyj | Citibank | (94.049) | | | | 886.935 |
| (19.109) | QT Group Oyj | Barclays Bank | (85.847) | Norwegen | | | |
| | | | (416.182) | (226.022) | AutoStore Holdings Ltd | Citibank | (52.068) |
| Frankreich | | | | (766.010) | AutoStore Holdings Ltd | JP Morgan | (264.814) |
| 169.509 | Airbus SE | Barclays Bank | 352.579 | (224.023) | Scatec ASA | Citibank | 22.557 |
| 835.618 | ALD SA | Bank of America Merrill Lynch | (551.508) | | | | (294.325) |
| (74.184) | Alstom SA | Bank of America Merrill Lynch | (181.009) | Spanien | | | |
| (122.698) | Bonduelle SCA | Citibank | (137.422) | (4.867) | Acciona SA | Barclays Bank | 25.308 |
| (76.373) | Bouygues SA | Citibank | (9.928) | (81.991) | ACS Actividades de Construccion y Servicios SA | Barclays Bank | (62.313) |
| (29.645) | Casino Guichard Perrachon SA | Bank of America Merrill Lynch | 29.645 | (1.357.004) | Mapfre SA | JP Morgan | (39.353) |
| (70.386) | Casino Guichard Perrachon SA | JP Morgan | (86.575) | (124.383) | Red Electrica Corp SA | Citibank | 50.997 |
| (21.249) | Faurecia SE | Bank of America Merrill Lynch | (75.221) | (328.946) | Telefonica SA | Bank of America Merrill Lynch | (99.013) |
| (21.249) | Faurecia SE | JP Morgan | (120.801) | | | | (124.374) |
| 35.675 | L'Oreal SA | Bank of America Merrill Lynch | 44.594 | Schweden | | | |
| 32.819 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | Citibank | 1.211.021 | 356.016 | Atlas Copco AB 'A' | Citibank | 192.880 |
| 52.996 | Pernod Ricard SA | JP Morgan | 365.672 | 950.232 | Atlas Copco AB 'B' | JP Morgan | 572.162 |
| 45.399 | Teleperformance | JP Morgan | 195.216 | (190.609) | Elekta AB 'B' | JP Morgan | (240.594) |
| | | | 1.036.263 | (15.099) | Evolution AB | Bank of America Merrill Lynch | (43.915) |
| Deutschland | | | | (50.665) | Hennes & Mauritz AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (18.299) |
| (10.819) | Adidas AG | JP Morgan | (122.471) | (342.034) | Instalco AB | Bank of America Merrill Lynch | (82.249) |
| (168.491) | Auto1 Group SE | Bank of America Merrill Lynch | (187.867) | (89.671) | Intrum AB | Citibank | 15.341 |
| (27.265) | BASF SE | Citibank | (37.217) | (87.384) | Kinnevik AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (153.583) |
| (170.939) | Bauer AG | JP Morgan | (47.863) | (683.245) | Storskogen Group AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 188.329 |
| (55.246) | Delivery Hero SE | Bank of America Merrill Lynch | (331.476) | (188.031) | Volvo Car AB 'B' | JP Morgan | (164.958) |
| (101.513) | ElringKlinger AG | Citibank | (83.241) | | | | 265.114 |
| (69.425) | ElringKlinger AG | JP Morgan | (83.657) | Schweiz | | | |
| (104.264) | flatexDEGIRO AG | Bank of America Merrill Lynch | (51.820) | (35.324) | ams-OSRAM AG | Bank of America Merrill Lynch | (20.792) |
| (34.820) | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | Bank of America Merrill Lynch | 3.482 | (68.508) | Dufry AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (217.948) |
| (35.881) | HeidelbergCement AG | JP Morgan | 1.435 | (33.486) | Landis+Gyr Group AG | Barclays Bank | (24.434) |
| (48.488) | HelloFresh SE | Barclays Bank | (7.273) | 45.594 | Medartis Holding AG | Citibank | 243.969 |
| | | | | 53.801 | Sika AG Reg | JP Morgan | 429.209 |
| | | | | (183.610) | Softwareone Holding AG | JP Morgan | (200.068) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Opportunities Extension Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|---|----------------------------------|---|
| Schweiz Fortsetzung | | | |
| (6.358) | Stadler Rail AG | JP Morgan | (1.856) |
| (10.950) | Swatch Group AG | Bank of America Merrill Lynch | (6.392) |
| (30.321) | Swiss Re AG | JP Morgan | (35.989) |
| (20.755) | Zur Rose Group AG | Bank of America Merrill Lynch | (151.442) |
| | | | 14.257 |
| Großbritannien | | | |
| (812.179) | Ashmore Group Plc | JP Morgan | (265.337) |
| 149.496 | Ashtead Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 530.563 |
| (151.908) | Aston Martin Lagonda Global Holdings Plc | Barclays Bank | (76.406) |
| 1.325.935 | Auto Trader Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 479.925 |
| (74.601) | AVEVA Group Plc | JP Morgan | (181.474) |
| 2.285.948 | BP Plc | Bank of America Merrill Lynch | 478.798 |
| (50.583) | Burberry Group Plc | Citibank | (41.313) |
| (77.476) | Carnival Plc | JP Morgan | 55.084 |
| 445.526 | Compass Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 292.962 |
| (475.865) | DS Smith Plc | Bank of America Merrill Lynch | (17.336) |
| (213.761) | Hargreaves Lansdown Plc | Bank of America Merrill Lynch | 37.178 |
| 970.268 | Hiscox Ltd | Citibank | (451.531) |
| (865.889) | J Sainsbury Plc | Citibank | 18.870 |
| (92.288) | Just Eat Takeaway.com NV | Bank of America Merrill Lynch | (65.856) |
| (643.138) | Kingfisher Plc | JP Morgan | (156.450) |
| (719.262) | Marks & Spencer Group Plc | JP Morgan | (136.576) |
| (3.528.710) | N Brown Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (290.278) |
| (649.791) | Network International Holdings Plc | Barclays Bank | 36.653 |
| (171.804) | Ocado Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (224.512) |
| (1.202.634) | Rolls-Royce Holdings Plc | Citibank | (49.889) |
| (479.802) | Royal Mail Plc | Citibank | 96.418 |
| 73.624 | Spirax-Sarco Engineering Plc | Bank of America Merrill Lynch | (259.562) |
| (1.159.807) | Standard Life Aberdeen Plc | Citibank | (58.267) |
| (347.388) | TUI AG | Citibank | 13.472 |
| (373.276) | TUI AG | JP Morgan | 96.506 |
| (485.494) | Wise Plc 'A' | JP Morgan | (213.456) |
| (49.929) | Wizz Air Holdings Plc | Citibank | 163.703 |
| | | | (188.111) |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| (54.632) | Carnival Corp | Citibank | (46.919) |
| | | | (46.919) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 328.241.949) | | | (1.097.094) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Opportunities Extension Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| GBP | 80.787.642 | EUR | 94.924.669 | State Street Bank & Trust Company | 17/6/2022 | (33.844) |
| NOK | 56.112.980 | EUR | 5.477.890 | State Street Bank & Trust Company | 17/6/2022 | 78.503 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 100.447.218) | | | | | | 44.659 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Nicht zyklische Konsumgüter | 40,37 |
| Industrie | 14,45 |
| Zyklische Konsumgüter | 13,26 |
| Finanzen | 11,47 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 7,71 |
| Technologie | 6,94 |
| Grundstoffe | 3,63 |
| Energie | 1,07 |
| Kommunikation | 0,69 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 99,59 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 0,41 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|---------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | | | |
| STAMMAKTIE | | | | | | | |
| Österreich | | | | Spanien | | | |
| 10.539 | BAWAG Group AG | 505.661 | 0,13 | 441.804 | Banco Santander SA | 1.334.911 | 0,35 |
| 16.341 | Erste Group Bank AG | 477.648 | 0,13 | 33.478 | Industria de Diseno Textil SA | 748.233 | 0,20 |
| 22.444 | Raiffeisen Bank International AG | 279.203 | 0,07 | | | 2.083.144 | 0,55 |
| | | 1.262.512 | 0,33 | Schweden | | | |
| Belgien | | | | 58.357 | Alfa Laval AB | 1.475.979 | 0,39 |
| 22.464 | Azelis Group NV | 535.542 | 0,14 | 80.109 | Epiroc AB 'B' | 1.265.479 | 0,33 |
| 38.377 | KBC Group NV | 2.240.449 | 0,59 | 333.957 | Tele2 AB 'B' | 3.793.158 | 0,99 |
| | | 2.775.991 | 0,73 | 102.293 | Volvo AB 'B' | 1.670.754 | 0,44 |
| Dänemark | | | | | | 8.205.370 | 2,15 |
| 14.975 | DSV PANALPINA A/S | 2.279.644 | 0,59 | Schweiz | | | |
| 41.659 | Novo Nordisk A/S 'B' | 4.306.229 | 1,13 | 6.060 | Lonza Group AG Reg | 3.411.263 | 0,89 |
| 152.763 | Tryg A/S | 3.354.280 | 0,88 | 21.937 | Nestle SA Reg | 2.495.770 | 0,65 |
| | | 9.940.153 | 2,60 | 26.544 | Novartis AG Reg [^] | 2.237.944 | 0,59 |
| Finnland | | | | 14.062 | Roche Holding AG [^] | 4.476.356 | 1,17 |
| 244.758 | Nordea Bank Abp | 2.319.394 | 0,61 | 6.448 | Sika AG Reg | 1.673.690 | 0,44 |
| 49.026 | Sampo Oyj 'A' | 2.070.858 | 0,54 | 10.128 | Zurich Insurance Group AG [^] | 4.300.042 | 1,13 |
| | | 4.390.252 | 1,15 | | | 18.595.065 | 4,87 |
| Frankreich | | | | Großbritannien | | | |
| 43.928 | BNP Paribas SA | 2.339.605 | 0,61 | 36.140 | AstraZeneca Plc | 4.411.849 | 1,15 |
| 40.386 | Cie de Saint-Gobain | 2.232.538 | 0,58 | 256.438 | Auto Trader Group Plc | 1.769.575 | 0,46 |
| 70.221 | Euroapi SA | 958.938 | 0,25 | 400.619 | Barclays Plc | 802.141 | 0,21 |
| 3.464 | L'Oreal SA [^] | 1.139.829 | 0,30 | 330.932 | BP Plc | 1.705.915 | 0,45 |
| 2.914 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 1.741.989 | 0,46 | 756.589 | Direct Line Insurance Group Plc [^] | 2.290.374 | 0,60 |
| 42.557 | Sanofi | 4.211.015 | 1,10 | 28.035 | InterContinental Hotels Group Plc | 1.634.116 | 0,43 |
| 21.196 | Societe Generale SA | 531.172 | 0,14 | 127.608 | Persimmon Plc [^] | 3.255.049 | 0,85 |
| 5.706 | Teleperformance | 1.763.154 | 0,46 | 457.954 | Phoenix Group Holdings Plc | 3.432.472 | 0,90 |
| 98.267 | TotalEnergies SE | 5.456.767 | 1,43 | 102.867 | RELX Plc | 2.748.952 | 0,72 |
| 24.000 | Veolia Environnement SA | 634.080 | 0,17 | | | 22.050.443 | 5,77 |
| | | 21.009.087 | 5,50 | Gesamt Stammaktien | | | |
| Deutschland | | | | | | 113.228.490 | 29,65 |
| 15.889 | Allianz SE Reg [^] | 3.094.859 | 0,81 | ANLEIHEN | | | |
| 10.507 | LEG Immobilien AG | 992.701 | 0,26 | Australien | | | |
| 12.043 | MTU Aero Engines AG [^] | 2.218.923 | 0,58 | EUR 100.000 | APA Infrastructure Ltd RegS 0,75% 15/3/2029 | 85.071 | 0,02 |
| 41.487 | RWE AG | 1.685.202 | 0,44 | EUR 550.000 | APA Infrastructure Ltd RegS 2,00% 15/7/2030 [^] | 491.568 | 0,13 |
| 16.444 | Siemens AG Reg | 2.025.901 | 0,53 | EUR 400.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd RegS 0,25% 17/3/2025 | 388.852 | 0,10 |
| | | 10.017.586 | 2,62 | EUR 305.000 | Macquarie Group Ltd RegS 0,35% 3/3/2028 | 264.225 | 0,07 |
| Irland | | | | EUR 500.000 | National Australia Bank Ltd RegS 0,625% 16/3/2027 [^] | 477.465 | 0,13 |
| 7.578 | Linde Plc | 2.289.693 | 0,60 | | | 1.707.181 | 0,45 |
| | | 2.289.693 | 0,60 | Österreich | | | |
| Italien | | | | EUR 200.000 | BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029 | 197.778 | 0,05 |
| 41.584 | ACEA SpA | 705.680 | 0,18 | EUR 400.000 | Erste Group Bank AG RegS 0,05% 16/9/2025 [^] | 376.128 | 0,10 |
| 174.177 | Enel SpA | 1.055.687 | 0,28 | EUR 100.000 | Erste Group Bank AG RegS 0,01% 12/7/2028 | 90.596 | 0,02 |
| 84.859 | UniCredit SpA | 919.193 | 0,24 | EUR 100.000 | Kommunalkredit Austria AG RegS 0,25% 14/5/2024 | 96.790 | 0,02 |
| | | 2.680.560 | 0,70 | EUR 300.000 | Raiffeisenlandesbank Niederösterreich-Wien AG RegS 1,25% 21/4/2027 | 295.563 | 0,08 |
| Niederlande | | | | EUR 965.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 1,20% 20/10/2025 | 977.622 | 0,26 |
| 2.117 | ASML Holding NV | 1.143.392 | 0,30 | EUR 1.200.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,50% 20/4/2027 | 1.168.224 | 0,31 |
| | | 1.143.392 | 0,30 | | | | |
| Norwegen | | | | | | | |
| 104.059 | Gjensidige Forsikring ASA | 2.101.283 | 0,55 | | | | |
| | | 2.101.283 | 0,55 | | | | |
| Portugal | | | | | | | |
| 996.375 | EDP - Energias de Portugal SA | 4.683.959 | 1,23 | | | | |
| | | 4.683.959 | 1,23 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|----------------|--|------------------------|--------------------|
| | Österreich Fortsetzung | | | | Belgien Fortsetzung | | |
| EUR 300.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 20/10/2028 (Zero Coupon) | 275.496 | 0,07 | EUR 150.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,40% 22/6/2053 | 120.087 | 0,03 |
| EUR 1.932.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,90% 20/2/2032 | 1.801.262 | 0,47 | EUR 180.004 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,65% 22/6/2071 | 92.302 | 0,02 |
| EUR 410.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 4,15% 15/3/2037 | 533.623 | 0,14 | | | 8.009.517 | 2,10 |
| EUR 1.260.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 1,85% 23/5/2049 | 1.235.291 | 0,32 | | Kanada | | |
| EUR 86.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 3,80% 26/1/2062 | 127.488 | 0,03 | EUR 890.000 | Bank of Nova Scotia RegS 0,01% 15/12/2027 | 813.015 | 0,21 |
| EUR 191.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 2,10% 20/9/2117 | 177.716 | 0,05 | EUR 918.000 | Bank of Nova Scotia RegS 0,01% 14/9/2029 | 805.407 | 0,21 |
| EUR 45.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,85% 30/6/2120 | 21.748 | 0,01 | EUR 770.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce RegS 0,375% 10/3/2026 | 739.993 | 0,20 |
| | | 7.375.325 | 1,93 | EUR 514.000 | CPPIB Capital Inc RegS 0,375% 20/6/2024 | 507.097 | 0,13 |
| | | | | EUR 680.000 | CPPIB Capital Inc RegS 0,875% 6/2/2029 | 643.403 | 0,17 |
| | | | | EUR 700.000 | Royal Bank of Canada RegS 0,125% 26/4/2027 | 652.342 | 0,17 |
| | | | | | | 4.161.257 | 1,09 |
| | Belgien | | | | China | | |
| EUR 400.000 | Ageas SA RegS FRN 31/12/2099 | 347.856 | 0,09 | EUR 386.000 | China Government International Bond RegS 0,50% 12/11/2031 | 323.758 | 0,08 |
| EUR 125.000 | Anheuser-Busch InBev SA RegS 3,70% 2/4/2040 | 130.709 | 0,03 | | | 323.758 | 0,08 |
| EUR 800.000 | Argenta Spaarbank NV RegS 1,00% 6/2/2024 [^] | 793.168 | 0,21 | | Zypern | | |
| EUR 400.000 | Argenta Spaarbank NV RegS FRN 8/2/2029 [^] | 359.288 | 0,09 | EUR 277.000 | Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023 | 287.496 | 0,07 |
| EUR 400.000 | Belfius Bank SA RegS FRN 6/4/2034 | 335.356 | 0,09 | EUR 508.000 | Cyprus Government International Bond RegS 0,625% 3/12/2024 | 498.058 | 0,13 |
| EUR 200.000 | Fluxys Belgium SA RegS 1,75% 5/10/2027 | 189.866 | 0,05 | EUR 1.200.000 | Cyprus Government International Bond RegS 0,95% 20/1/2032 | 1.019.256 | 0,27 |
| EUR 600.000 | KBC Group NV RegS FRN 21/1/2028 | 554.088 | 0,15 | | | 1.804.810 | 0,47 |
| EUR 100.000 | KBC Group NV RegS FRN 7/12/2031 | 87.882 | 0,02 | | Tschechische Republik | | |
| EUR 835.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,50% 22/10/2024 | 832.370 | 0,22 | CZK 19.000.000 | Czech Republic Government Bond 1,75% 23/6/2032 | 592.589 | 0,16 |
| EUR 2.250.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,80% 22/6/2028 | 2.200.680 | 0,58 | | | 592.589 | 0,16 |
| EUR 525.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,90% 22/6/2029 | 510.437 | 0,13 | | Dänemark | | |
| EUR 194.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,35% 22/6/2032 | 169.573 | 0,05 | EUR 500.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 15/5/2031 | 451.310 | 0,12 |
| EUR 150.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,25% 22/4/2033 | 144.252 | 0,04 | DKK 3.594.000 | Denmark Government Bond 1,75% 15/11/2025 | 496.364 | 0,13 |
| EUR 341.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,45% 22/6/2037 | 317.423 | 0,08 | DKK 3.292.000 | Denmark Government Bond 4,50% 15/11/2039 | 631.947 | 0,17 |
| EUR 174.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,90% 22/6/2038 | 171.366 | 0,05 | EUR 100.000 | Kommunekredit RegS 0,875% 3/11/2036 | 84.887 | 0,02 |
| EUR 345.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,40% 22/6/2040 | 257.042 | 0,07 | DKK 5.900.709 | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 0,50% 1/10/2050 | 613.580 | 0,16 |
| EUR 451.264 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,60% 22/6/2047 | 395.772 | 0,10 | DKK 55.170 | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab RegS 1,00% 1/10/2050 | 6.025 | 0,00 |
| | | | | DKK 4.986.311 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/10/2053 | 538.887 | 0,14 |
| | | | | DKK 3.786.984 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | 418.180 | 0,11 |
| | | | | DKK 0 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | — | 0,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-----------------------------|--|------------------------|--------------------|-------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Dänemark Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | | |
| DKK 1.760.366 | Nykredit Realkredit A/S RegS 2,00% 1/10/2053 | 206.457 | 0,06 | EUR 1.100.000 | BPCE SFH SA RegS 1,125% 12/4/2030 | 1.047.002 | 0,27 |
| EUR 100.000 | Orsted A/S RegS FRN 9/12/3019 | 89.850 | 0,02 | EUR 200.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 27/5/2030 | 173.872 | 0,05 |
| DKK 1 | Realkredit Danmark A/S RegS 0,50% 1/10/2050 | — | 0,00 | EUR 1.000.000 | BPCE SFH SA RegS 0,125% 3/12/2030 | 868.160 | 0,23 |
| | | 3.537.487 | 0,93 | EUR 500.000 | BPCE SFH SA RegS 1,75% 27/5/2032 | 491.190 | 0,13 |
| Finnland | | | | EUR 500.000 | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale RegS 1,50% 25/5/2032 | 483.355 | 0,13 |
| EUR 837.000 | Finland Government Bond RegS 0,125% 15/9/2031 | 732.183 | 0,19 | EUR 500.000 | Caisse des Depots et Consignations RegS 0,01% 1/6/2026 | 477.100 | 0,13 |
| EUR 2.996.000 | Finland Government Bond RegS 1,50% 15/9/2032 | 2.940.544 | 0,77 | EUR 200.000 | Caisse Francaise de Financement Local RegS 1,125% 9/9/2025 | 198.826 | 0,05 |
| EUR 75.000 | Finland Government Bond RegS 0,25% 15/9/2040 | 55.794 | 0,01 | EUR 300.000 | Cie de Financement Foncier SA RegS 0,75% 29/5/2026 | 292.233 | 0,08 |
| EUR 1.002.000 | Finland Government Bond RegS 1,375% 15/4/2047 | 906.950 | 0,24 | EUR 100.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,875% 21/9/2023 | 99.910 | 0,03 |
| EUR 377.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,375% 16/6/2028 | 328.348 | 0,09 | EUR 200.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,625% 15/3/2024 | 197.442 | 0,05 |
| | | 4.963.819 | 1,30 | EUR 600.000 | Coentreprise de Transport d'Electricite SA RegS 0,875% 29/9/2024 | 590.874 | 0,15 |
| Frankreich | | | | EUR 200.000 | Credit Agricole Assurances SA RegS FRN 27/9/2048 | 207.272 | 0,05 |
| EUR 1.100.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 1,00% 31/1/2028 | 1.074.865 | 0,28 | EUR 100.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA RegS 0,25% 23/2/2024 | 98.875 | 0,03 |
| EUR 1.300.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 1,625% 25/5/2032 | 1.263.873 | 0,33 | EUR 200.000 | Credit Agricole SA RegS 1,375% 13/3/2025 | 197.260 | 0,05 |
| EUR 1.400.000 | Agence France Locale RegS 0,20% 20/3/2029 | 1.276.618 | 0,33 | EUR 700.000 | Credit Mutuel - CIC Home Loan SFH SA RegS 0,25% 30/4/2024 | 690.032 | 0,18 |
| EUR 500.000 | AXA Home Loan SFH SA RegS 0,75% 22/10/2026 | 484.485 | 0,13 | EUR 700.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,375% 3/10/2028* | 614.544 | 0,16 |
| EUR 700.000 | AXA Home Loan SFH SA RegS 0,01% 16/10/2029 | 617.246 | 0,16 | EUR 300.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,125% 23/5/2029 | 271.533 | 0,07 |
| EUR 300.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,125% 5/2/2024* | 294.762 | 0,08 | EUR 300.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,75% 18/1/2030 | 259.980 | 0,07 |
| EUR 300.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,01% 7/3/2025 | 286.731 | 0,08 | EUR 1.600.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA RegS 0,625% 4/3/2027 | 1.536.880 | 0,40 |
| EUR 600.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,25% 19/7/2028* | 517.902 | 0,14 | GBP 2.800.000 | Dexia Credit Local SA RegS 1,625% 8/12/2023* | 3.266.257 | 0,86 |
| EUR 1.000.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 15/7/2025* | 972.390 | 0,25 | EUR 200.000 | Electricite de France SA RegS 1,00% 29/11/2033 | 160.520 | 0,04 |
| EUR 400.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 11/7/2030 | 348.408 | 0,09 | EUR 100.000 | Electricite de France SA RegS 2,00% 9/12/2049 | 69.168 | 0,02 |
| EUR 1.300.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 31/3/2032 | 1.239.134 | 0,32 | EUR 800.000 | Engie SA RegS 0,375% 11/6/2027 | 730.480 | 0,19 |
| GBP 200.000 | Bouygues SA RegS 5,50% 6/10/2026* | 260.857 | 0,07 | EUR 400.000 | Engie SA RegS 0,375% 26/10/2029 | 344.172 | 0,09 |
| EUR 500.000 | BPCE SA RegS 0,375% 5/10/2023 | 497.315 | 0,13 | EUR 200.000 | Engie SA RegS 2,00% 28/9/2037 | 167.864 | 0,04 |
| EUR 700.000 | BPCE SA RegS 1,00% 15/7/2024 | 694.673 | 0,18 | EUR 200.000 | Engie SA RegS 1,25% 24/10/2041 | 138.942 | 0,04 |
| EUR 200.000 | BPCE SA RegS 0,125% 4/12/2024 | 194.580 | 0,05 | EUR 500.000 | Faurecia SE RegS 2,75% 15/2/2027 | 430.235 | 0,11 |
| EUR 200.000 | BPCE SA RegS 1,00% 1/4/2025 | 194.824 | 0,05 | EUR 100.000 | Faurecia SE RegS 3,75% 15/6/2028 | 87.703 | 0,02 |
| EUR 400.000 | BPCE SA RegS 0,25% 14/1/2031 | 325.628 | 0,09 | EUR 113.912 | FCT Autonoria '2019-1 B' RegS FRN 25/9/2035 | 112.961 | 0,03 |
| EUR 100.000 | BPCE SA RegS FRN 2/3/2032 | 94.374 | 0,02 | EUR 200.000 | FCT Noria '2021-1 C' RegS FRN 25/10/2049 | 194.885 | 0,05 |
| EUR 200.000 | BPCE SA RegS FRN 13/10/2046 | 157.036 | 0,04 | EUR 100.000 | France Government Bond OAT RegS 1,75% 25/11/2024 | 102.707 | 0,03 |
| EUR 1.500.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 21/1/2027 | 1.400.790 | 0,37 | EUR 4.180.000 | France Government Bond OAT RegS 25/2/2025 (Zero Coupon)* | 4.093.600 | 1,07 |
| EUR 1.000.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 10/11/2027 | 918.510 | 0,24 | | | | |
| EUR 900.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 16/10/2028 | 811.422 | 0,21 | | | | |
| EUR 900.000 | BPCE SFH SA RegS 0,75% 23/2/2029 | 846.342 | 0,22 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-------------------------------|--|------------------------|--------------------|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Frankreich Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| EUR 32.203 | France Government Bond OAT RegS 25/2/2026 (Zero Coupon) | 31.115 | 0,01 | EUR 800.000 | Bertelsmann SE & Co KGaA RegS FRN 23/4/2075 | 800.608 | 0,21 |
| EUR 100.000 | France Government Bond OAT RegS 1,25% 25/5/2038 | 90.348 | 0,02 | EUR 36.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 15/8/2052 (Zero Coupon) | 23.886 | 0,01 |
| EUR 40.000 | France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2040 | 30.850 | 0,01 | EUR 380.000 | Commerzbank AG RegS 0,50% 15/3/2027 | 362.676 | 0,10 |
| EUR 2.450.000 | France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/6/2044 | 1.775.393 | 0,47 | EUR 700.000 | Commerzbank AG RegS FRN 29/12/2031 | 599.627 | 0,16 |
| EUR 130.000 | France Government Bond OAT RegS 3,25% 25/5/2045 | 157.729 | 0,04 | EUR 300.000 | Deutsche Bahn Finance GmbH RegS 0,625% 8/12/2050 | 180.381 | 0,05 |
| EUR 480.000 | France Government Bond OAT RegS 1,50% 25/5/2050 | 416.846 | 0,11 | EUR 49.000 | Deutsche Bahn Finance GMBH RegS 1,375% 16/4/2040 | 39.979 | 0,01 |
| EUR 1.260.000 | France Government Bond OAT RegS 0,75% 25/5/2052 | 870.521 | 0,23 | EUR 100.000 | Deutsche Bahn Finance GMBH RegS 1,125% 29/5/2051 | 69.538 | 0,02 |
| EUR 305.000 | France Government Bond OAT RegS 0,75% 25/5/2053 | 206.378 | 0,05 | EUR 200.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/5/2028 | 199.310 | 0,05 |
| EUR 217.000 | France Government Bond OAT RegS 4,00% 25/4/2060 | 314.544 | 0,08 | EUR 600.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/6/2032 | 576.288 | 0,15 |
| EUR 590.000 | France Government Bond OAT RegS 1,75% 25/5/2066 | 516.734 | 0,14 | EUR 700.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,125% 5/9/2024 [^] | 673.414 | 0,18 |
| EUR 140.000 | France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2072 | 68.006 | 0,02 | EUR 400.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 27/10/2025 | 372.476 | 0,10 |
| EUR 200.000 | Harmony French Home Loans FCT '2020-2 B' RegS FRN 27/8/2061 | 200.742 | 0,05 | EUR 400.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,01% 25/8/2026 | 376.836 | 0,10 |
| EUR 400.000 | La Banque Postale SA RegS FRN 2/8/2032 | 339.632 | 0,09 | EUR 264.000 | Deutsche Telekom AG RegS 1,75% 9/12/2049 | 199.895 | 0,05 |
| EUR 200.000 | Orange SA RegS 1,25% 7/7/2027 | 192.560 | 0,05 | EUR 878.000 | DZ HYP AG RegS 0,01% 26/10/2026 | 825.092 | 0,22 |
| EUR 200.000 | Orange SA RegS 1,375% 20/3/2028 | 191.496 | 0,05 | EUR 300.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,625% 3/11/2023 [^] | 302.109 | 0,08 |
| EUR 100.000 | Orange SA RegS 0,75% 29/6/2034 | 79.377 | 0,02 | EUR 200.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,113% 15/5/2032 | 173.230 | 0,05 |
| EUR 1.000.000 | Societe Du Grand Paris EPIC RegS 1,625% 8/4/2042 | 885.840 | 0,23 | EUR 300.000 | FMS Wertmanagement RegS 0,375% 29/4/2030 | 271.914 | 0,07 |
| EUR 500.000 | Societe Generale SA FRN 24/11/2030 [^] | 457.100 | 0,12 | EUR 225.000 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 1,875% 31/3/2028 | 206.242 | 0,05 |
| EUR 200.000 | Societe Generale SA RegS 0,125% 24/2/2026 | 186.424 | 0,05 | EUR 400.000 | Gemeinsame Deutsche Bundeslaender RegS 0,75% 25/9/2028 | 382.916 | 0,10 |
| EUR 200.000 | Societe Generale SA RegS 0,875% 1/7/2026 | 187.632 | 0,05 | EUR 765.000 | Gemeinsame Deutsche Bundeslaender RegS 0,625% 13/2/2029 [^] | 723.040 | 0,19 |
| EUR 800.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,50% 2/6/2025 | 782.024 | 0,20 | EUR 700.000 | Hamburg Commercial Bank AG RegS FRN 22/9/2026 | 651.427 | 0,17 |
| EUR 800.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,01% 2/12/2026 | 749.768 | 0,20 | EUR 200.000 | ING-DiBa AG RegS 0,25% 16/11/2026 [^] | 189.768 | 0,05 |
| EUR 400.000 | Thales SA RegS 26/3/2026 (Zero Coupon) | 372.476 | 0,10 | EUR 113.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,125% 4/10/2024 | 111.598 | 0,03 |
| EUR 800.000 | TotalEnergies Capital International SA RegS 0,696% 31/5/2028 | 743.104 | 0,19 | EUR 114.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,50% 15/9/2027 | 109.664 | 0,03 |
| EUR 509.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 447.981 | 0,12 | EUR 737.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,125% 30/6/2025 | 720.661 | 0,19 |
| EUR 600.000 | UNEDIC ASSEO RegS 1,75% 25/11/2032 | 591.786 | 0,16 | EUR 74.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 30/9/2026 (Zero Coupon) | 70.666 | 0,02 |
| EUR 500.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 473.425 | 0,12 | EUR 307.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,000% 10/1/2031 | 268.042 | 0,07 |
| EUR 500.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 436.585 | 0,11 | EUR 279.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,125% 9/1/2032 | 241.472 | 0,06 |
| | | 45.265.015 | 11,85 | EUR 141.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,375% 20/5/2036 | 114.725 | 0,03 |
| Deutschland | | | | | | | |
| EUR 1.100.000 | Bayer AG RegS FRN 25/3/2082 | 1.075.910 | 0,28 | | | | |
| EUR 700.000 | Bayerische Landesbank RegS FRN 22/11/2032 | 616.567 | 0,16 | | | | |
| EUR 916.000 | Berlin Hyp AG RegS 0,01% 24/8/2026 | 863.806 | 0,23 | | | | |
| EUR 525.000 | Berlin Hyp AG RegS 0,01% 24/1/2028 | 481.493 | 0,13 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|---|------------------------|--------------------|-----------------|--|------------------------|--------------------|
| | Deutschland Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | |
| EUR 732.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 1,125% 31/3/2037 | 657.131 | 0,17 | EUR 193.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,50% 12/1/2029 | 166.636 | 0,04 |
| EUR 688.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 1,125% 15/6/2037 | 615.285 | 0,16 | EUR 507.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,625% 19/7/2029 | 434.291 | 0,11 |
| EUR 933.000 | Land Baden-Wuerttemberg RegS 0,01% 2/9/2030 | 817.541 | 0,22 | EUR 200.000 | Vonovia SE RegS 0,625% 14/12/2029 | 165.744 | 0,04 |
| EUR 310.000 | Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 0,875% 15/9/2025 | 305.837 | 0,08 | EUR 100.000 | Vonovia SE RegS 2,375% 25/3/2032 | 91.810 | 0,02 |
| EUR 600.000 | Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 2,20% 9/5/2029 | 516.234 | 0,14 | EUR 700.000 | Vonovia SE RegS 1,00% 16/6/2033 | 531.986 | 0,14 |
| EUR 500.000 | Landesbank Hessen- Thueringen Girozentrale RegS 0,01% 19/7/2027 | 463.485 | 0,12 | EUR 200.000 | ZF Finance GmbH RegS 2,75% 25/5/2027 | 173.246 | 0,05 |
| EUR 200.000 | LANXESS AG RegS 0,625% 1/12/2029 | 164.558 | 0,04 | EUR 100.000 | ZF Finance GmbH RegS 3,75% 21/9/2028 | 88.281 | 0,02 |
| EUR 200.000 | Merck Financial Services GmbH RegS 0,125% 16/7/2025 | 191.558 | 0,05 | | | 31.993.573 | 8,38 |
| EUR 150.000 | Muenchener Hypothekbank eG RegS 1,25% 14/2/2030 | 145.237 | 0,04 | | Griechenland | | |
| EUR 300.000 | Norddeutsche Landesbank- Girozentrale RegS 0,01% 23/9/2026 | 282.393 | 0,07 | EUR 175.000 | Alpha Bank SA RegS 2,50% 5/2/2023 | 177.305 | 0,05 |
| EUR 640.000 | NRW Bank RegS 0,625% 2/2/2029 | 601.286 | 0,16 | | | 177.305 | 0,05 |
| EUR 371.000 | NRW Bank RegS 0,375% 16/5/2029 | 341.287 | 0,09 | | Ungarn | | |
| EUR 1.089.000 | NRW Bank RegS 0,50% 17/6/2041 | 826.344 | 0,22 | EUR 600.000 | Erste Bank Hungary Zrt RegS FRN 4/2/2026 | 570.018 | 0,15 |
| EUR 100.000 | Red & Black Auto Germany 8 UG 'B' RegS FRN 15/9/2030 | 98.693 | 0,03 | HUF 200.000.000 | Hungary Government Bond 2,00% 23/5/2029 | 367.442 | 0,10 |
| EUR 400.000 | Santander Consumer Bank AG RegS 0,25% 5/12/2024 | 390.872 | 0,10 | | | 937.460 | 0,25 |
| EUR 2.200.000 | State of Bremen 0,45% 15/3/2029 | 2.052.446 | 0,54 | | Irland | | |
| EUR 800.000 | State of Hesse 0,125% 10/10/2031 | 692.104 | 0,18 | EUR 425.000 | Abbott Ireland Financing DAC RegS 0,10% 19/11/2024 | 412.859 | 0,11 |
| EUR 1.495.000 | State of Hesse RegS 25/4/2025 (Zero Coupon) | 1.447.878 | 0,38 | GBP 499.822 | Agora Securities UK '2021-1X A' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 574.762 | 0,15 |
| EUR 380.000 | State of Lower Saxony 0,25% 9/4/2029 | 349.250 | 0,09 | EUR 875.000 | AIB Group Plc RegS FRN 4/4/2028 | 844.025 | 0,22 |
| EUR 1.553.000 | State of Lower Saxony RegS 0,125% 8/4/2027 | 1.464.541 | 0,38 | EUR 700.000 | Bank of Ireland Mortgage Bank RegS 0,625% 14/3/2025 | 687.435 | 0,18 |
| EUR 557.000 | State of Lower Saxony RegS 0,01% 16/6/2028 | 511.326 | 0,13 | EUR 277.920 | Haus European Loan Conduit No 39 DAC 'A1' RegS FRN 28/7/2051 | 269.061 | 0,07 |
| EUR 10.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 1,625% 24/10/2030 | 9.993 | 0,00 | EUR 203.941 | Haus European Loan Conduit No 39 DAC 'D' RegS FRN 28/7/2051 | 194.254 | 0,05 |
| EUR 2.111.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,60% 4/6/2041 | 1.636.363 | 0,43 | EUR 950.000 | Ireland Government Bond RegS 0,35% 18/10/2032 | 827.782 | 0,22 |
| EUR 300.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,50% 15/1/2052 | 200.850 | 0,05 | EUR 50.000 | Ireland Government Bond RegS 0,55% 22/4/2041 | 38.410 | 0,01 |
| EUR 140.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 1,95% 26/9/2078 | 126.053 | 0,03 | EUR 270.000 | Ireland Government Bond RegS 1,50% 15/5/2050 | 232.942 | 0,06 |
| EUR 1.400.000 | UniCredit Bank AG RegS 0,50% 23/2/2027 | 1.337.182 | 0,35 | EUR 268.945 | Last Mile Securities PE '2021- X1 A1' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 263.862 | 0,07 |
| EUR 425.000 | Volkswagen Financial Services AG RegS 1,50% 1/10/2024 | 422.824 | 0,11 | EUR 100.000 | Linde Plc RegS 1,00% 30/9/2051 | 61.383 | 0,01 |
| EUR 200.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 1,375% 20/1/2025 | 197.430 | 0,05 | GBP 172.133 | Taurus '2019-UK2 A' DAC RegS FRN 17/11/2029 | 200.262 | 0,05 |
| EUR 325.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 1,625% 15/8/2025* | 320.538 | 0,08 | GBP 95.629 | Taurus '2019-UK2 B' DAC RegS FRN 17/11/2029 | 111.713 | 0,03 |
| EUR 305.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,375% 20/7/2026 | 279.804 | 0,07 | GBP 95.629 | Taurus '2019-UK2 C' DAC RegS FRN 17/11/2029 | 111.867 | 0,03 |
| | | | | | | 4.830.617 | 1,26 |
| | | | | | Italien | | |
| | | | | EUR 300.000 | ACEA SpA RegS 1,50% 8/6/2027 | 289.107 | 0,08 |
| | | | | EUR 335.000 | ASTM SpA RegS 1,625% 8/2/2028 | 303.309 | 0,08 |
| | | | | EUR 350.000 | ASTM SpA RegS 2,375% 25/11/2033 | 286.527 | 0,08 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------------------|---|------------------------|--------------------|----------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Italien Fortsetzung | | | | Italien Fortsetzung | | | |
| EUR 55.228 | AutoFlorence 1 Srl 'A' RegS FRN 25/12/2042 | 55.187 | 0,01 | EUR 400.000 | Terna - Rete Elettrica Nazionale RegS 0,375% 25/9/2030^ | 332.800 | 0,09 |
| EUR 39.089 | AutoFlorence 1 Srl 'B' RegS FRN 25/12/2042 | 39.332 | 0,01 | EUR 1.000.000 | UniCredit SpA RegS FRN 16/6/2026^ | 958.560 | 0,25 |
| EUR 160.000 | Autoflorence 2 Srl 'B' RegS FRN 24/12/2044 | 158.951 | 0,04 | EUR 725.000 | UniCredit SpA RegS FRN 23/9/2029 | 688.496 | 0,18 |
| EUR 600.000 | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA RegS 0,875% 8/10/2026 | 575.730 | 0,15 | EUR 300.000 | UniCredit SpA RegS 1,625% 18/1/2032 | 250.359 | 0,07 |
| EUR 100.000 | Brignole Co '2021 B' Srl RegS FRN 24/7/2036 | 97.645 | 0,03 | | | 19.311.871 | 5,06 |
| EUR 675.000 | Credito Emiliano SpA RegS 1,125% 17/11/2024 | 675.877 | 0,18 | EUR 124.000 | Japan Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2,00% 9/7/2040 | 98.830 | 0,03 |
| EUR 375.000 | Eni SpA RegS 0,375% 14/6/2028^ | 334.939 | 0,09 | | | 98.830 | 0,03 |
| EUR 500.000 | Eni SpA RegS FRN 31/12/2099 | 441.325 | 0,12 | USD 430.000 | Jersey Aptiv Plc 4,15% 1/5/2052 | 319.893 | 0,08 |
| EUR 543.000 | Eni SpA RegS FRN 31/12/2099 | 517.083 | 0,14 | GBP 200.000 | Heathrow Funding Ltd RegS 2,75% 9/8/2049 | 176.463 | 0,05 |
| EUR 100.000 | Eni SpA RegS FRN 31/12/2099 | 88.482 | 0,02 | | | 496.356 | 0,13 |
| EUR 500.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,50% 5/3/2024 | 495.985 | 0,13 | EUR 200.000 | Litauen Lithuania Government International Bond RegS 2,125% 1/6/2032 | 195.492 | 0,05 |
| EUR 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 2,125% 26/5/2025 | 199.618 | 0,05 | | | 195.492 | 0,05 |
| EUR 250.000 | Intesa Sanpaolo Vita SpA RegS 2,375% 22/12/2030 | 206.333 | 0,05 | EUR 145.000 | Luxemburg DH Europe Finance II Sarl 1,80% 18/9/2049 | 107.261 | 0,03 |
| EUR 1.476.298 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,45% 22/5/2023 | 1.532.619 | 0,40 | EUR 240.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,20% 28/4/2025 | 234.814 | 0,06 |
| EUR 676.406 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,25% 20/11/2023 | 702.143 | 0,18 | EUR 1.501.000 | European Financial Stability Facility RegS 15/10/2025 (Zero Coupon) | 1.449.816 | 0,38 |
| EUR 2.210.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,85% 1/7/2025^ | 2.214.199 | 0,58 | EUR 110.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,75% 3/5/2027 | 107.418 | 0,03 |
| EUR 1.600.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,10% 1/4/2027 | 1.514.672 | 0,40 | EUR 873.000 | European Financial Stability Facility RegS 20/1/2031 (Zero Coupon) | 761.658 | 0,20 |
| EUR 546.700 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,30% 15/5/2028 | 587.057 | 0,15 | EUR 250.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,70% 20/1/2050 | 182.248 | 0,05 |
| EUR 1.665.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,35% 1/3/2035 | 1.686.129 | 0,44 | EUR 500.000 | European Financial Stability Facility RegS 1,75% 17/7/2053 | 469.815 | 0,12 |
| EUR 660.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,25% 1/9/2036 | 585.460 | 0,15 | EUR 350.000 | Highland Holdings Sarl 0,318% 15/12/2026 | 321.002 | 0,09 |
| EUR 125.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 5,00% 1/8/2039 | 152.188 | 0,04 | EUR 150.000 | Highland Holdings Sarl 0,934% 15/12/2031 | 125.655 | 0,03 |
| EUR 240.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,10% 1/3/2040 | 231.667 | 0,06 | EUR 450.000 | Medtronic Global Holdings SCA 0,25% 2/7/2025 | 432.792 | 0,11 |
| EUR 715.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,80% 1/3/2041 | 558.815 | 0,15 | EUR 150.000 | Medtronic Global Holdings SCA 1,50% 2/7/2039 | 119.997 | 0,03 |
| EUR 1.657.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,50% 30/4/2045 | 1.174.117 | 0,31 | EUR 100.000 | Medtronic Global Holdings SCA 1,75% 2/7/2049 | 75.354 | 0,02 |
| EUR 29.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,25% 1/9/2046 | 28.528 | 0,01 | EUR 249.000 | Nestle Finance International Ltd RegS 0,375% 3/12/2040 | 166.188 | 0,04 |
| EUR 125.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,15% 1/9/2052 | 94.034 | 0,02 | EUR 325.000 | P3 Group Sarl RegS 1,625% 26/1/2029 | 260.049 | 0,07 |
| EUR 65.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,80% 1/3/2067 | 54.945 | 0,01 | EUR 150.765 | SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 D' RegS FRN 14/11/2034 | 148.910 | 0,04 |
| EUR 500.000 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA RegS 1,125% 15/7/2025 | 482.310 | 0,13 | EUR 125.000 | Segro Capital Sarl RegS 1,875% 23/3/2030 | 116.036 | 0,03 |
| EUR 350.000 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA RegS 0,50% 1/10/2026^ | 335.170 | 0,09 | EUR 350.000 | SES SA RegS FRN 31/12/2099 | 315.689 | 0,08 |
| EUR 118.825 | Progetto Quinto Srl 'A' RegS FRN 27/10/2036 | 117.987 | 0,03 | | | | |
| EUR 100.000 | Snam SpA RegS 0,75% 17/6/2030 | 85.590 | 0,02 | | | | |
| EUR 211.000 | Snam SpA RegS 1,00% 12/9/2034 | 163.677 | 0,04 | | | | |
| EUR 14.916 | Sunrise SPV Z70 Srl '2019-1 A' RegS FRN 27/5/2044 | 14.919 | 0,00 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|------------------------------|--|------------------------|--------------------|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Luxemburg Fortsetzung | | | | Niederlande Fortsetzung | | | |
| EUR 100.000 | Silver Arrow SA Compartment 10 'D' RegS FRN 15/3/2027 | 99.397 | 0,03 | EUR 400.000 | Netherlands Government Bond RegS 15/1/2027 (Zero Coupon) | 382.376 | 0,10 |
| EUR 600.000 | Traton Finance Luxembourg SA RegS 1,25% 24/3/2033 | 469.164 | 0,12 | EUR 210.000 | Netherlands Government Bond RegS 0,25% 15/7/2029 | 196.516 | 0,05 |
| | | 5.963.263 | 1,56 | EUR 930.000 | Netherlands Government Bond RegS 15/7/2030 (Zero Coupon) | 840.432 | 0,22 |
| Montenegro | | | | EUR 250.000 | Netherlands Government Bond RegS 15/1/2038 (Zero Coupon) | 193.458 | 0,05 |
| EUR 500.000 | Montenegro Government International Bond RegS 2,875% 16/12/2027 | 411.172 | 0,11 | EUR 125.000 | Netherlands Government Bond RegS 0,50% 15/1/2040 | 103.638 | 0,03 |
| EUR 100.000 | Montenegro Government International Bond RegS 2,55% 3/10/2029 | 73.879 | 0,02 | EUR 834.768 | Netherlands Government Bond RegS 2,75% 15/1/2047 | 1.035.313 | 0,27 |
| | | 485.051 | 0,13 | EUR 600.000 | NN Group NV RegS FRN 8/4/2044 | 620.124 | 0,16 |
| Niederlande | | | | EUR 450.000 | Repsol International Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 437.157 | 0,11 |
| EUR 200.000 | Achmea Bank NV RegS 0,01% 16/6/2025 | 192.210 | 0,05 | EUR 300.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 300.900 | 0,08 |
| EUR 250.000 | Adecco International Financial Services BV RegS 0,125% 21/9/2028 | 213.485 | 0,06 | EUR 525.000 | TenneT Holding BV RegS 0,50% 9/6/2031 | 444.465 | 0,12 |
| EUR 300.000 | Aegon Bank NV RegS 0,01% 16/11/2025 | 285.918 | 0,07 | EUR 1.000.000 | TenneT Holding BV RegS 0,875% 16/6/2035 | 788.280 | 0,21 |
| EUR 447.000 | BNG Bank NV RegS 0,75% 11/1/2028 | 430.832 | 0,11 | EUR 425.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3,75% 9/5/2027 | 389.971 | 0,10 |
| EUR 339.000 | BNG Bank NV RegS 0,125% 19/4/2033 | 282.397 | 0,07 | EUR 550.000 | Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1,625% 18/10/2041 | 428.708 | 0,11 |
| EUR 825.000 | BP Capital Markets BV RegS 1,467% 21/9/2041 | 604.222 | 0,16 | EUR 300.000 | Volkswagen International Finance NV RegS FRN 31/12/2099 | 297.396 | 0,08 |
| EUR 425.000 | Coloplast Finance BV RegS 2,25% 19/5/2027 | 424.052 | 0,11 | EUR 100.000 | Vonovia Finance BV RegS 2,25% 7/4/2030 | 93.117 | 0,02 |
| EUR 300.000 | de Volksbank NV RegS 0,01% 16/9/2024 | 291.216 | 0,08 | EUR 100.000 | Vonovia Finance BV RegS 1,00% 28/1/2041 | 62.159 | 0,02 |
| EUR 239.720 | Dutch Property Finance '2020-2 A' BV RegS FRN 28/1/2058 | 238.648 | 0,06 | EUR 200.000 | Wintershall Dea Finance 2 BV RegS FRN 31/12/2099 | 160.744 | 0,04 |
| EUR 702.000 | ELM BV for Firmenich International SA RegS FRN 31/12/2099 | 700.357 | 0,18 | | | 17.548.517 | 4,59 |
| EUR 225.000 | Enel Finance International NV RegS 28/5/2026 (Zero Coupon) | 206.741 | 0,05 | Neuseeland | | | |
| EUR 1.100.000 | Enel Finance International NV RegS 17/6/2027 (Zero Coupon)^ | 984.830 | 0,26 | EUR 425.000 | ANZ New Zealand International Ltd RegS 0,50% 17/1/2024 | 421.991 | 0,11 |
| EUR 600.000 | Enel Finance International NV RegS 0,875% 28/9/2034^ | 457.248 | 0,12 | EUR 300.000 | ASB Finance Ltd RegS 0,625% 18/10/2024 | 295.749 | 0,08 |
| EUR 100.000 | Heineken NV RegS 2,25% 30/3/2030 | 98.694 | 0,03 | EUR 432.000 | ASB Finance Ltd RegS 0,25% 21/5/2031 | 371.473 | 0,10 |
| EUR 180.000 | Heineken NV RegS 1,75% 7/5/2040 | 143.444 | 0,04 | EUR 320.000 | Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023 | 319.488 | 0,08 |
| EUR 1.200.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 1.113.204 | 0,29 | NZD 596.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,00% 20/9/2025 | 446.753 | 0,12 |
| EUR 500.000 | ING Bank NV RegS 0,50% 17/2/2027^ | 478.130 | 0,13 | NZD 127.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 3,00% 20/9/2030 | 100.596 | 0,02 |
| EUR 600.000 | ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025 | 574.890 | 0,15 | NZD 499.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,50% 20/9/2040 | 377.459 | 0,10 |
| EUR 400.000 | ING Groep NV RegS FRN 18/2/2029 | 346.548 | 0,09 | | | 2.333.509 | 0,61 |
| EUR 600.000 | ING Groep NV RegS FRN 16/2/2031 | 548.844 | 0,14 | Norwegen | | | |
| EUR 700.000 | ING Groep NV RegS FRN 26/5/2031 | 669.480 | 0,18 | EUR 575.000 | DNB Bank ASA RegS 0,05% 14/11/2023 | 567.698 | 0,15 |
| EUR 114.923 | Jubilee Place '2020-1 A' BV RegS FRN 17/10/2057 | 114.532 | 0,03 | EUR 1.000.000 | DNB Bank ASA RegS FRN 31/5/2026 | 993.470 | 0,26 |
| EUR 108.000 | Jubilee Place 'B' RegS FRN 17/1/2059 | 105.878 | 0,03 | EUR 200.000 | DNB Boligkreditt AS RegS 0,625% 14/1/2026 | 194.716 | 0,05 |
| EUR 100.000 | Koninklijke Philips NV RegS 2,00% 30/3/2030 | 95.911 | 0,02 | EUR 225.000 | Eika Boligkreditt AS RegS 0,50% 28/8/2025 | 219.071 | 0,06 |
| EUR 300.000 | Nationale-Nederlanden Bank NV RegS 0,50% 10/10/2024 | 295.332 | 0,08 | | | | |
| EUR 1.000.000 | Naturgy Finance BV RegS FRN 31/12/2099^ | 876.720 | 0,23 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-----------------------------|---|------------------------|--------------------|------------------|---|------------------------|--------------------|
| Norwegen Fortsetzung | | | | Slowakei | | | |
| NOK 2.833.000 | Norway Government Bond RegS 1,75% 13/3/2025 | 275.022 | 0,07 | EUR 250.000 | Slovakia Government Bond RegS 1,00% 14/5/2032 | 228.332 | 0,06 |
| NOK 3.300.000 | Norway Government Bond RegS 1,75% 6/9/2029 | 306.761 | 0,08 | EUR 110.000 | Slovakia Government Bond RegS 2,00% 17/10/2047 | 98.426 | 0,02 |
| EUR 500.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,50% 30/1/2025 | 490.430 | 0,13 | EUR 300.000 | Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,25% 26/3/2024 | 295.761 | 0,08 |
| EUR 300.000 | Telenor ASA RegS 25/9/2023 (Zero Coupon) | 296.730 | 0,08 | EUR 400.000 | Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,01% 23/6/2025 | 382.966 | 0,10 |
| | | 3.343.898 | 0,88 | | | 1.005.485 | 0,26 |
| Polen | | | | Slowenien | | | |
| PLN 4.000.000 | Republic of Poland Government Bond 1,25% 25/10/2030 | 583.649 | 0,15 | EUR 300.000 | Slovenia Government Bond RegS 0,275% 14/1/2030 | 265.603 | 0,07 |
| EUR 300.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 10/2/2025 (Zero Coupon) | 287.306 | 0,08 | | | 265.603 | 0,07 |
| EUR 171.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 1,00% 25/10/2028^ | 159.971 | 0,04 | Spanien | | | |
| EUR 550.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 2,75% 25/5/2032 | 550.516 | 0,14 | EUR 400.000 | Abanca Corp Bancaria SA RegS 0,75% 28/5/2029 | 372.180 | 0,10 |
| | | 1.581.442 | 0,41 | EUR 500.000 | Adif Alta Velocidad RegS 1,25% 4/5/2026 | 496.085 | 0,13 |
| Portugal | | | | EUR 200.000 | Autonoria Spain 2021 FT 'B' RegS FRN 31/1/2039 | 196.438 | 0,05 |
| EUR 200.000 | Banco Santander Totta SA RegS 1,25% 26/9/2027 | 196.714 | 0,05 | EUR 1.100.000 | Banco de Sabadell SA RegS 0,875% 22/7/2025^ | 1.046.540 | 0,27 |
| EUR 200.000 | EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 14/3/2082 | 156.870 | 0,04 | EUR 200.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 24/3/2026 | 195.232 | 0,05 |
| EUR 408.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,125% 14/4/2027 | 459.971 | 0,12 | EUR 300.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 11/3/2027 | 283.779 | 0,07 |
| EUR 144.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 1,15% 11/4/2042 | 110.500 | 0,03 | EUR 400.000 | Banco de Sabadell SA RegS 0,125% 10/2/2028 | 365.672 | 0,10 |
| EUR 21.900 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,10% 15/2/2045 | 26.898 | 0,01 | EUR 200.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 16/6/2028 | 172.502 | 0,05 |
| EUR 40.161 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 1,00% 12/4/2052 | 24.947 | 0,01 | EUR 400.000 | Banco de Sabadell SA RegS 2,50% 15/4/2031 | 356.076 | 0,09 |
| EUR 100.000 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance No 1 'B' RegS FRN 28/10/2040 | 98.698 | 0,03 | EUR 100.000 | Banco Santander SA RegS 1,00% 7/4/2025 | 99.144 | 0,03 |
| EUR 19.056 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta VI RegS 1,10% 3/2/2023 | 19.092 | 0,00 | EUR 400.000 | Banco Santander SA RegS 0,875% 9/5/2031 | 364.736 | 0,10 |
| EUR 115.705 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta VII RegS 0,70% 12/2/2024 | 114.809 | 0,03 | EUR 400.000 | Banco Santander SA RegS FRN 31/12/2099 | 320.348 | 0,08 |
| | | 1.208.499 | 0,32 | EUR 273.539 | BBVA Consumer Auto '2020-1 A' FTA RegS FRN 20/1/2036 | 274.356 | 0,07 |
| Rumänien | | | | EUR 500.000 | CaixaBank SA RegS 0,375% 3/2/2025 | 481.400 | 0,13 |
| EUR 1.000.000 | Romanian Government International Bond RegS 2,125% 7/3/2028 | 883.125 | 0,23 | GBP 400.000 | CaixaBank SA RegS FRN 6/4/2028 | 459.129 | 0,12 |
| EUR 123.000 | Romanian Government International Bond RegS 3,624% 26/5/2030 | 112.165 | 0,03 | EUR 400.000 | Caja Rural de Navarra SCC RegS 0,625% 1/12/2023 | 398.088 | 0,10 |
| | | 995.290 | 0,26 | EUR 200.000 | Caja Rural de Navarra SCC RegS 0,875% 8/5/2025 | 196.916 | 0,05 |
| Singapur | | | | EUR 100.000 | Cellnex Finance Co SA RegS 1,50% 8/6/2028 | 84.259 | 0,02 |
| EUR 1.375.000 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd RegS 0,625% 18/4/2025 | 1.346.448 | 0,35 | EUR 100.000 | Cellnex Finance Co SA RegS 2,00% 15/2/2033 | 74.586 | 0,02 |
| | | 1.346.448 | 0,35 | EUR 100.000 | Cellnex Telecom SA RegS 1,75% 23/10/2030 | 79.009 | 0,02 |
| | | | | EUR 200.000 | Ibercaja Banco SA RegS 0,25% 18/10/2023 | 198.434 | 0,05 |
| | | | | EUR 400.000 | Santander Consumer Finance SA RegS 0,375% 27/6/2024^ | 391.052 | 0,10 |
| | | | | EUR 1.336.000 | Spain Government Bond RegS 0,25% 30/7/2024 | 1.319.541 | 0,35 |
| | | | | EUR 1.722.000 | Spain Government Bond RegS 2,75% 31/10/2024 | 1.800.110 | 0,47 |
| | | | | EUR 865.000 | Spain Government Bond RegS 1,60% 30/4/2025 | 878.113 | 0,23 |
| | | | | EUR 721.000 | Spain Government Bond RegS 1,95% 30/4/2026 | 738.585 | 0,19 |
| | | | | EUR 1.117.000 | Spain Government Bond RegS 1,45% 30/4/2029 | 1.095.420 | 0,29 |
| | | | | EUR 530.000 | Spain Government Bond RegS 0,60% 31/10/2029 | 485.740 | 0,13 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|-----------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Spanien Fortsetzung | | | | Schweden Fortsetzung | | | |
| EUR 605.000 | Spain Government Bond RegS 0,50% 30/4/2030 | 544.022 | 0,14 | EUR 350.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 1,375% 23/2/2029 | 325.584 | 0,09 |
| EUR 1.480.000 | Spain Government Bond RegS 2,35% 30/7/2033 | 1.487.444 | 0,39 | EUR 625.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS FRN 1/6/2033 | 623.731 | 0,16 |
| EUR 170.000 | Spain Government Bond RegS 0,85% 30/7/2037 | 133.190 | 0,04 | SEK 2.000.000 | Sveriges Sakerstallda Obligationer AB RegS 1,00% 21/6/2023 | 189.438 | 0,05 |
| EUR 745.000 | Spain Government Bond RegS 1,20% 31/10/2040 | 586.583 | 0,15 | EUR 287.000 | Swedbank AB RegS 0,25% 2/11/2026 | 265.644 | 0,07 |
| EUR 239.000 | Spain Government Bond RegS 1,00% 30/7/2042 | 177.838 | 0,05 | EUR 650.000 | Swedbank AB RegS 1,30% 17/2/2027 | 615.101 | 0,16 |
| EUR 57.000 | Spain Government Bond RegS 5,15% 31/10/2044 | 81.019 | 0,02 | EUR 200.000 | Swedbank AB RegS FRN 20/5/2027 | 184.288 | 0,05 |
| EUR 582.000 | Spain Government Bond RegS 2,70% 31/10/2048 | 574.248 | 0,15 | SEK 2.375.000 | Sweden Government Bond 3,50% 30/3/2039 | 286.544 | 0,07 |
| EUR 60.000 | Spain Government Bond RegS 1,00% 31/10/2050 | 38.840 | 0,01 | EUR 143.000 | Volvo Car AB RegS 2,00% 24/1/2025 | 138.574 | 0,04 |
| EUR 763.000 | Spain Government Bond RegS 1,90% 31/10/2052 | 603.617 | 0,16 | | | 7.347.173 | 1,92 |
| EUR 114.000 | Spain Government Bond RegS 3,45% 30/7/2066 | 122.659 | 0,03 | Schweiz | | | |
| | | 17.572.930 | 4,60 | EUR 225.000 | Credit Suisse AG RegS 0,25% 5/1/2026 | 207.059 | 0,05 |
| Supranationale Anleihen | | | | EUR 220.000 | Credit Suisse AG RegS 0,25% 1/9/2028 | 184.298 | 0,05 |
| EUR 500.000 | African Development Bank 0,50% 21/3/2029 | 466.824 | 0,12 | EUR 1.350.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028 [^] | 1.187.163 | 0,31 |
| EUR 59.000 | European Investment Bank 0,10% 15/10/2026 | 56.350 | 0,01 | EUR 400.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2032 | 368.292 | 0,10 |
| EUR 1.274.000 | European Investment Bank 17/6/2027 (Zero Coupon) | 1.197.318 | 0,31 | CHF 999.000 | Swiss Confederation Government Bond RegS 4,00% 8/4/2028 | 1.166.914 | 0,30 |
| EUR 44.000 | European Investment Bank 2,625% 15/3/2035 | 47.475 | 0,01 | CHF 1.050.000 | Swiss Confederation Government Bond RegS 0,50% 27/6/2032 | 985.690 | 0,26 |
| EUR 430.000 | European Investment Bank 0,20% 17/3/2036 | 339.352 | 0,09 | CHF 721.000 | Swiss Confederation Government Bond RegS 1,50% 30/4/2042 | 764.508 | 0,20 |
| EUR 128.000 | European Investment Bank RegS 0,375% 15/5/2026 | 124.365 | 0,03 | EUR 600.000 | UBS Group AG RegS FRN 29/1/2026 | 570.888 | 0,15 |
| EUR 99.000 | European Investment Bank RegS 0,875% 14/1/2028 | 96.867 | 0,03 | EUR 700.000 | UBS Group AG RegS FRN 3/11/2026 | 653.156 | 0,17 |
| EUR 1.117.000 | European Investment Bank RegS 1,50% 15/6/2032 | 1.097.843 | 0,29 | EUR 300.000 | UBS Group AG RegS FRN 5/11/2028 | 264.240 | 0,07 |
| GBP 21.000 | European Investment Bank RegS 3,875% 8/6/2037 | 28.412 | 0,01 | | | 6.352.208 | 1,66 |
| EUR 1.223.000 | European Investment Bank RegS 0,25% 15/6/2040 [^] | 904.812 | 0,24 | Großbritannien | | | |
| EUR 390.336 | European Stability Mechanism RegS 0,75% 15/3/2027 | 381.229 | 0,10 | GBP 675.000 | Barclays Plc RegS FRN 6/10/2023 | 792.113 | 0,21 |
| EUR 282.000 | European Union RegS 4/7/2035 (Zero Coupon) | 219.624 | 0,06 | EUR 219.000 | BAT International Finance Plc RegS 2,25% 16/1/2030 | 190.427 | 0,05 |
| EUR 100.000 | European Union RegS 0,70% 6/7/2051 | 70.672 | 0,02 | GBP 150.000 | Bellis Acquisition Co Plc RegS 3,25% 16/2/2026 | 149.707 | 0,04 |
| EUR 106.000 | International Bank for Reconstruction & Development 0,20% 21/1/2061 | 55.730 | 0,01 | EUR 100.000 | BP Capital Markets Plc RegS 1,573% 16/2/2027 | 97.696 | 0,03 |
| | | 5.086.873 | 1,33 | EUR 375.000 | BP Capital Markets Plc RegS 1,231% 8/5/2031 | 333.851 | 0,09 |
| Schweden | | | | EUR 375.000 | BP Capital Markets Plc RegS 1,104% 15/11/2034 | 298.796 | 0,08 |
| SEK 4.700.000 | Kommuninvest I Sverige AB RegS 1,00% 12/5/2025 | 430.831 | 0,11 | EUR 450.000 | BP Capital Markets Plc RegS FRN 31/12/2099 | 438.260 | 0,11 |
| SEK 6.000.000 | Landshypotek Bank AB RegS 0,75% 25/5/2023 | 566.443 | 0,15 | EUR 767.000 | BP Capital Markets Plc RegS FRN 31/12/2099 [^] | 716.370 | 0,19 |
| EUR 225.000 | Lansforsakringar Hypotek AB RegS 0,625% 29/1/2026 | 218.698 | 0,06 | EUR 700.000 | British American Tobacco Plc RegS FRN 31/12/2099 | 588.882 | 0,15 |
| SEK 5.000.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 1,50% 21/12/2022 | 477.093 | 0,12 | EUR 350.000 | British Telecommunications Plc RegS 1,00% 21/11/2024 | 344.477 | 0,09 |
| EUR 950.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 0,05% 1/7/2024 | 925.262 | 0,24 | EUR 750.000 | Cadent Finance Plc RegS 0,625% 19/3/2030 | 630.263 | 0,16 |
| SEK 15.000.000 | Stadshypotek AB RegS 1,50% 1/6/2023 | 1.428.798 | 0,37 | GBP 400.000 | Cadent Finance Plc RegS 2,75% 22/9/2046 | 362.305 | 0,09 |
| SEK 6.000.000 | Stadshypotek AB RegS 0,50% 1/6/2026 | 524.516 | 0,14 | EUR 150.000 | Chanel Ceres Plc RegS 1,00% 31/7/2031 | 128.243 | 0,03 |
| EUR 150.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 0,125% 18/6/2024 | 146.628 | 0,04 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-------------|--|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | |
| EUR 200.000 | Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050 | 192.392 | 0,05 | GBP 93.191 | RMAC NO 2 Plc '2018-2 A' RegS FRN 12/6/2046 | 109.494 | 0,03 |
| GBP 100.000 | Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050 | 109.731 | 0,03 | EUR 1.200.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 13/9/2029 | 1.032.696 | 0,27 |
| GBP 94.115 | CMF '2020-1 A' Plc RegS FRN 16/1/2057 | 109.980 | 0,03 | EUR 250.000 | Santander UK Plc 0,10% 12/5/2024 | 245.500 | 0,06 |
| GBP 220.000 | CMF '2020-1 B' Plc RegS FRN 16/1/2057 | 254.677 | 0,07 | GBP 84.901 | Silk Road Finance Number Six Plc '2019-2 A' RegS FRN 21/9/2067 | 99.911 | 0,03 |
| GBP 100.000 | CMF '2020-1 C' Plc RegS FRN 16/1/2057 | 115.572 | 0,03 | GBP 288.000 | Silverstone Master Issuer Plc '2020-1X 1A' RegS FRN 21/1/2070 | 338.178 | 0,09 |
| GBP 89.967 | Finsbury Square '2020-1X A' Plc RegS FRN 16/3/2070 | 105.327 | 0,03 | GBP 200.000 | SSE Plc RegS FRN 16/9/2077 | 234.869 | 0,06 |
| GBP 99.981 | Finsbury Square '2020-1X C' Plc RegS FRN 16/3/2070 | 116.455 | 0,03 | EUR 425.000 | SSE Plc RegS FRN 31/12/2099 | 411.302 | 0,11 |
| GBP 76.091 | Finsbury Square '2020-2X A' Plc RegS FRN 16/6/2070 | 89.490 | 0,02 | GBP 46.527 | Tesco Property Finance 3 Plc RegS 5,744% 13/4/2040 | 60.808 | 0,02 |
| GBP 116.493 | Gemgarto '2018-1 A' Plc RegS FRN 16/9/2065 | 136.981 | 0,04 | GBP 100.000 | Together Asset Backed Securitisation '2021-1ST1 B' Plc RegS FRN 12/7/2063 | 113.445 | 0,03 |
| GBP 99.977 | Gemgarto '2018-1 B' Plc RegS FRN 16/9/2065 | 117.100 | 0,03 | GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2020-1 C' Plc RegS FRN 20/9/2063 | 117.905 | 0,03 |
| GBP 216.125 | Gemgarto '2021-1X A' Plc RegS FRN 16/12/2067 | 252.715 | 0,07 | GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 113.809 | 0,03 |
| EUR 178.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,375% 2/12/2024 | 178.630 | 0,05 | GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2022-1X B' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 113.598 | 0,03 |
| EUR 200.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,25% 21/5/2026 | 197.032 | 0,05 | GBP 100.000 | Twin Bridges '2018-1 B' Plc RegS FRN 12/9/2050 | 116.630 | 0,03 |
| GBP 99.994 | Hops Hill No 1 Plc 'B' RegS FRN 27/5/2054 | 116.729 | 0,03 | GBP 100.000 | Twin Bridges '2018-1 D' Plc RegS FRN 12/9/2050 | 116.107 | 0,03 |
| EUR 300.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 24/9/2029 | 258.942 | 0,07 | GBP 79.282 | Twin Bridges '2019-1 A' Plc RegS FRN 12/12/2052 | 93.217 | 0,02 |
| EUR 200.000 | Investec Bank Plc RegS FRN 17/2/2027 | 183.806 | 0,05 | GBP 225.000 | Twin Bridges '2020-1 C' Plc RegS FRN 12/12/2054 | 260.791 | 0,07 |
| GBP 170.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2020-1 B' Plc RegS FRN 12/6/2057 | 200.426 | 0,05 | GBP 136.000 | Twin Bridges '2021-2 B' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 151.605 | 0,04 |
| GBP 100.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2021-1 B' Plc Regs FRN 20/7/2058 | 113.745 | 0,03 | GBP 263.000 | Twin Bridges '2022-1 B' Plc RegS FRN 11/2/2055 | 295.316 | 0,08 |
| GBP 142.000 | LCR Finance Plc RegS 4,50% 7/12/2028 | 190.502 | 0,05 | GBP 3.715.000 | United Kingdom Gilt RegS 0,125% 30/1/2026^ | 4.138.474 | 1,08 |
| GBP 230.000 | Lloyds Bank Plc RegS 7,50% 15/4/2024 | 292.920 | 0,08 | GBP 860.000 | United Kingdom Gilt RegS 0,375% 22/10/2026 | 954.146 | 0,25 |
| GBP 139.221 | London Wall Mortgage Capital Plc '2021-FL1 A' RegS FRN 15/5/2051 | 161.536 | 0,04 | GBP 932.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,25% 7/9/2039 | 1.384.828 | 0,36 |
| GBP 100.000 | Marks & Spencer Plc RegS 4,50% 10/7/2027 | 107.892 | 0,03 | GBP 470.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,25% 7/12/2040 | 704.618 | 0,18 |
| EUR 350.000 | National Grid Plc RegS 2,949% 30/3/2030 | 349.073 | 0,09 | GBP 1.780.000 | United Kingdom Gilt RegS 1,25% 22/10/2041 | 1.719.399 | 0,45 |
| EUR 245.000 | Nationwide Building Society RegS 0,25% 14/9/2028 | 213.096 | 0,06 | GBP 270.701 | United Kingdom Gilt RegS 3,25% 22/1/2044 | 362.297 | 0,09 |
| EUR 300.000 | NatWest Markets Plc RegS 0,125% 12/11/2025 | 279.696 | 0,07 | GBP 1.616.662 | United Kingdom Gilt RegS 3,50% 22/1/2045 | 2.254.004 | 0,59 |
| GBP 156.000 | Newday Funding Master Issuer Plc '2021-1X A1' RegS FRN 15/3/2029 | 182.138 | 0,05 | GBP 465.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,25% 7/12/2046 | 731.937 | 0,19 |
| EUR 143.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 5/9/2082 | 125.425 | 0,03 | GBP 935.000 | United Kingdom Gilt RegS 0,625% 22/10/2050^ | 709.386 | 0,19 |
| GBP 342.262 | Oat Hill NO 2 Plc 'A' RegS FRN 27/5/2046 | 401.847 | 0,10 | GBP 1.305.000 | United Kingdom Gilt RegS 1,50% 31/7/2053 | 1.252.258 | 0,33 |
| EUR 33.540 | Paragon Mortgages No 12 Plc 'B1B' RegS 15/11/2038 (Zero Coupon) | 31.964 | 0,01 | GBP 277.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,25% 7/12/2055 | 471.535 | 0,12 |
| GBP 66.959 | Paragon Mortgages No 25 Plc 'A' RegS FRN 15/5/2050 | 78.448 | 0,02 | GBP 290.000 | United Kingdom Gilt RegS 1,75% 22/7/2057 | 295.960 | 0,08 |
| GBP 185.000 | PCL Funding V Plc '2021-1 A' RegS FRN 15/10/2025 | 216.663 | 0,06 | GBP 556.620 | United Kingdom Gilt RegS 4,00% 22/1/2060 | 940.962 | 0,25 |
| GBP 205.000 | Residential Mortgage Securities 32 Plc 'C' RegS FRN 20/6/2070 | 238.922 | 0,06 | GBP 230.000 | United Kingdom Gilt RegS 0,50% 22/10/2061 | 148.802 | 0,04 |
| | | | | GBP 300.000 | United Kingdom Gilt RegS 2,50% 22/7/2065 | 380.064 | 0,10 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| GBP 500.000 | United Kingdom Gilt RegS 1,125% 22/10/2073 | 404.464 | 0,11 | USD 67.103 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/2/2052 | 53.450 | 0,01 |
| GBP 200.000 | WPP Finance 2013 RegS 2,875% 14/9/2046 | 172.097 | 0,04 | EUR 115.000 | US Bancorp 0,85% 7/6/2024 | 113.523 | 0,03 |
| | | 31.841.654 | 8,34 | EUR 162.000 | Verizon Communications Inc 0,875% 19/3/2032 | 138.016 | 0,04 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | 13.150.048 | 3,44 |
| EUR 675.000 | Air Products and Chemicals Inc 0,80% 5/5/2032 | 570.847 | 0,15 | Gesamt Anleihen | | 253.210.153 | 66,30 |
| USD 360.000 | American Tower Corp 4,05% 15/3/2032 | 316.620 | 0,08 | BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | |
| EUR 360.000 | American Tower Corp 1,25% 21/5/2033 | 284.479 | 0,07 | Irland | | | |
| EUR 113.000 | AT&T Inc 3,15% 4/9/2036 | 111.545 | 0,03 | USD 5.000 | iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ⁻ | 212.555 | 0,06 |
| EUR 150.000 | AT&T Inc 2,60% 19/5/2038 | 137.318 | 0,04 | | | 212.555 | 0,06 |
| EUR 300.000 | Bank of America Corp RegS FRN 27/4/2033 | 296.789 | 0,08 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | 212.555 | 0,06 |
| GBP 450.000 | BAT Capital Corp RegS 2,125% 15/8/2025 | 501.391 | 0,13 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 366.651.198 | 96,01 |
| EUR 300.000 | Booking Holdings Inc 0,10% 8/3/2025 | 286.797 | 0,08 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| USD 1.200.000 | Citigroup Inc FRN 17/3/2033 | 1.050.440 | 0,28 | Irland | | | |
| EUR 200.000 | Coca-Cola Co 0,95% 6/5/2036 | 160.584 | 0,04 | 67.311 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc) ⁻ | 6.612.980 | 1,73 |
| EUR 252.000 | Coca-Cola Co 1,10% 2/9/2036 | 205.052 | 0,05 | | | 6.612.980 | 1,73 |
| EUR 1.025.000 | Eli Lilly & Co 1,375% 14/9/2061 | 640.789 | 0,17 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 6.612.980 | 1,73 |
| EUR 295.000 | Fidelity National Information Services Inc 0,75% 21/5/2023 | 294.764 | 0,08 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 373.264.178 | 97,74 |
| EUR 425.000 | Fidelity National Information Services Inc 0,625% 3/12/2025 | 403.525 | 0,11 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 8.647.211 | 2,26 |
| EUR 125.000 | Fiserv Inc 1,125% 1/7/2027 | 116.956 | 0,03 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 381.911.389 | 100,00 |
| EUR 200.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 1,625% 27/7/2026 | 194.486 | 0,05 | ^ Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |
| EUR 800.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 2,00% 1/11/2028 | 767.840 | 0,20 | - Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9. | | | |
| EUR 1.400.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 0,875% 9/5/2029 | 1.231.272 | 0,32 | | | | |
| EUR 475.000 | International Business Machines Corp 1,25% 29/1/2027 | 461.334 | 0,12 | | | | |
| EUR 325.000 | International Flavors & Fragrances Inc 1,80% 25/9/2026 | 317.948 | 0,08 | | | | |
| USD 80.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 26/4/2033 | 76.145 | 0,02 | | | | |
| EUR 200.000 | JPMorgan Chase & Co RegS 0,625% 25/1/2024 | 198.634 | 0,05 | | | | |
| EUR 325.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 11/3/2027 | 311.935 | 0,08 | | | | |
| EUR 700.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 23/3/2030 | 672.953 | 0,18 | | | | |
| EUR 350.000 | Levi Strauss & Co 3,375% 15/3/2027 | 336.207 | 0,09 | | | | |
| EUR 750.000 | Morgan Stanley FRN 26/7/2024 | 745.942 | 0,20 | | | | |
| EUR 100.000 | Morgan Stanley FRN 26/10/2029 | 87.646 | 0,02 | | | | |
| EUR 325.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 0,993% 15/10/2026 | 279.253 | 0,07 | | | | |
| EUR 625.000 | National Grid North America Inc RegS 0,75% 8/8/2023 | 622.881 | 0,16 | | | | |
| EUR 100.000 | Netflix Inc 4,625% 15/5/2029 | 101.253 | 0,03 | | | | |
| EUR 100.000 | Netflix Inc RegS 3,625% 15/6/2030 | 94.814 | 0,02 | | | | |
| USD 300.000 | Oracle Corp 2,875% 25/3/2031 | 237.342 | 0,06 | | | | |
| USD 725.000 | Oracle Corp 3,60% 1/4/2050 | 488.830 | 0,13 | | | | |
| EUR 250.000 | Thermo Fisher Scientific Inc 0,125% 1/3/2025 | 240.448 | 0,06 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Netto(-verlust) EUR |
|--|---|----------------------------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | |
| Italien | | | |
| (24.568) | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | Bank of America Merrill Lynch | 9.483 |
| | | | 9.483 |
| Norwegen | | | |
| (26.704) | DNB Bank ASA | Bank of America Merrill Lynch | (15.668) |
| | | | (15.668) |
| Spanien | | | |
| (129.960) | Bankinter SA | Bank of America Merrill Lynch | (81.615) |
| | | | (81.615) |
| Schweden | | | |
| (24.136) | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.836 |
| (78.310) | Svenska Handelsbanken AB 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 5.005 |
| (49.595) | Swedbank AB 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 16.970 |
| | | | 23.811 |
| Schweiz | | | |
| (188.651) | Credit Suisse Group AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (35.504) |
| | | | (35.504) |
| Großbritannien | | | |
| (282.511) | NatWest Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (59.096) |
| | | | (59.096) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 5.177.118) | | | (158.589) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | USD 1.300.000 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.38 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 38.527 | (16.447) |
| CCCDs | EUR 4.546.429 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (15.214) | 26.621 |
| CCCDs | EUR 1.387.840 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (25.791) | 34.295 |
| CCILs | EUR 550.000 | Fund receives Fixed 0,682% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2028 | (114.035) | (114.023) |
| CCILs | EUR 239.318 | Fund receives Fixed 2,452% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2038 | (5.065) | (5.057) |
| CCILs | EUR 564.000 | Fund receives Fixed 2,481% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2037 | (9.916) | (9.901) |
| CCILs | GBP 217.000 | Fund receives Fixed 3,334% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2030 | (46.733) | (46.733) |
| CCILs | GBP 83.000 | Fund receives Fixed 3,456% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2030 | (18.521) | (18.519) |
| CCILs | GBP 699.000 | Fund receives Fixed 3,500% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2030 | (146.966) | (146.948) |
| CCILs | GBP 273.000 | Fund receives Fixed 3,640% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2030 | (55.683) | (55.677) |
| CCILs | GBP 917.656 | Fund receives Fixed 3,650% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2031 | (175.069) | (175.047) |
| CCILs | GBP 208.000 | Fund receives Fixed 3,700% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2031 | (41.122) | (41.777) |
| CCILs | GBP 420.000 | Fund receives Fixed 3,718% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (78.692) | (78.681) |
| CCILs | GBP 115.000 | Fund receives Fixed 3,721% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (21.492) | (21.489) |
| CCILs | GBP 411.000 | Fund receives Fixed 3,776% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2028 | (53.718) | (53.581) |
| CCILs | GBP 170.000 | Fund receives Fixed 3,805% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (29.842) | (29.837) |
| CCILs | GBP 301.000 | Fund receives Fixed 3,810% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (52.633) | (52.625) |
| CCILs | GBP 191.000 | Fund receives Fixed 3,850% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (32.360) | (32.355) |
| CCILs | GBP 140.000 | Fund receives Fixed 3,850% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (23.719) | (23.716) |
| CCILs | GBP 120.000 | Fund receives Fixed 3,880% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2031 | (18.916) | (18.913) |
| CCILs | GBP 12.500 | Fund receives Fixed 4,070% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2031 | (1.558) | (1.558) |
| CCILs | GBP 7.500 | Fund receives Fixed 4,130% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2031 | (873) | (872) |
| CCILs | GBP 750.000 | Fund receives Fixed 4,185% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2026 | (81.105) | (81.092) |
| CCILs | GBP 136.000 | Fund receives Fixed 4,193% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2032 | (10.861) | (10.857) |
| CCILs | GBP 134.000 | Fund receives Fixed 4,245% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (10.808) | (10.805) |
| CCILs | GBP 15.000 | Fund receives Fixed 4,250% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/10/2031 | (1.476) | (1.476) |
| CCILs | GBP 310.000 | Fund receives Fixed 4,262% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (25.283) | (24.237) |
| CCILs | GBP 140.000 | Fund receives Fixed 4,262% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (11.418) | (10.946) |
| CCILs | GBP 340.000 | Fund receives Fixed 4,324% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2032 | (18.065) | (18.057) |
| CCILs | GBP 520.000 | Fund receives Fixed 4,328% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2032 | (31.730) | (31.717) |
| CCILs | GBP 139.000 | Fund receives Fixed 4,348% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2031 | (11.279) | (11.276) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCILS | GBP 230.000 | Fund receives Fixed 4,371% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2032 | (10.718) | (10.713) |
| CCILS | GBP 700.000 | Fund receives Fixed 4,435% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (37.727) | (37.710) |
| CCILS | GBP 1.181.000 | Fund receives Fixed 4,810% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2026 | (77.907) | (77.886) |
| CCILS | EUR 550.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,005% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 7.246 | 7.253 |
| CCILS | EUR 1.560.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,018% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 19.521 | 19.540 |
| CCILS | EUR 107.200 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,080% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 1.051 | 988 |
| CCILS | EUR 52.800 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,115% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 416 | 388 |
| CCILS | GBP 18.122 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,750% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2052 | (1.943) | (1.942) |
| CCILS | GBP 750.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 4,492% | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2023 | 72.483 | 72.491 |
| CCILS | GBP 1.181.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,070% | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2024 | 82.439 | 82.452 |
| CCILS | GBP 410.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,100% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2027 | 6.164 | 6.191 |
| CCILS | GBP 230.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,100% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2027 | 3.458 | 3.473 |
| CCILS | GBP 94.400 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,472% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 1.492 | 1.493 |
| CCILS | GBP 236.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,560% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 3.235 | 3.237 |
| CCILS | GBP 189.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,620% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 2.318 | 2.320 |
| CCILS | GBP 188.600 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,625% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 2.291 | 2.292 |
| CCILS | GBP 377.600 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,632% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 4.519 | 4.522 |
| CCIRS | EUR 2.160.000 | Fund receives Fixed 0,088% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (310.295) | (310.258) |
| CCIRS | EUR 5.670.000 | Fund receives Fixed -0,103% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2026 | (357.945) | (357.871) |
| CCIRS | EUR 1.556.130 | Fund receives Fixed -0,134% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/10/2026 | (104.083) | (104.067) |
| CCIRS | EUR 1.810.000 | Fund receives Fixed 0,180% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (246.004) | (245.970) |
| CCIRS | EUR 241.400 | Fund receives Fixed 0,222% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 19/10/2031 | (33.507) | (33.551) |
| CCIRS | EUR 3.190.000 | Fund receives Fixed 0,424% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2027 | (155.870) | (155.838) |
| CCIRS | EUR 735.500 | Fund receives Fixed 0,462% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/10/2026 | (30.633) | (30.626) |
| CCIRS | EUR 700.000 | Fund receives Fixed 0,547% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/3/2029 | (49.290) | (49.280) |
| CCIRS | EUR 580.000 | Fund receives Fixed 0,624% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 10/2/2029 | (37.608) | (37.600) |
| CCIRS | EUR 800.000 | Fund receives Fixed 0,674% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (71.769) | (71.757) |
| CCIRS | EUR 1.000.000 | Fund receives Fixed 0,710% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2027 | (34.901) | (36.058) |
| CCIRS | EUR 1.700.000 | Fund receives Fixed 0,730% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (152.978) | (152.897) |
| CCIRS | EUR 679.482 | Fund receives Fixed 0,745% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 11/3/2052 | (129.471) | (154.190) |
| CCIRS | EUR 362.000 | Fund receives Fixed 0,749% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2046 | (66.351) | (78.197) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | EUR 127.300 | Fund receives Fixed 0,768% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (10.446) | (10.444) |
| CCIRS | EUR 781.000 | Fund receives Fixed 0,784% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (63.083) | (63.071) |
| CCIRS | EUR 741.000 | Fund receives Fixed 0,800% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2032 | (69.286) | (69.125) |
| CCIRS | EUR 1.740.000 | Fund receives Fixed 0,813% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (136.292) | (136.262) |
| CCIRS | EUR 570.000 | Fund receives Fixed 0,817% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (44.467) | (44.459) |
| CCIRS | EUR 670.000 | Fund receives Fixed 0,817% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (52.269) | (52.258) |
| CCIRS | EUR 1.197.000 | Fund receives Fixed 0,825% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (92.663) | (92.645) |
| CCIRS | EUR 890.000 | Fund receives Fixed 0,828% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (68.651) | (68.637) |
| CCIRS | EUR 330.000 | Fund receives Fixed 0,840% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (25.141) | (25.136) |
| CCIRS | EUR 2.580.000 | Fund receives Fixed 0,906% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2037 | (368.687) | (368.633) |
| CCIRS | EUR 407.791 | Fund receives Fixed 0,983% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 16/3/2032 | (29.965) | (31.509) |
| CCIRS | EUR 725.774 | Fund receives Fixed 1,122% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (31.070) | (41.418) |
| CCIRS | EUR 3.500.000 | Fund receives Fixed 1,284% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 29/4/2027 | (36.730) | (36.695) |
| CCIRS | EUR 443.657 | Fund receives Fixed 1,310% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 30/5/2027 | (4.625) | (4.621) |
| CCIRS | EUR 718.000 | Fund receives Fixed 1,331% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (20.380) | (28.364) |
| CCIRS | EUR 499.000 | Fund receives Fixed 1,365% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 5/5/2027 | (2.507) | (2.502) |
| CCIRS | EUR 610.000 | Fund receives Fixed 1,439% and pays Floating EUR 3 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2052 | (48.662) | (48.880) |
| CCIRS | EUR 303.000 | Fund receives Fixed 1,532% and pays Floating EUR 3 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 5/5/2052 | (17.310) | (17.679) |
| CCIRS | GBP 212.910 | Fund receives Fixed 1,541% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 8/4/2052 | (25.532) | (25.528) |
| CCIRS | EUR 500.000 | Fund receives Fixed 1,566% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 29/4/2032 | (12.714) | (12.706) |
| CCIRS | EUR 460.000 | Fund receives Fixed 1,613% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (6.253) | (6.246) |
| CCIRS | EUR 525.000 | Fund receives Fixed 1,642% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (7.046) | (7.038) |
| CCIRS | EUR 2.685.000 | Fund receives Fixed 1,699% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (17.734) | (17.693) |
| CCIRS | EUR 2.765.000 | Fund receives Fixed 1,762% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (4.127) | (4.084) |
| CCIRS | GBP 710.000 | Fund receives Fixed 2,138% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 3/5/2027 | (5.099) | (5.125) |
| CCIRS | EUR 1.560.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,474% | Bank of America Merrill Lynch | 8/2/2023 | 263 | 265 |
| CCIRS | EUR 1.560.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,482% | Bank of America Merrill Lynch | 8/2/2023 | 246 | 248 |
| CCIRS | EUR 770.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,148% | Bank of America Merrill Lynch | 5/5/2027 | 3.920 | 3.928 |
| CCIRS | EUR 1.954.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,345% | Bank of America Merrill Lynch | 5/5/2024 | 1.155 | 1.164 |
| CCIRS | EUR 104.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed -0,025% | Bank of America Merrill Lynch | 21/1/2061 | 47.334 | 47.338 |
| CCIRS | EUR 150.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,358% | Bank of America Merrill Lynch | 2/2/2072 | 55.762 | 55.768 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-------------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | EUR 454.192 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,450% | Bank of America Merrill Lynch | 11/3/2072 | 120.066 | 154.813 |
| CCIRS | EUR 182.247 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,533% | Bank of America Merrill Lynch | 4/12/2049 | 49.320 | 49.320 |
| CCIRS | EUR 3.705.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,538% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2027 | 160.806 | 160.842 |
| CCIRS | EUR 420.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,581% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2072 | 124.587 | 124.604 |
| CCIRS | EUR 409.366 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,713% | Bank of America Merrill Lynch | 16/3/2027 | 13.882 | 14.716 |
| CCIRS | EUR 78.750 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,742% | Bank of America Merrill Lynch | 23/4/2052 | 2.050 | 2.052 |
| CCIRS | EUR 78.750 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,749% | Bank of America Merrill Lynch | 23/4/2052 | 2.017 | 2.019 |
| CCIRS | EUR 107.200 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,760% | Bank of America Merrill Lynch | 22/4/2052 | 2.671 | 2.674 |
| CCIRS | EUR 105.600 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,775% | Bank of America Merrill Lynch | 22/4/2052 | 2.551 | 2.532 |
| CCIRS | EUR 264.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,797% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2052 | 57.162 | 56.725 |
| CCIRS | EUR 57.946 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,817% | Bank of America Merrill Lynch | 16/3/2052 | 11.283 | 12.184 |
| CCIRS | EUR 610.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,400% | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2052 | 45.554 | 45.816 |
| CCIRS | EUR 303.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,463% | Bank of America Merrill Lynch | 5/5/2052 | 17.990 | 18.381 |
| CCIRS | EUR 314.144 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,818% | Bank of America Merrill Lynch | 25/7/2038 | 6.428 | 8.196 |
| CCIRS | GBP 55.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,280% | Bank of America Merrill Lynch | 1/4/2072 | 11.365 | 11.368 |
| CCIRS | GBP 139.366 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,360% | Bank of America Merrill Lynch | 8/4/2072 | 24.618 | 24.628 |
| CCIRS | GBP 30.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,542% | Bank of America Merrill Lynch | 21/4/2072 | 3.265 | 3.267 |
| CCIRS | USD 132.000 | Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,860% | Bank of America Merrill Lynch | 3/4/2028 | (11) | (11) |
| CCIRS | USD 1.000.000 | Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,972% | Bank of America Merrill Lynch | 10/5/2027 | (4.998) | (4.998) |
| CCIRS | USD 200.000 | Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,974% | Bank of America Merrill Lynch | 3/5/2028 | (1.171) | (1.171) |
| CDS | EUR 386.300 | Fund receives default protection on Tesco Plc and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 5.832 | 2.569 |
| CDS | EUR 250.000 | Fund receives default protection on WPP Finance SA and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 1.296 | 1.296 |
| CDS | EUR 24.500 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BNP Paribas | Barclays Bank | 20/6/2022 | (63) | 11 |
| CDS | EUR 193.000 | Fund receives default protection on Tesco Plc and pays Fixed 1,000% | Citibank | 20/6/2027 | 2.963 | 1.284 |
| CDS | EUR 92.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BNP Paribas | Citibank | 20/6/2022 | (284) | 42 |
| CDS | EUR 73.220 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BNP Paribas | Citibank | 20/6/2022 | (189) | 33 |
| CDS | EUR 85.887 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BNP Paribas | Citibank | 20/6/2022 | (265) | 39 |
| CDS | EUR 111.000 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 2.943 | 1.707 |
| CDS | EUR 51.090 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 1.029 | 786 |
| IRS | KRW 4.642.338.750 | Fund receives Fixed 1,590% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2023 | (51.548) | (51.548) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-------------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| IRS | KRW 3.868.590.000 | Fund receives Fixed 1,630% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2023 | (41.805) | (41.806) |
| IRS | KRW 3.868.641.250 | Fund receives Fixed 1,632% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | BNP Paribas | 21/9/2023 | (41.749) | (41.749) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 5.530.839) | | | | | (3.398.247) | (3.374.500) |

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

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (1) | USD | 3 Month SOFR Futures December 2022 | März 2023 | 226.920 | (470) |
| 2 | GBP | 3 Month SONIA Futures June 2022 | September 2022 | 579.065 | 59 |
| 160 | AUD | 90 Day Bank Bill Futures December 2022 | Dezember 2022 | 106.416.478 | (318.773) |
| (10) | EUR | CAC 40 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 645.700 | (22.285) |
| (211) | EUR | Euro BOBL Futures June 2022 | Juni 2022 | 26.670.400 | 923.529 |
| 66 | EUR | Euro BTP Futures June 2022 | Juni 2022 | 7.226.340 | (143.465) |
| 30 | EUR | Euro BTP Futures June 2022 | Juni 2022 | 3.806.100 | (423.590) |
| (34) | EUR | Euro BTP Futures June 2022 | Juni 2022 | 4.313.580 | 478.027 |
| (176) | EUR | Euro Bund Futures June 2022 | Juni 2022 | 26.662.240 | 464.655 |
| 3 | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 487.920 | (25.340) |
| (25) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 4.066.000 | 411.160 |
| (1) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures September 2022 | September 2022 | 174.480 | 3.920 |
| (30) | EUR | Euro Schatz Futures June 2022 | Juni 2022 | 3.302.850 | 7.015 |
| (17) | EUR | EURO STOXX 50 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 643.450 | (28.687) |
| (607) | EUR | EURO STOXX 50 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 2.786.130 | (201.023) |
| (113) | EUR | Euro-OAT Futures June 2022 | Juni 2022 | 16.274.260 | 486.159 |
| 64 | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2022 | September 2022 | 8.741.006 | (141.396) |
| (2) | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2022 | September 2022 | 273.156 | 4.677 |
| (1) | USD | US Long Bond Futures September 2022 | September 2022 | 129.842 | 1.768 |
| (17) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 2.037.223 | 21.193 |
| (20) | USD | US Treasury 2 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 3.939.178 | 712 |
| (77) | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 8.113.865 | 16.686 |
| 2 | USD | US Ultra Bond Futures September 2022 | September 2022 | 289.790 | (6.303) |
| (3) | USD | US Ultra Bond Futures September 2022 | September 2022 | 434.685 | 2.052 |
| Gesamt | | | | | 1.510.280 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------|----------------------------------|-----------------|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 80 | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.900,00 | 17/06/2022 | (54.160) | 96.720 |
| 180 | Put | Raiffeisen Bank International AG | Exchange Traded | EUR 8,00 | 17/06/2022 | (4.480) | 180 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|----------------------------------|-----------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 54 | Put | STOXX Europe 600 Oil & Gas Index | Exchange Traded | EUR 300,00 | 16/12/2022 | (15.255) | 31.995 |
| 2.850.000 | Call | OTC USD/CNH | HSBC | USD 6,90 | 18/08/2022 | (5.089) | 10.237 |
| 1.770.000 | Call | OTC EUR/USD | Morgan Stanley | EUR 1,06 | 04/08/2022 | 7.585 | 40.898 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 3.015.020) | | | | | | (71.399) | 180.030 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|-----------------------|-------------|---------------|---------------|------------------------------------|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (2.850.000) | Call | OTC USD/CNH | HSBC | USD 7,10 | 18/08/2022 | 1.910 | (3.940) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 183.693) | | | | | | 1.910 | (3.940) |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|--|---------------|---------------|---------------|------------------------------------|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| 3.000.000 | Call | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 from 15/6/2022 | Barclays Bank | EUR 0,90 | 15/06/2022 | 1.354 | 6.304 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 1.434.838) | | | | | | 1.354 | 6.304 |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|---|---------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (3.500.000) | Call | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 12/10/2023; and pays 1,37% Fixed annually from 6/4/2023 | Goldman Sachs | EUR 1,37 | 06/04/2023 | 39.450 | (28.625) |
| (3.500.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,37% Fixed annually from 6/4/2023; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 12/10/2023 | Goldman Sachs | EUR 1,37 | 06/04/2023 | (35.963) | (104.038) |
| (3.000.000) | Put | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 from 15/6/2022 | Barclays Bank | EUR 1,10 | 15/06/2022 | 5.946 | (582) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 3.711.789) | | | | | | 9.433 | (133.245) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 110.000 | EUR | 73.374 | JP Morgan | 14/7/2022 | 223 |
| AUD | 440.000 | EUR | 296.940 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | (2.554) |
| CHF | 810.000 | EUR | 791.156 | Barclays Bank | 7/6/2022 | (3.094) |
| CHF | 690.000 | EUR | 673.009 | HSBC | 7/6/2022 | (1.698) |
| CHF | 22.600.000 | EUR | 21.919.466 | Societe Generale | 7/6/2022 | 68.424 |
| CHF | 980.000 | EUR | 957.352 | Deutsche Bank | 14/7/2022 | (3.803) |
| CNH | 3.670.000 | USD | 559.856 | Citibank | 15/6/2022 | (9.558) |
| CZK | 23.716.000 | EUR | 958.479 | Morgan Stanley | 7/6/2022 | 380 |
| CZK | 11.130.000 | EUR | 450.123 | UBS | 14/7/2022 | (3.283) |
| DKK | 49.955.000 | EUR | 6.715.252 | Deutsche Bank | 7/6/2022 | (329) |
| DKK | 4.086.000 | EUR | 549.233 | Deutsche Bank | 14/7/2022 | 2 |
| DKK | 810.000 | EUR | 108.846 | JP Morgan | 14/7/2022 | 33 |
| EUR | 80.314 | AUD | 120.000 | Bank of America Merrill Lynch | 14/7/2022 | 28 |
| EUR | 155.573 | AUD | 230.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 1.690 |
| EUR | 225.585 | AUD | 330.000 | Royal Bank of Canada | 14/7/2022 | 4.797 |
| EUR | 27.389 | AUD | 40.000 | UBS | 14/7/2022 | 626 |
| EUR | 23.589.564 | CHF | 24.100.000 | Barclays Bank | 7/6/2022 | 142.301 |
| EUR | 21.920.872 | CHF | 22.600.000 | Societe Generale | 7/7/2022 | (68.775) |
| EUR | 19.701 | CHF | 20.000 | Royal Bank of Canada | 14/7/2022 | 241 |
| EUR | 961.551 | CZK | 23.716.000 | Morgan Stanley | 7/6/2022 | 2.692 |
| EUR | 953.358 | CZK | 23.716.000 | Morgan Stanley | 7/7/2022 | 74 |
| EUR | 6.712.210 | DKK | 49.955.000 | Standard Chartered Bank | 7/6/2022 | (2.713) |
| EUR | 6.715.329 | DKK | 49.955.000 | Deutsche Bank | 7/7/2022 | 465 |
| EUR | 1.969.716 | DKK | 14.650.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 483 |
| EUR | 69.881 | DKK | 520.000 | Royal Bank of Canada | 14/7/2022 | (17) |
| EUR | 17.471 | DKK | 130.000 | Toronto Dominion Bank | 14/7/2022 | (4) |
| EUR | 65.582.725 | GBP | 55.401.000 | HSBC | 7/6/2022 | 479.904 |
| EUR | 422.209 | GBP | 355.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 5.192 |
| EUR | 410.276 | GBP | 350.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (868) |
| EUR | 820.109 | GBP | 700.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (2.178) |
| EUR | 409.257 | GBP | 350.000 | HSBC | 15/6/2022 | (1.887) |
| EUR | 62.298.612 | GBP | 53.111.000 | BNP Paribas | 7/7/2022 | (18.469) |
| EUR | 249.093 | GBP | 210.000 | Bank of America Merrill Lynch | 14/7/2022 | 2.760 |
| EUR | 445.273 | GBP | 380.000 | Deutsche Bank | 14/7/2022 | (473) |
| EUR | 153.497 | GBP | 130.000 | HSBC | 14/7/2022 | 1.003 |
| EUR | 1.141.404 | GBP | 960.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 15.309 |
| EUR | 192.457 | GBP | 160.000 | Royal Bank of Canada | 14/7/2022 | 4.775 |
| EUR | 475.501 | GBP | 400.000 | Societe Generale | 14/7/2022 | 6.295 |
| EUR | 573.279 | GBP | 490.000 | Standard Chartered Bank | 14/7/2022 | (1.498) |
| EUR | 129.897 | GBP | 110.000 | State Street Bank & Trust Company | 14/7/2022 | 865 |
| EUR | 95.231 | GBP | 80.000 | THE BANK OF NEW YORK MELLON | 14/7/2022 | 1.390 |
| EUR | 239.875 | GBP | 200.000 | UBS | 14/7/2022 | 5.272 |
| EUR | 650.540 | HUF | 246.305.000 | HSBC | 7/6/2022 | 28.004 |
| EUR | 624.255 | HUF | 246.305.000 | BNP Paribas | 7/7/2022 | 5.379 |
| EUR | 2.296.722 | NOK | 22.759.000 | Bank of America Merrill Lynch | 7/6/2022 | 42.106 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 1.064.687 | NOK | 10.300.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 44.673 |
| EUR | 2.239.084 | NOK | 22.759.000 | Morgan Stanley | 7/7/2022 | (12.518) |
| EUR | 1.178.795 | NZD | 1.870.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 46.079 |
| EUR | 1.534.411 | PLN | 7.241.000 | Morgan Stanley | 7/6/2022 | (48.291) |
| EUR | 1.571.627 | PLN | 7.241.000 | HSBC | 7/7/2022 | (1.860) |
| EUR | 10.454.870 | SEK | 108.298.000 | Deutsche Bank | 7/6/2022 | 162.307 |
| EUR | 9.395.432 | SEK | 98.818.000 | JP Morgan | 7/7/2022 | 9.385 |
| EUR | 975.549 | SEK | 10.070.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 19.243 |
| EUR | 276.186 | USD | 290.000 | State Street Bank & Trust Company | 7/6/2022 | 5.529 |
| EUR | 710.000 | USD | 785.733 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (23.029) |
| EUR | 1.690.000 | USD | 1.859.964 | HSBC | 15/6/2022 | (45.207) |
| EUR | 1.010.000 | USD | 1.097.506 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (13.891) |
| EUR | 268.961 | USD | 290.000 | Bank of America Merrill Lynch | 7/7/2022 | (1.267) |
| EUR | 3.672.298 | USD | 4.010.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | (62.836) |
| EUR | 46.745 | USD | 50.000 | Royal Bank of Canada | 14/7/2022 | 172 |
| EUR | 28.025 | USD | 30.000 | State Street Bank & Trust Company | 14/7/2022 | 82 |
| GBP | 710.000 | EUR | 843.766 | Barclays Bank | 7/6/2022 | (9.431) |
| GBP | 53.111.000 | EUR | 62.386.793 | BNP Paribas | 7/6/2022 | 25.002 |
| GBP | 1.020.000 | EUR | 1.197.356 | Deutsche Bank | 7/6/2022 | 1.266 |
| GBP | 560.000 | EUR | 653.512 | THE BANK OF NEW YORK MELLON | 7/6/2022 | 4.555 |
| GBP | 360.000 | EUR | 423.796 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (905) |
| GBP | 347.500 | EUR | 407.358 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 849 |
| GBP | 420.000 | EUR | 498.190 | BNP Paribas | 14/7/2022 | (5.524) |
| GBP | 130.000 | EUR | 152.783 | JP Morgan | 14/7/2022 | (291) |
| GBP | 4.500.000 | EUR | 5.387.254 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | (108.688) |
| HUF | 246.305.000 | EUR | 627.758 | BNP Paribas | 7/6/2022 | (5.222) |
| HUF | 91.108.000 | EUR | 240.209 | Goldman Sachs | 14/7/2022 | (11.588) |
| NOK | 22.759.000 | EUR | 2.241.959 | Morgan Stanley | 7/6/2022 | 12.658 |
| NOK | 10.300.000 | EUR | 1.047.141 | Natwest Markets | 15/6/2022 | (27.127) |
| NOK | 4.407.000 | EUR | 460.162 | Bank of America Merrill Lynch | 14/7/2022 | (24.301) |
| NOK | 10.200.000 | USD | 1.125.542 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (39.935) |
| NZD | 2.150.000 | USD | 1.483.358 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (78.927) |
| PLN | 7.241.000 | EUR | 1.580.508 | HSBC | 7/6/2022 | 2.194 |
| PLN | 3.189.000 | EUR | 678.446 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 13.594 |
| SEK | 9.480.000 | EUR | 917.014 | Barclays Bank | 7/6/2022 | (16.042) |
| SEK | 98.818.000 | EUR | 9.400.565 | JP Morgan | 7/6/2022 | (8.974) |
| USD | 1.153.584 | CNH | 7.340.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 50.716 |
| USD | 290.000 | EUR | 269.384 | Bank of America Merrill Lynch | 7/6/2022 | 1.273 |
| USD | 1.046.663 | EUR | 977.820 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (1.363) |
| USD | 1.762.031 | EUR | 1.660.000 | HSBC | 15/6/2022 | (16.157) |
| USD | 1.077.229 | EUR | 1.020.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | (15.026) |
| USD | 480.000 | EUR | 452.933 | Bank of America Merrill Lynch | 14/7/2022 | (5.834) |
| USD | 1.113.217 | NOK | 9.866.377 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 61.476 |
| USD | 37.646 | NOK | 333.623 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 2.082 |
| USD | 713.793 | NZD | 1.030.000 | HSBC | 15/6/2022 | 40.761 |
| USD | 731.405 | NZD | 1.120.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 2.566 |
| | | | | | | 621.740 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|------------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CZK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CZK | 36.881.903 | EUR | 1.493.941 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (5.063) |
| EUR | 30.730 | CZK | 769.213 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (322) |
| | | | | | | (5.385) |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 3.487 | USD | 3.682 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 51 |
| USD | 315.007 | EUR | 297.158 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (3.279) |
| | | | | | | (3.228) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 377.329.136) | | | | | | 613.127 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|---------------------------------------|--------------|
| Finanzen | 34,23 |
| Staatsanleihen | 27,33 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 10,31 |
| Versorger | 5,70 |
| Industrie | 4,05 |
| Zyklische Konsumgüter | 3,65 |
| Energie | 3,37 |
| Kommunikation | 2,52 |
| Mit Hypotheken besicherte Wertpapiere | 1,85 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 1,73 |
| Technologie | 1,29 |
| Grundstoffe | 1,06 |
| Asset Backed Securities (ABS) | 0,59 |
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 0,06 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 97,74 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 2,26 |
| <hr/> | |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Unconstrained Equity Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | |
|--|-------------------------------------|------------------------|--------------------|--|---|------------------------|--------------------|--------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Großbritannien | | | | |
| STAMMAKTIEN | | | | 294.078 | Auto Trader Group Plc | 2.029.314 | 3,44 | |
| | Dänemark | | | 43.522 | London Stock Exchange Group Plc | 3.805.243 | 6,44 | |
| 45.928 | Novo Nordisk A/S 'B' | 4.747.509 | 8,04 | 53.519 | RELX Plc | 1.430.207 | 2,42 | |
| | | 4.747.509 | 8,04 | 21.666 | Spirax-Sarco Engineering Plc | 2.702.709 | 4,57 | |
| | Finnland | | | | | 9.967.473 | 16,87 | |
| 36.128 | Kone Oyj 'B' | 1.725.835 | 2,92 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| | | 1.725.835 | 2,92 | 5.738 | ANSYS Inc | 1.375.138 | 2,33 | |
| | Frankreich | | | 8.228 | Mastercard Inc 'A' | 2.738.033 | 4,63 | |
| 2.161 | Hermes International | 2.372.778 | 4,02 | 7.421 | S&P Global Inc | 2.453.346 | 4,15 | |
| 7.038 | L'Oreal SA | 2.315.854 | 3,92 | 14.981 | VeriSign Inc | 2.426.328 | 4,11 | |
| 6.421 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 3.838.474 | 6,50 | | | 8.992.845 | 15,22 | |
| 4.663 | Sartorius Stedim Biotech | 1.518.739 | 2,57 | Gesamt Stammaktien | | | | |
| | | 10.045.845 | 17,01 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | |
| | Deutschland | | | 58.735.481 | | | | 99,43 |
| 2.336 | Rational AG | 1.419.120 | 2,40 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | | |
| 19.967 | Symrise AG | 2.049.613 | 3,47 | Irland | | | | |
| | | 3.468.733 | 5,87 | 3.083 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc)^ | 302.917 | 0,51 | |
| | Irland | | | | | 302.917 | 0,51 | |
| 27.385 | Kingspan Group Plc | 2.111.384 | 3,57 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | | | |
| | | 2.111.384 | 3,57 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | | |
| | Niederlande | | | 59.038.398 | | | | 99,94 |
| 9.489 | ASML Holding NV | 5.125.009 | 8,68 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | | |
| 14.289 | Ferrari NV | 2.594.168 | 4,39 | 32.645 | | | | 0,06 |
| | | 7.719.177 | 13,07 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | | | |
| | Schweden | | | 59.071.043 | | | | 100,00 |
| 95.949 | Assa Abloy AB 'B' | 2.217.011 | 3,75 | ^ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9. | | | | |
| 220.408 | Hexagon AB 'B' | 2.532.772 | 4,29 | | | | | |
| | | 4.749.783 | 8,04 | | | | | |
| | Schweiz | | | | | | | |
| 4.219 | Lonza Group AG Reg | 2.374.937 | 4,02 | | | | | |
| 24.892 | Nestle SA Reg | 2.831.960 | 4,80 | | | | | |
| | | 5.206.897 | 8,82 | | | | | |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|-----------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 354.545 | GBP | 302.736 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (1.077) |
| GBP | 2.031.447 | EUR | 2.372.787 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 13.546 |
| | | | | | | 12.469 |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 489.675 | USD | 516.145 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 8.150 |
| USD | 4.427.785 | EUR | 4.175.901 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (45.110) |
| | | | | | | (36.960) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 7.354.273) | | | | | | (24.491) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Nicht zyklische Konsumgüter | 29,92 |
| Industrie | 19,10 |
| Zyklische Konsumgüter | 17,31 |
| Finanzen | 11,07 |
| Technologie | 11,01 |
| Kommunikation | 7,55 |
| Grundstoffe | 3,47 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 0,51 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 99,94 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 0,06 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|-------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Dänemark | | | |
| STAMMAKTIE | | | | EUR 900.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 9/6/2029 | 791.325 | 0,21 |
| Belgien | | | | EUR 4.347.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 15/5/2031 | 3.923.689 | 1,07 |
| 1.500 | Solvay SA | 136.200 | 0,04 | DKK 6.330.000 | Nykredit Realkredit A/S 1,00% 1/1/2027 | 818.313 | 0,22 |
| | | 136.200 | 0,04 | DKK 6.330.000 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/7/2026 | 826.174 | 0,22 |
| Italien | | | | DKK 12.133.357 | Nykredit Realkredit A/S RegS 0,50% 1/10/2035 | 1.491.512 | 0,41 |
| 23.999 | ACEA SpA | 407.263 | 0,11 | DKK 1 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/10/2053 | — | 0,00 |
| 187.211 | Iren SpA | 456.420 | 0,12 | DKK 1 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | — | 0,00 |
| | | 863.683 | 0,23 | EUR 119.000 | Orsted A/S RegS FRN 9/12/3019 | 106.921 | 0,03 |
| Gesamt Stammaktien | | 999.883 | 0,27 | DKK 7.166.999 | Realkredit Danmark A/S 0,50% 1/10/2035 | 880.783 | 0,24 |
| ANLEIHEN | | | | DKK 1 | Realkredit Danmark A/S RegS 0,50% 1/10/2050 | — | 0,00 |
| Australien | | | | | | 8.838.717 | 2,40 |
| EUR 925.000 | APA Infrastructure Ltd RegS 0,75% 15/3/2029 | 786.907 | 0,21 | Estland | | | |
| EUR 1.907.000 | APA Infrastructure Ltd RegS 2,00% 15/7/2030 | 1.704.400 | 0,46 | EUR 800.000 | Elering AS RegS 0,875% 3/5/2023 | 799.396 | 0,22 |
| EUR 600.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd RegS 0,25% 17/3/2025 | 583.278 | 0,16 | | | 799.396 | 0,22 |
| EUR 591.000 | Macquarie Group Ltd RegS 0,35% 3/3/2028 | 511.989 | 0,14 | Finnland | | | |
| | | 3.586.574 | 0,97 | EUR 765.000 | Finland Government Bond RegS 1,50% 15/9/2032 | 750.840 | 0,20 |
| Österreich | | | | EUR 1.895.000 | Finland Government Bond RegS 1,375% 15/4/2047 | 1.715.240 | 0,47 |
| EUR 2.300.000 | BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029 | 2.274.447 | 0,62 | EUR 725.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,625% 27/7/2027 | 658.967 | 0,18 |
| EUR 800.000 | Erste Group Bank AG RegS 0,05% 16/9/2025 | 752.256 | 0,21 | EUR 527.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,375% 16/6/2028 | 458.991 | 0,12 |
| EUR 400.000 | Erste Group Bank AG RegS 0,01% 12/7/2028 | 362.384 | 0,10 | EUR 462.000 | OP Mortgage Bank RegS 0,625% 15/2/2029 | 431.568 | 0,12 |
| EUR 500.000 | Kommunalkredit Austria AG RegS 0,25% 14/5/2024 | 483.950 | 0,13 | | | 4.015.606 | 1,09 |
| EUR 500.000 | Raiffeisen Bank International AG RegS 1,50% 24/5/2027 | 494.190 | 0,13 | Frankreich | | | |
| EUR 1.395.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,90% 20/2/2032 | 1.300.600 | 0,35 | EUR 800.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 1,625% 25/5/2032 | 777.768 | 0,21 |
| EUR 960.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 1,85% 23/5/2049 | 941.175 | 0,26 | EUR 700.000 | Agence France Locale RegS 0,20% 20/3/2029 | 638.309 | 0,17 |
| | | 6.609.002 | 1,80 | EUR 400.000 | Arkea Home Loans SFH SA RegS 1,75% 16/5/2032 | 393.232 | 0,11 |
| Belgien | | | | EUR 600.000 | AXA SA RegS FRN 10/3/2043 | 599.592 | 0,16 |
| EUR 600.000 | Ageas SA RegS FRN 31/12/2099 | 521.784 | 0,14 | EUR 300.000 | AXA SA RegS FRN 4/7/2043 | 312.198 | 0,09 |
| EUR 1.700.000 | Argenta Spaarbank NV RegS FRN 8/2/2029 | 1.526.974 | 0,42 | EUR 1.500.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,25% 29/6/2028 | 1.332.780 | 0,36 |
| EUR 600.000 | FLUVIUS System Operator CVBA RegS 0,25% 2/12/2030 | 494.826 | 0,13 | GBP 200.000 | BNP Paribas SA RegS 1,875% 14/12/2027 | 215.496 | 0,06 |
| EUR 2.000.000 | KBC Group NV RegS FRN 10/9/2026 | 1.864.420 | 0,51 | EUR 1.000.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 30/5/2028 | 899.460 | 0,24 |
| | | 4.408.004 | 1,20 | EUR 500.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 11/7/2030 | 435.510 | 0,12 |
| Kanada | | | | GBP 100.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 24/5/2031 | 107.165 | 0,03 |
| EUR 910.000 | Bank of Nova Scotia RegS 0,01% 15/12/2027 | 831.285 | 0,22 | EUR 1.600.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 31/3/2032 | 1.525.088 | 0,41 |
| EUR 600.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce RegS 0,375% 10/3/2026 | 576.618 | 0,16 | GBP 400.000 | BPCE SA RegS FRN 30/11/2032 | 424.476 | 0,12 |
| | | 1.407.903 | 0,38 | EUR 1.800.000 | BPCE SA RegS FRN 13/10/2046 | 1.413.324 | 0,38 |
| Zypern | | | | EUR 900.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 21/1/2027 | 840.474 | 0,23 |
| EUR 623.000 | Cyprus Government International Bond RegS 0,95% 20/1/2032 | 529.164 | 0,14 | EUR 1.200.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 10/11/2027 | 1.102.212 | 0,30 |
| | | 529.164 | 0,14 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|---|------------------------|--------------------|---------------|--|------------------------|--------------------|
| | Frankreich Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | |
| EUR 500.000 | BPCE SFH SA RegS 1,125% 12/4/2030 | 475.910 | 0,13 | EUR 300.000 | Commerzbank AG RegS 1,25% 23/10/2023 | 299.262 | 0,08 |
| EUR 300.000 | BPCE SFH SA RegS 0,125% 3/12/2030 | 260.448 | 0,07 | EUR 1.800.000 | Commerzbank AG RegS FRN 29/12/2031 | 1.541.898 | 0,42 |
| EUR 800.000 | BPCE SFH SA RegS 1,75% 27/5/2032 | 785.904 | 0,21 | EUR 1.000.000 | Deutsche Bahn Finance GmbH RegS 0,625% 8/12/2050 | 601.270 | 0,16 |
| EUR 2.500.000 | Coentreprise de Transport d'Electricite SA RegS 1,50% 29/7/2028 | 2.355.700 | 0,64 | EUR 400.000 | Deutsche Bahn Finance GmbH RegS FRN 31/12/2099 [*] | 377.000 | 0,10 |
| EUR 900.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,125% 23/5/2029 [*] | 814.599 | 0,22 | EUR 738.000 | Deutsche Bahn Finance GMBH RegS 1,375% 16/4/2040 [*] | 602.134 | 0,16 |
| EUR 700.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA RegS 0,625% 4/3/2027 | 672.385 | 0,18 | GBP 100.000 | Deutsche Bank AG RegS 2,625% 16/12/2024 | 113.909 | 0,03 |
| EUR 1.400.000 | Electricite de France SA RegS FRN 31/12/2099 | 1.353.660 | 0,37 | GBP 800.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/6/2026 | 933.245 | 0,25 |
| GBP 800.000 | Electricite de France SA RegS FRN 31/12/2099 | 908.312 | 0,25 | EUR 1.900.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/5/2028 | 1.893.445 | 0,52 |
| EUR 800.000 | Engie SA RegS 1,375% 27/3/2025 | 793.296 | 0,22 | EUR 3.000.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/6/2032 | 2.881.440 | 0,78 |
| EUR 3.500.000 | Engie SA RegS 0,375% 11/6/2027 [*] | 3.195.850 | 0,87 | EUR 300.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,125% 5/9/2024 | 288.606 | 0,08 |
| EUR 1.900.000 | Engie SA RegS 1,25% 24/10/2041 | 1.319.949 | 0,36 | EUR 1.200.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 27/10/2025 | 1.117.428 | 0,30 |
| EUR 1.050.000 | Faurecia SE RegS 2,75% 15/2/2027 | 903.493 | 0,25 | EUR 300.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,01% 25/8/2026 | 282.627 | 0,08 |
| EUR 2.092.000 | Faurecia SE RegS 3,75% 15/6/2028 | 1.834.747 | 0,50 | EUR 397.000 | Deutsche Telekom AG RegS 1,75% 9/12/2049 [*] | 300.600 | 0,08 |
| EUR 4.000.000 | La Banque Postale SA RegS 3,00% 9/6/2028 [*] | 3.818.800 | 1,04 | EUR 268.000 | DZ HYP AG RegS 0,01% 26/10/2026 | 251.850 | 0,07 |
| EUR 600.000 | Orange SA RegS 1,25% 7/7/2027 | 577.680 | 0,16 | EUR 500.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,113% 15/5/2032 | 433.075 | 0,12 |
| EUR 1.400.000 | Orange SA RegS 0,75% 29/6/2034 | 1.111.278 | 0,30 | EUR 1.700.000 | Eurogrid GmbH RegS 0,741% 21/4/2033 | 1.356.651 | 0,37 |
| EUR 800.000 | Orange SA RegS FRN 29/12/2049 | 840.568 | 0,23 | EUR 800.000 | Evonik Industries AG RegS 0,625% 18/9/2025 | 762.528 | 0,21 |
| EUR 500.000 | PSA Banque France SA RegS 22/1/2025 (Zero Coupon) | 475.560 | 0,13 | EUR 1.800.000 | Fresenius SE & Co KGaA RegS 1,125% 28/1/2033 [*] | 1.438.524 | 0,39 |
| EUR 500.000 | Societe Du Grand Paris EPIC RegS 1,625% 8/4/2042 | 442.920 | 0,12 | EUR 1.000.000 | Hamburg Commercial Bank AG RegS 0,75% 23/11/2023 | 999.330 | 0,27 |
| EUR 500.000 | Societe Generale SA FRN 24/11/2030 | 457.100 | 0,12 | EUR 1.900.000 | Hamburg Commercial Bank AG RegS FRN 22/9/2026 | 1.768.159 | 0,48 |
| EUR 200.000 | Societe Generale SA RegS 0,125% 24/2/2026 | 186.424 | 0,05 | EUR 2.000.000 | IKB Deutsche Industriebank AG RegS FRN 31/1/2028 | 1.935.980 | 0,53 |
| EUR 1.800.000 | Societe Generale SA RegS FRN 23/2/2028 | 1.788.660 | 0,49 | EUR 752.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,000% 10/1/2031 | 656.571 | 0,18 |
| EUR 500.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,01% 2/12/2026 | 468.605 | 0,13 | EUR 673.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,125% 9/1/2032 | 582.475 | 0,16 |
| EUR 1.200.000 | Terega SA RegS 0,875% 17/9/2030 [*] | 966.288 | 0,26 | EUR 281.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,375% 20/5/2036 | 228.636 | 0,06 |
| EUR 1.500.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 29/12/2049 [*] | 1.469.925 | 0,40 | EUR 1.473.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 1,125% 31/3/2037 [*] | 1.322.342 | 0,36 |
| EUR 4.350.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 3.828.522 | 1,04 | EUR 477.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 1,125% 15/6/2037 | 426.586 | 0,12 |
| EUR 600.000 | UNEDIC ASSEO RegS 1,75% 25/11/2032 | 591.786 | 0,16 | EUR 450.000 | Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 0,875% 15/9/2025 | 443.956 | 0,12 |
| EUR 1.600.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 1.397.072 | 0,38 | EUR 2.100.000 | Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 2,20% 9/5/2029 [*] | 1.806.819 | 0,49 |
| | | 45.112.525 | 12,27 | EUR 600.000 | Landesbank Hessen- Thueringen Girozentrale RegS 0,01% 19/7/2027 | 556.182 | 0,15 |
| | Deutschland | | | EUR 500.000 | LANXESS AG RegS 0,625% 1/12/2029 [*] | 411.395 | 0,11 |
| EUR 400.000 | Allianz SE RegS FRN 31/12/2099 [*] | 322.588 | 0,09 | EUR 361.000 | Muenchener Hypothekenbank eG RegS 1,25% 14/2/2030 | 349.538 | 0,10 |
| EUR 400.000 | Allianz SE RegS FRN 31/12/2099 | 331.352 | 0,09 | | | | |
| EUR 3.800.000 | Bayer AG RegS FRN 25/3/2082 | 3.716.780 | 1,01 | | | | |
| EUR 2.600.000 | Bayerische Landesbank RegS FRN 22/11/2032 | 2.290.106 | 0,62 | | | | |
| EUR 512.000 | Berlin Hyp AG RegS 0,01% 24/8/2026 | 482.826 | 0,13 | | | | |
| EUR 2.700.000 | Bertelsmann SE & Co KGaA RegS FRN 23/4/2075 | 2.702.052 | 0,74 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Deutschland Fortsetzung | | | | Italien Fortsetzung | | |
| EUR 3.300.000 | State of North Rhine-Westphalia Germany RegS 0,125% 4/6/2031 | 2.877.996 | 0,78 | EUR 900.000 | Iren SpA RegS 0,25% 17/1/2031 [^] | 703.980 | 0,19 |
| EUR 781.000 | State of North Rhine-Westphalia Germany RegS 0,60% 4/6/2041 | 605.400 | 0,17 | EUR 1.000.000 | Italgas SpA RegS 0,875% 24/4/2030 | 856.100 | 0,23 |
| EUR 670.000 | State of North Rhine-Westphalia Germany RegS 1,95% 26/9/2078 | 603.255 | 0,16 | EUR 1.100.000 | Italgas SpA RegS 1,00% 11/12/2031 | 917.433 | 0,25 |
| EUR 600.000 | UniCredit Bank AG RegS 0,50% 23/2/2027 | 573.078 | 0,16 | EUR 1.225.000 | Snam SpA RegS 15/8/2025 (Zero Coupon) [^] | 1.157.172 | 0,32 |
| EUR 3.000.000 | Volkswagen Financial Services AG RegS 0,375% 12/2/2030 | 2.450.550 | 0,67 | EUR 513.000 | Snam SpA RegS 0,75% 17/6/2030 | 439.077 | 0,12 |
| EUR 609.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,375% 20/7/2026 | 558.691 | 0,15 | EUR 200.000 | UniCredit SpA RegS FRN 16/6/2026 | 191.712 | 0,05 |
| EUR 442.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,50% 12/1/2029 | 381.623 | 0,10 | EUR 1.500.000 | UniCredit SpA RegS 1,625% 18/1/2032 | 1.251.795 | 0,34 |
| EUR 1.158.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,625% 19/7/2029 | 991.931 | 0,27 | | | 17.048.264 | 4,64 |
| EUR 1.200.000 | Vonovia SE RegS 1,00% 16/6/2033 | 911.976 | 0,25 | | Japan | | |
| EUR 2.400.000 | ZF Finance GmbH RegS 2,75% 25/5/2027 [^] | 2.078.952 | 0,57 | EUR 1.500.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2,00% 9/7/2040 [^] | 1.195.530 | 0,32 |
| EUR 900.000 | ZF Finance GmbH RegS 2,25% 3/5/2028 | 745.371 | 0,20 | | | 1.195.530 | 0,32 |
| EUR 600.000 | ZF Finance GmbH RegS 3,75% 21/9/2028 | 529.686 | 0,14 | | Jersey | | |
| | | 50.117.674 | 13,63 | USD 2.000.000 | Aptiv Plc 4,15% 1/5/2052 | 1.487.874 | 0,40 |
| | Ungarn | | | | | 1.487.874 | 0,40 |
| EUR 2.800.000 | Erste Bank Hungary Zrt RegS FRN 4/2/2026 [^] | 2.660.084 | 0,72 | | Luxemburg | | |
| | | 2.660.084 | 0,72 | EUR 1.750.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0,334% 13/8/2028 [^] | 1.525.842 | 0,41 |
| | Irland | | | EUR 600.000 | GELF Bond Issuer I SA RegS 1,625% 20/10/2026 | 558.588 | 0,15 |
| EUR 600.000 | AIB Group Plc RegS 1,50% 29/3/2023 [^] | 603.966 | 0,16 | EUR 600.000 | HeidelbergCement Finance Luxembourg SA RegS 2,50% 9/10/2024 [^] | 608.016 | 0,17 |
| EUR 2.200.000 | AIB Group Plc RegS FRN 4/4/2028 | 2.122.120 | 0,58 | EUR 1.224.000 | Holcim Finance Luxembourg SA RegS 0,625% 19/1/2033 | 927.621 | 0,25 |
| EUR 200.000 | AIB Group Plc RegS FRN 31/12/2099 | 199.520 | 0,06 | EUR 1.800.000 | Medtronic Global Holdings SCA 1,75% 2/7/2049 | 1.356.372 | 0,37 |
| EUR 1.500.000 | Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 25/11/2025 [^] | 1.449.615 | 0,39 | EUR 504.000 | Nestle Finance International Ltd RegS 0,375% 3/12/2040 [^] | 336.380 | 0,09 |
| EUR 251.000 | GAS Networks Ireland RegS 0,125% 4/12/2024 | 241.939 | 0,07 | EUR 925.000 | P3 Group Sarl RegS 1,625% 26/1/2029 | 740.139 | 0,20 |
| EUR 880.000 | Glencore Capital Finance DAC RegS 1,25% 1/3/2033 | 687.165 | 0,19 | EUR 750.000 | Segro Capital Sarl RegS 1,875% 23/3/2030 | 696.218 | 0,19 |
| EUR 1.400.000 | Linde Plc RegS 1,00% 30/9/2051 | 859.362 | 0,23 | EUR 1.417.000 | SES SA RegS FRN 31/12/2099 | 1.278.091 | 0,35 |
| | | 6.163.687 | 1,68 | EUR 2.000.000 | Swiss Re Finance Luxembourg SA RegS FRN 30/4/2050 [^] | 1.805.980 | 0,49 |
| | Italien | | | EUR 2.400.000 | Tratton Finance Luxembourg SA RegS 1,25% 24/3/2033 | 1.876.656 | 0,51 |
| EUR 1.660.000 | ASTM SpA RegS 1,625% 8/2/2028 | 1.502.964 | 0,41 | | | 11.709.903 | 3,18 |
| EUR 2.147.000 | Eni SpA RegS 3,625% 29/1/2029 | 2.298.836 | 0,63 | | Montenegro | | |
| EUR 3.138.000 | Eni SpA RegS FRN 31/12/2099 | 2.769.756 | 0,75 | EUR 601.000 | Montenegro Government International Bond RegS 2,875% 16/12/2027 | 494.229 | 0,13 |
| EUR 529.000 | Eni SpA RegS FRN 31/12/2099 | 468.070 | 0,13 | | | 494.229 | 0,13 |
| EUR 650.000 | Hera SpA RegS 0,25% 3/12/2030 | 516.613 | 0,14 | | Niederlande | | |
| EUR 100.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 2,125% 26/5/2025 | 99.809 | 0,03 | EUR 1.875.000 | Adecco International Financial Services BV RegS 0,125% 21/9/2028 [^] | 1.601.137 | 0,44 |
| EUR 2.415.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,75% 16/3/2028 | 2.141.501 | 0,58 | EUR 172.000 | Athora Netherlands NV RegS FRN 15/7/2031 | 156.255 | 0,04 |
| EUR 413.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,75% 20/3/2028 | 387.034 | 0,11 | EUR 950.000 | BP Capital Markets BV RegS 1,467% 21/9/2041 | 695.771 | 0,19 |
| EUR 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS FRN 31/12/2099 | 190.950 | 0,05 | EUR 1.275.000 | Coloplast Finance BV RegS 2,25% 19/5/2027 | 1.272.157 | 0,35 |
| EUR 1.400.000 | Intesa Sanpaolo Vita SpA RegS 2,375% 22/12/2030 | 1.155.462 | 0,31 | EUR 900.000 | de Volksbank NV RegS FRN 4/5/2027 | 888.570 | 0,24 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|---|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Niederlande Fortsetzung | | | | Neuseeland Fortsetzung | | |
| EUR 600.000 | de Volksbank NV RegS FRN 22/10/2030 | 569.604 | 0,15 | EUR 2.350.000 | Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023 | 2.346.240 | 0,64 |
| EUR 2.625.000 | ELM BV for Firmenich International SA RegS FRN 31/12/2099 | 2.618.857 | 0,71 | NZD 61.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 3,00% 20/9/2030 | 48.318 | 0,01 |
| EUR 1.075.000 | Enel Finance International NV RegS 28/5/2026 (Zero Coupon) [^] | 987.764 | 0,27 | NZD 125.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,50% 20/9/2040 | 94.554 | 0,03 |
| EUR 2.775.000 | Enel Finance International NV RegS 17/6/2027 (Zero Coupon) | 2.484.457 | 0,68 | | | 3.013.645 | 0,82 |
| EUR 1.586.000 | Enel Finance International NV RegS 0,875% 28/9/2034 [^] | 1.208.659 | 0,33 | | Norwegen | | |
| EUR 1.449.000 | Enel Finance International NV RegS 1,125% 17/10/2034 | 1.154.433 | 0,31 | EUR 450.000 | DNB Bank ASA RegS FRN 18/1/2028 | 415.733 | 0,11 |
| EUR 660.000 | Heineken NV RegS 1,75% 7/5/2040 [^] | 525.961 | 0,14 | EUR 500.000 | SpareBank 1 Boligkredit AS RegS 1,75% 11/5/2032 | 489.505 | 0,14 |
| GBP 276.000 | Holcim Sterling Finance Netherlands BV RegS 3,00% 12/5/2032 | 296.025 | 0,08 | | | 905.238 | 0,25 |
| EUR 4.500.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 [^] | 4.174.515 | 1,14 | EUR 775.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 2,75% 25/5/2032 | 775.727 | 0,21 |
| EUR 800.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 802.872 | 0,22 | | | 775.727 | 0,21 |
| EUR 600.000 | ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025 | 574.890 | 0,16 | | Portugal | | |
| EUR 300.000 | ING Groep NV RegS FRN 15/2/2029 | 300.312 | 0,08 | EUR 1.300.000 | EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 20/7/2080 | 1.204.749 | 0,33 |
| EUR 1.700.000 | ING Groep NV RegS FRN 18/2/2029 | 1.472.829 | 0,40 | EUR 1.100.000 | EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 14/3/2082 | 937.343 | 0,25 |
| EUR 1.200.000 | ING Groep NV RegS FRN 16/2/2031 | 1.097.688 | 0,30 | EUR 600.000 | EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 14/3/2082 | 470.610 | 0,13 |
| EUR 2.200.000 | ING Groep NV RegS FRN 26/5/2031 | 2.104.080 | 0,57 | EUR 347.115 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta VII RegS 0,70% 12/2/2024 | 344.426 | 0,09 |
| EUR 2.000.000 | Koninklijke DSM NV RegS 0,625% 23/6/2032 [^] | 1.668.980 | 0,45 | | | 2.957.128 | 0,80 |
| EUR 2.800.000 | Naturgy Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 2.454.816 | 0,67 | | Rumänien | | |
| EUR 221.389 | Netherlands Government Bond RegS 2,75% 15/1/2047 | 274.575 | 0,07 | EUR 300.000 | Romanian Government International Bond RegS 2,125% 7/3/2028 | 264.938 | 0,07 |
| EUR 400.000 | Redexis Gas Finance BV RegS 1,875% 28/5/2025 | 395.540 | 0,11 | | | 264.938 | 0,07 |
| EUR 2.828.000 | Repsol International Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 2.747.289 | 0,75 | | Singapur | | |
| EUR 700.000 | Stellantis NV RegS 1,25% 20/6/2033 | 531.776 | 0,14 | EUR 2.962.000 | DBS Group Holdings Ltd RegS FRN 11/4/2028 | 2.959.179 | 0,80 |
| EUR 300.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 300.900 | 0,08 | | | 2.959.179 | 0,80 |
| EUR 1.375.000 | TenneT Holding BV RegS 0,50% 9/6/2031 | 1.164.075 | 0,32 | | Slowakei | | |
| EUR 2.600.000 | TenneT Holding BV RegS 0,875% 16/6/2035 | 2.049.528 | 0,56 | EUR 425.000 | Slovakia Government Bond RegS 1,00% 13/10/2051 | 283.943 | 0,08 |
| EUR 1.000.000 | TenneT Holding BV RegS 1,125% 9/6/2041 [^] | 734.680 | 0,20 | | | 283.943 | 0,08 |
| EUR 2.250.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3,75% 9/5/2027 | 2.064.555 | 0,56 | | Spanien | | |
| EUR 900.000 | Toyota Motor Finance Netherlands BV RegS 27/10/2025 (Zero Coupon) | 846.405 | 0,23 | EUR 1.300.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 24/3/2026 | 1.269.008 | 0,35 |
| EUR 1.000.000 | Vonovia Finance BV RegS 1,00% 28/1/2041 | 621.590 | 0,17 | EUR 1.000.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 11/3/2027 | 945.930 | 0,26 |
| EUR 1.100.000 | Wintershall Dea Finance 2 BV RegS FRN 31/12/2099 | 884.092 | 0,24 | EUR 1.300.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 16/6/2028 | 1.121.263 | 0,30 |
| | | 41.725.637 | 11,35 | EUR 2.500.000 | Banco de Sabadell SA RegS 2,50% 15/4/2031 | 2.225.475 | 0,61 |
| | Neuseeland | | | EUR 2.000.000 | Banco Santander SA RegS FRN 31/12/2099 | 1.601.740 | 0,44 |
| EUR 610.000 | ASB Finance Ltd RegS 0,25% 21/5/2031 | 524.533 | 0,14 | EUR 1.000.000 | CaixaBank SA RegS 0,375% 3/2/2025 | 962.800 | 0,26 |
| | | | | GBP 1.000.000 | CaixaBank SA RegS FRN 6/4/2028 | 1.147.823 | 0,31 |
| | | | | EUR 600.000 | Cellnex Finance Co SA RegS 1,50% 8/6/2028 | 505.554 | 0,14 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Spanien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| EUR 1.500.000 | Cellnex Finance Co SA RegS 2,00% 15/2/2033 | 1.118.790 | 0,30 | GBP 100.000 | Dignity Finance Plc RegS 4,696% 31/12/2049 | 113.715 | 0,03 |
| EUR 300.000 | Cellnex Telecom SA RegS 1,75% 23/10/2030 | 237.027 | 0,06 | EUR 700.000 | Investec Bank Plc RegS FRN 17/2/2027 | 643.321 | 0,17 |
| | | 11.135.410 | 3,03 | GBP 1.113.000 | Lloyds Bank Plc RegS 7,625% 22/4/2025 [^] | 1.446.098 | 0,39 |
| Supranationale Anleihen | | | | GBP 403.000 | Lloyds Banking Group Plc FRN 15/12/2031 | 427.442 | 0,12 |
| EUR 411.000 | European Investment Bank RegS 1,50% 15/6/2032 | 403.951 | 0,11 | EUR 475.000 | Motability Operations Group Plc RegS 0,125% 20/7/2028 | 420.731 | 0,11 |
| EUR 200.000 | European Union RegS 0,70% 6/7/2051 | 141.344 | 0,04 | EUR 725.000 | Nationwide Building Society RegS 1,125% 31/5/2028 | 702.692 | 0,19 |
| | | 545.295 | 0,15 | EUR 659.000 | Nationwide Building Society RegS 0,25% 14/9/2028 | 573.185 | 0,16 |
| Schweden | | | | EUR 500.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 2/3/2026 | 490.255 | 0,13 |
| EUR 2.100.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS FRN 31/10/2028 | 2.084.103 | 0,57 | GBP 275.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 29/3/2029 | 317.768 | 0,09 |
| EUR 500.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 1,375% 23/2/2029 | 465.120 | 0,13 | EUR 600.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 26/2/2030 | 512.952 | 0,14 |
| EUR 2.025.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS FRN 1/6/2033 | 2.020.889 | 0,55 | GBP 1.650.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 14/8/2030 | 1.882.468 | 0,51 |
| EUR 1.055.000 | Swedbank AB RegS 0,25% 2/11/2026 | 976.497 | 0,26 | GBP 205.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 28/11/2031 | 217.614 | 0,06 |
| EUR 1.200.000 | Swedbank AB RegS 1,30% 17/2/2027 | 1.135.572 | 0,31 | EUR 3.000.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 14/9/2032 | 2.584.440 | 0,70 |
| EUR 834.000 | Volvo Car AB RegS 2,00% 24/1/2025 [^] | 808.188 | 0,22 | GBP 783.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 18/6/2073 | 925.844 | 0,25 |
| | | 7.490.369 | 2,04 | EUR 751.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 5/9/2082 | 658.702 | 0,18 |
| Schweiz | | | | EUR 1.500.000 | OTE Plc RegS 2,375% 18/7/2022 | 1.504.785 | 0,41 |
| EUR 3.083.000 | Credit Suisse AG RegS 0,25% 1/9/2028 | 2.582.691 | 0,70 | EUR 2.300.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 28/2/2025 | 2.245.099 | 0,61 |
| EUR 300.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028 | 263.814 | 0,07 | GBP 875.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 17/1/2029 | 949.559 | 0,26 |
| GBP 800.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 15/11/2029 | 814.157 | 0,22 | EUR 2.600.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 13/9/2029 | 2.237.508 | 0,61 |
| EUR 2.400.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2032 | 2.209.752 | 0,60 | EUR 500.000 | Sky Ltd RegS 2,50% 15/9/2026 | 512.830 | 0,14 |
| EUR 200.000 | UBS Group AG RegS FRN 17/4/2025 | 198.182 | 0,06 | GBP 200.000 | SP Transmission Plc RegS 2,00% 13/11/2031 | 209.540 | 0,06 |
| EUR 1.400.000 | UBS Group AG RegS FRN 29/1/2026 | 1.332.072 | 0,36 | EUR 875.000 | SSE Plc RegS FRN 31/12/2099 | 846.799 | 0,23 |
| EUR 1.300.000 | UBS Group AG RegS FRN 3/11/2026 | 1.213.004 | 0,33 | EUR 416.000 | Tesco Corporate Treasury Services Plc RegS 0,375% 27/7/2029 | 342.098 | 0,09 |
| EUR 4.900.000 | UBS Group AG RegS FRN 5/11/2028 | 4.315.920 | 1,18 | GBP 866.000 | Tesco Corporate Treasury Services Plc RegS 2,75% 27/4/2030 | 938.998 | 0,26 |
| | | 12.929.592 | 3,52 | GBP 138.000 | Travis Perkins Plc RegS 4,50% 7/9/2023 | 161.556 | 0,04 |
| Großbritannien | | | | GBP 280.000 | Yorkshire Building Society RegS FRN 11/10/2030 | 315.392 | 0,09 |
| EUR 1.500.000 | Barclays Plc RegS FRN 9/6/2025 | 1.458.135 | 0,40 | | | 36.614.594 | 9,96 |
| GBP 150.000 | Barclays Plc RegS 3,00% 8/5/2026 | 171.749 | 0,05 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| GBP 484.000 | Bellis Acquisition Co Plc RegS 3,25% 16/2/2026 | 483.055 | 0,13 | EUR 1.650.000 | Air Products and Chemicals Inc 0,80% 5/5/2032 | 1.395.405 | 0,38 |
| EUR 500.000 | BP Capital Markets Plc RegS 1,594% 3/7/2028 | 481.715 | 0,13 | EUR 1.758.000 | American Tower Corp 0,95% 5/10/2030 | 1.447.467 | 0,39 |
| EUR 2.828.000 | BP Capital Markets Plc RegS FRN 31/12/2099 [^] | 2.754.217 | 0,75 | EUR 1.177.000 | American Tower Corp 1,00% 15/1/2032 | 933.514 | 0,25 |
| EUR 1.424.000 | BP Capital Markets Plc RegS FRN 31/12/2099 | 1.330.002 | 0,36 | USD 1.120.000 | American Tower Corp 4,05% 15/3/2032 | 985.040 | 0,27 |
| EUR 3.400.000 | British American Tobacco Plc RegS FRN 31/12/2099 | 2.860.284 | 0,78 | EUR 530.000 | American Tower Corp 1,25% 21/5/2033 [^] | 418.817 | 0,11 |
| EUR 2.325.000 | Cadent Finance Plc RegS 0,625% 19/3/2030 | 1.953.814 | 0,53 | EUR 299.000 | Bank of America Corp RegS FRN 24/8/2028 | 271.391 | 0,07 |
| EUR 1.225.000 | Chanel Ceres Plc RegS 0,50% 31/7/2026 | 1.139.458 | 0,31 | GBP 590.000 | Bank of America Corp RegS FRN 27/4/2031 | 688.617 | 0,19 |
| EUR 1.825.000 | Chanel Ceres Plc RegS 1,00% 31/7/2031 | 1.560.284 | 0,42 | | | | |
| EUR 250.000 | Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050 | 240.490 | 0,07 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | |
| EUR 2.650.000 | Bank of America Corp RegS FRN 27/4/2033 | 2.621.640 | 0,71 | Irland | | | |
| USD 2.000.000 | Citigroup Inc FRN 17/3/2033 | 1.750.733 | 0,48 | EUR 28.331 | iShares EUR Corp Bond 1-5yr UCITS ETF [^] | 2.989.487 | 0,82 |
| EUR 796.000 | Coca-Cola Co 0,375% 15/3/2033 | 633.138 | 0,17 | EUR 17.869 | iShares EUR Corp Bond Large Cap UCITS ETF ⁻ | 2.250.690 | 0,61 |
| EUR 1.845.000 | Coca-Cola Co 0,95% 6/5/2036 | 1.481.389 | 0,40 | | | 5.240.177 | 1,43 |
| EUR 4.000.000 | Eli Lilly & Co 1,375% 14/9/2061 | 2.500.640 | 0,68 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | | |
| EUR 1.100.000 | Equinix Inc 0,25% 15/3/2027 | 987.591 | 0,27 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| EUR 562.000 | Fidelity National Information Services Inc 1,10% 15/7/2024 | 554.829 | 0,15 | | | 341.504.414 | 92,86 |
| EUR 900.000 | Fidelity National Information Services Inc 0,625% 3/12/2025 | 854.523 | 0,23 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| EUR 1.734.000 | Fidelity National Information Services Inc 1,50% 21/5/2027 | 1.654.930 | 0,45 | Irland | | | |
| EUR 150.000 | Fidelity National Information Services Inc 1,00% 3/12/2028 | 134.804 | 0,04 | 74.724 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc) ⁻ | 7.341.297 | 1,99 |
| GBP 810.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4,535% 6/3/2025 | 929.366 | 0,25 | | | 7.341.297 | 1,99 |
| EUR 3.000.000 | General Motors Financial Co Inc RegS 0,65% 7/9/2028 [^] | 2.516.520 | 0,68 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| EUR 2.500.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 2,00% 1/11/2028 [^] | 2.399.500 | 0,65 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | |
| EUR 2.000.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 0,875% 9/5/2029 | 1.758.960 | 0,48 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | |
| GBP 690.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 29/10/2029 | 809.975 | 0,22 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | | |
| EUR 496.000 | International Flavors & Fragrances Inc 1,80% 25/9/2026 | 485.237 | 0,13 | [^] Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. ⁻ Anlagen in Fonds verbundener Parteien. | | | |
| USD 560.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 26/4/2033 | 533.018 | 0,15 | | | | |
| GBP 350.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 28/4/2026 | 384.858 | 0,10 | | | | |
| EUR 3.700.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 23/3/2030 | 3.557.036 | 0,97 | | | | |
| EUR 909.000 | Levi Strauss & Co 3,375% 15/3/2027 | 873.176 | 0,24 | | | | |
| EUR 675.000 | Morgan Stanley FRN 7/5/2032 | 680.613 | 0,19 | | | | |
| EUR 1.775.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 0,993% 15/10/2026 [^] | 1.525.151 | 0,42 | | | | |
| EUR 500.000 | Netflix Inc 4,625% 15/5/2029 | 506.263 | 0,14 | | | | |
| EUR 1.200.000 | Netflix Inc RegS 3,625% 15/6/2030 | 1.137.768 | 0,31 | | | | |
| USD 3.195.000 | Oracle Corp 2,875% 25/3/2031 | 2.527.687 | 0,69 | | | | |
| USD 1.435.000 | Oracle Corp 3,60% 1/4/2050 | 967.546 | 0,26 | | | | |
| EUR 1.800.000 | PepsiCo Inc 0,875% 16/10/2039 [^] | 1.301.886 | 0,35 | | | | |
| EUR 3.500.000 | Thermo Fisher Scientific Inc 1,875% 1/10/2049 | 2.675.225 | 0,73 | | | | |
| USD 134.205 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/2/2052 | 106.900 | 0,03 | | | | |
| EUR 1.500.000 | Verizon Communications Inc 2,625% 1/12/2031 | 1.507.830 | 0,41 | | | | |
| EUR 1.000.000 | Verizon Communications Inc 2,875% 15/1/2038 | 980.540 | 0,27 | | | | |
| | | 47.479.523 | 12,91 | | | | |
| Gesamt Anleihen | | 335.264.354 | 91,16 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Netto(-verlust) EUR |
|--|-------------------------------|----------------------------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | |
| Portugal | | | |
| (39.005) | EDP - Energias de Portugal SA | Bank of America Merrill Lynch | (9.946) |
| | | | (9.946) |
| Schweden | | | |
| (25.671) | Volvo AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (24.010) |
| | | | (24.010) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 602.648) | | | (33.956) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | USD 15.590.000 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.38 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 462.029 | (197.236) |
| CCCDs | EUR 14.550.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (79.014) | 85.194 |
| CCCDs | EUR 8.944.487 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (172.019) | 221.028 |
| CCILS | EUR 494.003 | Fund receives Fixed 2,452% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2038 | (10.456) | (10.439) |
| CCILS | EUR 405.000 | Fund receives Fixed 2,481% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2037 | (7.120) | (7.110) |
| CCILS | GBP 666.000 | Fund receives Fixed 3,500% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2030 | (48.672) | (140.011) |
| CCILS | GBP 306.000 | Fund receives Fixed 3,650% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2031 | (21.562) | (63.540) |
| CCILS | GBP 960.000 | Fund receives Fixed 3,718% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (69.344) | (179.842) |
| CCILS | GBP 200.000 | Fund receives Fixed 3,721% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (14.457) | (37.373) |
| CCILS | GBP 90.000 | Fund receives Fixed 3,730% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2031 | (6.449) | (17.712) |
| CCILS | GBP 930.000 | Fund receives Fixed 3,805% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (68.387) | (163.226) |
| CCILS | GBP 114.000 | Fund receives Fixed 3,810% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (8.391) | (19.931) |
| CCILS | GBP 888.000 | Fund receives Fixed 3,850% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (65.895) | (150.424) |
| CCILS | GBP 300.000 | Fund receives Fixed 3,880% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2031 | (22.221) | (47.283) |
| CCILS | GBP 300.000 | Fund receives Fixed 4,328% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2032 | (18.306) | (18.299) |
| CCILS | EUR 1.130.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,005% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 14.887 | 14.901 |
| CCILS | EUR 227.800 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,080% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 2.234 | 2.099 |
| CCILS | EUR 112.200 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,115% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 883 | 825 |
| CCILS | GBP 450.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,100% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2027 | 6.766 | 6.795 |
| CCILS | GBP 192.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,472% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 3.035 | 3.036 |
| CCILS | GBP 480.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,560% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 6.580 | 6.584 |
| CCILS | GBP 384.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,620% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 4.710 | 4.713 |
| CCILS | GBP 384.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,625% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 4.664 | 4.667 |
| CCILS | GBP 768.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,632% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 9.191 | 9.197 |
| CCILS | GBP 80.000 | Fund receives Fixed 4,262% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Credit Suisse | 15/12/2031 | (6.524) | (6.255) |
| CCIRS | EUR 1.600.000 | Fund receives Fixed 0,088% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (189.144) | (229.821) |
| CCIRS | EUR 2.070.000 | Fund receives Fixed -0,094% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2026 | (115.484) | (129.857) |
| CCIRS | EUR 2.372.848 | Fund receives Fixed -0,134% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/10/2026 | (134.376) | (158.686) |
| CCIRS | EUR 800.000 | Fund receives Fixed 0,180% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (96.122) | (108.716) |
| CCIRS | EUR 467.500 | Fund receives Fixed 0,222% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 19/10/2031 | (58.158) | (64.976) |
| CCIRS | EUR 900.000 | Fund receives Fixed 0,424% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2027 | (43.976) | (43.967) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | EUR 1.404.000 | Fund receives Fixed 0,462% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/10/2026 | (58.476) | (58.462) |
| CCIRS | EUR 500.000 | Fund receives Fixed 0,730% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (44.994) | (44.970) |
| CCIRS | EUR 1.407.812 | Fund receives Fixed 0,745% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 11/3/2052 | (266.003) | (319.466) |
| CCIRS | EUR 549.000 | Fund receives Fixed 0,749% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2046 | (101.508) | (118.592) |
| CCIRS | EUR 244.550 | Fund receives Fixed 0,768% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (20.067) | (20.063) |
| CCIRS | EUR 1.534.500 | Fund receives Fixed 0,784% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (123.945) | (123.922) |
| CCIRS | EUR 8.756.000 | Fund receives Fixed 0,800% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2032 | (818.714) | (816.812) |
| CCIRS | EUR 720.000 | Fund receives Fixed 0,813% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (56.397) | (56.384) |
| CCIRS | EUR 1.130.000 | Fund receives Fixed 0,817% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (88.155) | (88.137) |
| CCIRS | EUR 2.276.000 | Fund receives Fixed 0,825% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (176.191) | (176.156) |
| CCIRS | EUR 1.484.000 | Fund receives Fixed 0,828% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (114.469) | (114.446) |
| CCIRS | EUR 645.000 | Fund receives Fixed 0,840% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (49.139) | (49.129) |
| CCIRS | EUR 1.600.000 | Fund receives Fixed 0,906% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2037 | (228.643) | (228.609) |
| CCIRS | EUR 566.330 | Fund receives Fixed 0,983% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 16/3/2032 | (41.615) | (43.759) |
| CCIRS | EUR 1.498.548 | Fund receives Fixed 1,122% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (59.429) | (85.517) |
| CCIRS | EUR 1.531.000 | Fund receives Fixed 1,331% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (44.539) | (60.481) |
| CCIRS | EUR 3.800.000 | Fund receives Fixed 1,439% and pays Floating EUR 3 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2052 | (303.140) | (304.501) |
| CCIRS | EUR 255.500 | Fund receives Fixed 1,536% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (5.078) | (5.074) |
| CCIRS | GBP 426.532 | Fund receives Fixed 1,541% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 8/4/2052 | (51.149) | (51.142) |
| CCIRS | EUR 255.500 | Fund receives Fixed 1,546% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (4.875) | (4.871) |
| CCIRS | EUR 219.000 | Fund receives Fixed 1,593% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (3.337) | (3.334) |
| CCIRS | EUR 1.083.750 | Fund receives Fixed 1,642% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (14.545) | (14.529) |
| CCIRS | EUR 400.000 | Fund receives Fixed 1,762% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (597) | (591) |
| CCIRS | EUR 3.170.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,474% | Bank of America Merrill Lynch | 8/2/2023 | 534 | 538 |
| CCIRS | EUR 3.170.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,482% | Bank of America Merrill Lynch | 8/2/2023 | 499 | 503 |
| CCIRS | EUR 2.070.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed -0,094% | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2026 | 77.949 | 129.857 |
| CCIRS | EUR 720.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,358% | Bank of America Merrill Lynch | 2/2/2072 | 267.657 | 267.688 |
| CCIRS | EUR 941.037 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,450% | Bank of America Merrill Lynch | 11/3/2072 | 247.111 | 320.755 |
| CCIRS | EUR 421.194 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,533% | Bank of America Merrill Lynch | 4/12/2049 | 111.816 | 113.984 |
| CCIRS | EUR 2.400.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,538% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2027 | 104.166 | 104.189 |
| CCIRS | EUR 260.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,581% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2072 | 77.125 | 77.136 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|---------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | EUR 840.595 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,713% | Bank of America Merrill Lynch | 16/3/2027 | 28.506 | 30.218 |
| CCIRS | EUR 159.375 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,742% | Bank of America Merrill Lynch | 23/4/2052 | 4.149 | 4.153 |
| CCIRS | EUR 159.375 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,749% | Bank of America Merrill Lynch | 23/4/2052 | 4.081 | 4.086 |
| CCIRS | EUR 227.800 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,760% | Bank of America Merrill Lynch | 22/4/2052 | 5.676 | 5.682 |
| CCIRS | EUR 224.400 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,775% | Bank of America Merrill Lynch | 22/4/2052 | 5.422 | 5.381 |
| CCIRS | EUR 3.123.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,797% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2052 | 676.201 | 671.031 |
| CCIRS | EUR 115.313 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,817% | Bank of America Merrill Lynch | 16/3/2052 | 22.454 | 24.246 |
| CCIRS | EUR 3.800.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,400% | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2052 | 283.780 | 285.413 |
| CCIRS | EUR 647.960 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,818% | Bank of America Merrill Lynch | 25/7/2038 | 13.259 | 16.905 |
| CCIRS | GBP 279.197 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,360% | Bank of America Merrill Lynch | 8/4/2072 | 49.319 | 49.339 |
| CCIRS | GBP 70.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,542% | Bank of America Merrill Lynch | 21/4/2072 | 7.619 | 7.624 |
| CDS | EUR 1.500.000 | Fund receives default protection on WPP Finance SA and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 7.774 | 7.774 |
| CDS | EUR 443.000 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 11.747 | 6.814 |
| CDS | EUR 204.937 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 4.128 | 3.152 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 7.079.158) | | | | | (1.405.131) | (2.088.144) |

CCCDs: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps
 CCILS: Zentral abgewickelte inflationsgebundene Swaps
 CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps
 CDS: Credit Default Swaps

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| 4 | GBP | 3 Month SONIA Futures June 2022 | September 2022 | 1.158.130 | 113 |
| 118 | AUD | 90 Day Bank Bill Futures December 2022 | Dezember 2022 | 78.482.153 | (277.394) |
| (736) | EUR | Euro BOBL Futures June 2022 | Juni 2022 | 93.030.400 | 3.961.735 |
| (82) | EUR | Euro BTP Futures June 2022 | Juni 2022 | 10.403.340 | 1.173.523 |
| (498) | EUR | Euro Bund Futures June 2022 | Juni 2022 | 75.442.020 | 4.016.626 |
| (11) | EUR | Euro Bund Futures September 2022 | September 2022 | 1.670.680 | 7.172 |
| (94) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 15.288.160 | 2.995.739 |
| 49 | EUR | Euro Schatz Futures June 2022 | Juni 2022 | 5.394.655 | (59.636) |
| (181) | EUR | Euro-OAT Futures June 2022 | Juni 2022 | 26.067.620 | 763.196 |
| (52) | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2022 | September 2022 | 7.102.068 | 115.423 |
| (63) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 7.549.709 | 78.140 |
| 53 | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 5.906.068 | (36.455) |
| (2) | USD | US Treasury 2 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 393.918 | (641) |
| 77 | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 8.113.864 | 20.664 |
| (27) | USD | US Ultra Bond Futures September 2022 | September 2022 | 3.912.165 | 18.427 |
| Gesamt | | | | | 12.776.632 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|---|-----------|----------------------------------|-----------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 500 | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.900,00 | 17/06/2022 | (365.106) | 604.500 |
| 338 | Put | STOXX Europe 600 Oil & Gas Index | Exchange Traded | EUR 300,00 | 16/12/2022 | (95.992) | 200.265 |
| 11.180.000 | Call | OTC EUR/USD | Morgan Stanley | EUR 1,06 | 04/08/2022 | 47.906 | 258.325 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 16.469.550) | | | | | | (413.192) | 1.063.090 |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|--|---------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| 19.000.000 | Call | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 from 15/6/2022 | Barclays Bank | EUR 0,90 | 15/06/2022 | 8.576 | 39.926 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 9.087.309) | | | | | | 8.576 | 39.926 |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|---|-----------|---|---------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (21.000.000) | Call | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 12/10/2023; and pays 1,37% Fixed annually from 6/4/2023 | Goldman Sachs | EUR 1,37 | 06/04/2023 | 236.699 | (171.751) |
| (21.000.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,37% Fixed annually from 6/4/2023; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 12/10/2023 | Goldman Sachs | EUR 1,37 | 06/04/2023 | (215.779) | (624.229) |
| (19.000.000) | Put | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 from 15/6/2022 | Barclays Bank | EUR 1,10 | 15/06/2022 | 37.660 | (3.684) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 22.348.729) | | | | | | 58.580 | (799.664) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|--------------------------------------|---------|---------|----------|----------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 660.000 | EUR | 445.409 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | (3.832) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-----------|---------|----------|-------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| CNH | 2.700.000 | USD | 411.883 | Citibank | 15/6/2022 | (7.032) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|------------|---------|------------|-------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 87.530 | AUD | 130.000 | Bank of America Merrill Lynch | 14/7/2022 | 553 |
| EUR | 142.032 | AUD | 210.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 1.531 |
| EUR | 280.573 | AUD | 410.000 | Royal Bank of Canada | 14/7/2022 | 6.258 |
| EUR | 4.215.057 | DKK | 31.350.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 1.033 |
| EUR | 350.850 | GBP | 295.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 4.315 |
| EUR | 345.804 | GBP | 295.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (732) |
| EUR | 691.235 | GBP | 590.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (1.836) |
| EUR | 344.945 | GBP | 295.000 | HSBC | 15/6/2022 | (1.590) |
| EUR | 554.923 | GBP | 470.000 | Citibank | 14/7/2022 | 3.606 |
| EUR | 81.599 | GBP | 70.000 | HSBC | 14/7/2022 | (512) |
| EUR | 14.682.615 | GBP | 12.270.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 289.726 |
| EUR | 1.189.857 | GBP | 1.010.000 | Standard Chartered Bank | 14/7/2022 | 5.112 |
| EUR | 718.663 | GBP | 610.000 | UBS | 14/7/2022 | 3.125 |
| EUR | 868.289 | NOK | 8.400.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 36.433 |
| EUR | 105.984 | NOK | 1.020.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 5.104 |
| EUR | 334.097 | NZD | 530.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 13.060 |
| EUR | 81.384 | SEK | 840.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 1.613 |
| EUR | 560.000 | USD | 619.862 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (18.284) |
| EUR | 1.420.000 | USD | 1.562.529 | HSBC | 15/6/2022 | (37.722) |
| EUR | 850.000 | USD | 923.644 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (11.691) |
| EUR | 10.383.569 | USD | 11.340.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | (179.131) |
| EUR | 367.582 | USD | 390.000 | Societe Generale | 14/7/2022 | 4.315 |
| EUR | 193.687 | USD | 210.000 | Standard Chartered Bank | 14/7/2022 | (1.919) |
| GBP | 300.000 | EUR | 353.163 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (755) |
| GBP | 292.500 | EUR | 342.884 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 715 |
| NOK | 8.400.000 | EUR | 853.979 | Natwest Markets | 15/6/2022 | (22.123) |
| NOK | 8.400.000 | USD | 926.917 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (32.888) |
| NZD | 1.800.000 | USD | 1.241.847 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (66.047) |
| USD | 848.658 | CNH | 5.400.000 | Standard Chartered Bank | 15/6/2022 | 37.285 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|---|-----------|---------|-----------|----------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 591.960 | EUR | 560.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (7.745) |
| USD | 1.496.658 | EUR | 1.410.000 | HSBC | 15/6/2022 | (13.730) |
| USD | 908.252 | EUR | 860.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | (12.669) |
| USD | 916.767 | NOK | 8.125.252 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 50.627 |
| USD | 31.003 | NOK | 274.748 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 1.715 |
| USD | 623.703 | NZD | 900.000 | HSBC | 15/6/2022 | 35.616 |
| USD | 587.736 | NZD | 900.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 2.062 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 53.687.264) | | | | | | 83.566 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 44,47 |
| Versorger | 13,21 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 8,29 |
| Zyklische Konsumgüter | 6,29 |
| Energie | 5,37 |
| Kommunikation | 4,26 |
| Staatsanleihen | 3,76 |
| Grundstoffe | 2,45 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 1,99 |
| Technologie | 1,82 |
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 1,43 |
| Industrie | 1,42 |
| Asset Backed Securities (ABS) | 0,09 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 94,85 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 5,15 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Britische Jungferninseln Fortsetzung | | | |
| ANLEIHEN | | | | USD 450.000 | NWD Finance BVI Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 367.181 | 0,01 |
| Australien | | | | USD 417.000 | Peak RE Bvi Holding Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 379.004 | 0,01 |
| EUR 5.454.000 | APA Infrastructure Ltd RegS 0,75% 15/3/2029 [^] | 4.639.772 | 0,11 | USD 450.000 | Sino-Ocean Land Treasure Finance II Ltd RegS 5,95% 4/2/2027 | 312.755 | 0,01 |
| EUR 6.971.000 | APA Infrastructure Ltd RegS 2,00% 15/7/2030 | 6.230.401 | 0,14 | USD 169.476 | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd RegS 6,75% 24/4/2033 | 157.085 | 0,00 |
| EUR 38.800.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd RegS 0,25% 17/3/2025 [^] | 37.718.644 | 0,87 | | | 2.993.456 | 0,07 |
| EUR 6.497.000 | Macquarie Group Ltd RegS 0,35% 3/3/2028 [^] | 5.628.416 | 0,13 | Kanada | | | |
| EUR 34.700.000 | National Australia Bank Ltd RegS 0,625% 16/3/2027 | 33.136.071 | 0,76 | EUR 21.500.000 | Bank of Montreal RegS 1,00% 5/4/2026 | 21.145.250 | 0,49 |
| | | 87.353.304 | 2,01 | EUR 13.100.000 | Bank of Nova Scotia RegS 0,01% 15/12/2027 | 11.966.850 | 0,27 |
| Österreich | | | | EUR 17.900.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce RegS 0,375% 10/3/2026 | 17.202.437 | 0,40 |
| EUR 1.000.000 | ams-OSRAM AG RegS 5/3/2025 (Zero Coupon) | 815.000 | 0,02 | EUR 4.730.000 | CPPIB Capital Inc RegS 0,75% 15/7/2049 | 3.395.851 | 0,08 |
| EUR 500.000 | ams-OSRAM AG RegS 2,125% 3/11/2027 | 402.965 | 0,01 | EUR 12.400.000 | Toronto-Dominion Bank RegS 0,864% 24/3/2027 [^] | 11.992.660 | 0,27 |
| EUR 12.700.000 | BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029 [^] | 12.558.903 | 0,29 | | | 65.703.048 | 1,51 |
| EUR 7.500.000 | Erste Group Bank AG RegS 0,05% 16/9/2025 [^] | 7.052.400 | 0,16 | Kaimaninseln | | | |
| EUR 5.100.000 | Erste Group Bank AG RegS 0,01% 12/7/2028 | 4.620.396 | 0,11 | USD 450.000 | AAC Technologies Holdings Inc RegS 2,625% 2/6/2026 | 371.598 | 0,01 |
| EUR 1.600.000 | Kommunalkredit Austria AG RegS 0,25% 14/5/2024 | 1.548.640 | 0,03 | USD 275.000 | Agile Group Holdings Ltd RegS 5,50% 21/4/2025 | 100.117 | 0,00 |
| EUR 5.300.000 | Raiffeisen Bank International AG RegS 1,50% 24/5/2027 | 5.238.414 | 0,12 | USD 341.000 | China Aoyuan Group Ltd RegS 6,35% 8/2/2024 | 64.999 | 0,00 |
| EUR 50.644.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,90% 20/2/2032 | 47.216.920 | 1,09 | USD 227.000 | China SCE Group Holdings Ltd RegS 7,25% 19/4/2023 | 144.093 | 0,01 |
| EUR 33.567.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 1,85% 23/5/2049 | 32.908.751 | 0,76 | USD 227.000 | Country Garden Holdings Co Ltd RegS 4,20% 6/2/2026 | 134.558 | 0,00 |
| EUR 14.815.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 2,10% 20/9/2117 | 13.784.617 | 0,32 | USD 200.000 | Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 6,95% 17/12/2022 | 20.804 | 0,00 |
| | | 126.147.006 | 2,91 | USD 398.000 | Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 10,875% 9/1/2023 | 44.283 | 0,00 |
| Belgien | | | | USD 630.000 | Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 11,75% 17/4/2023 | 58.810 | 0,00 |
| EUR 5.800.000 | Ageas SA RegS FRN 31/12/2099 | 5.043.912 | 0,12 | USD 227.000 | Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 11,875% 1/6/2023 | 24.731 | 0,00 |
| EUR 2.100.000 | Argenta Spaarbank NV RegS 1,00% 13/10/2026 | 1.965.978 | 0,04 | USD 227.000 | Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 9,25% 28/7/2023 | 24.445 | 0,00 |
| EUR 7.700.000 | Argenta Spaarbank NV RegS FRN 8/2/2029 | 6.916.294 | 0,16 | USD 575.000 | Haidilao International Holding Ltd RegS 2,15% 14/1/2026 | 437.456 | 0,01 |
| EUR 4.300.000 | KBC Group NV RegS FRN 10/9/2026 | 4.008.503 | 0,09 | USD 320.000 | Hilong Holding Ltd RegS 9,75% 18/11/2024 | 181.070 | 0,01 |
| EUR 26.176.141 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 22/10/2031 (Zero Coupon) | 22.494.729 | 0,52 | USD 454.000 | Kaisa Group Holdings Ltd RegS 11,95% 12/11/2023 | 70.775 | 0,00 |
| | | 40.429.416 | 0,93 | USD 200.000 | KWG Group Holdings Ltd RegS 5,875% 10/11/2024 | 52.275 | 0,00 |
| Britische Jungferninseln | | | | USD 260.000 | Logan Group Co Ltd RegS 4,85% 14/12/2026 [^] | 57.036 | 0,00 |
| USD 533.000 | Elect Global Investments Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 478.106 | 0,01 | USD 330.000 | Modern Land China Co Ltd RegS 9,80% 11/4/2023 | 52.369 | 0,00 |
| USD 511.000 | Fortune Star BVI Ltd RegS 6,85% 2/7/2024 | 456.616 | 0,01 | USD 227.000 | Redsun Properties Group Ltd RegS 10,50% 3/10/2022 | 76.230 | 0,00 |
| USD 200.000 | Fortune Star BVI Ltd RegS 5,05% 27/1/2027 | 156.451 | 0,00 | USD 254.000 | Ronshine China Holdings Ltd RegS 7,35% 15/12/2023 | 38.177 | 0,00 |
| USD 340.000 | Greenland Global Investment Ltd RegS 6,75% 26/9/2023 | 95.216 | 0,00 | USD 300.000 | Ronshine China Holdings Ltd RegS 6,75% 5/8/2024 | 43.407 | 0,00 |
| USD 200.000 | Huarong Finance 2017 Co Ltd RegS 4,75% 27/4/2027 | 179.075 | 0,00 | USD 4.670.000 | Seagate HDD Cayman 4,091% 1/6/2029 | 4.140.552 | 0,10 |
| USD 300.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd RegS 3,625% 30/9/2030 [^] | 231.506 | 0,01 | USD 227.000 | Shimao Group Holdings Ltd RegS 3,45% 11/1/2031 | 26.514 | 0,00 |
| USD 315.000 | New Metro Global Ltd RegS 4,80% 15/12/2024 | 180.461 | 0,01 | USD 215.000 | Shui On Development Holding Ltd RegS 5,50% 29/6/2026 | 170.093 | 0,01 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------------|---|------------------------|--------------------|-------------------|--|------------------------|--------------------|
| Kaimaninseln Fortsetzung | | | | Finnland | | | |
| USD 310.000 | Sinic Holdings Group Co Ltd RegS 10,50% 18/6/2022 | 11.575 | 0,00 | EUR 26.638.000 | Finland Government Bond RegS 1,50% 15/9/2032 | 26.144.931 | 0,60 |
| USD 284.000 | Sunac China Holdings Ltd RegS 7,95% 11/10/2023 | 46.395 | 0,00 | EUR 63.311.000 | Finland Government Bond RegS 1,375% 15/4/2047 | 57.305.318 | 1,32 |
| USD 284.000 | Sunac China Holdings Ltd RegS 7,50% 1/2/2024 | 45.069 | 0,00 | EUR 10.250.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,625% 27/7/2027 | 9.316.430 | 0,22 |
| USD 390.000 | Times China Holdings Ltd RegS 6,20% 22/3/2026 | 112.859 | 0,00 | EUR 700.000 | SBB Treasury Oyj RegS 0,75% 14/12/2028 | 496.979 | 0,01 |
| GBP 350.000 | Trafford Centre Finance Ltd RegS FRN 28/7/2035 | 303.875 | 0,01 | EUR 200.000 | SBB Treasury Oyj RegS 1,125% 26/11/2029 | 137.548 | 0,00 |
| USD 284.000 | Yuzhou Group Holdings Co Ltd RegS 7,70% 20/2/2025 | 35.790 | 0,00 | | | 93.401.206 | 2,15 |
| USD 225.000 | Zhenro Properties Group Ltd RegS 7,10% 10/9/2024 | 19.953 | 0,00 | Frankreich | | | |
| | | 6.909.908 | 0,16 | EUR 20.700.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 1,625% 25/5/2032 | 20.124.747 | 0,46 |
| China | | | | EUR 38.300.000 | Agence France Locale RegS 0,20% 20/3/2029 | 34.924.621 | 0,81 |
| EUR 3.214.000 | China Government International Bond RegS 0,50% 12/11/2031 | 2.695.742 | 0,06 | EUR 1.000.000 | Altice France SA RegS 2,125% 15/2/2025 | 922.980 | 0,02 |
| USD 200.000 | Guoren Property & Casualty Insurance Co Ltd RegS 3,35% 1/6/2026 | 174.342 | 0,00 | EUR 1.280.000 | Altice France SA RegS 4,125% 15/1/2029 | 1.074.931 | 0,03 |
| USD 267.000 | ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd RegS 3,125% 16/7/2025 | 230.303 | 0,01 | EUR 733.000 | Altice France SA RegS 4,25% 15/10/2029 | 616.438 | 0,01 |
| USD 250.000 | ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd RegS 3,50% 8/3/2026 | 213.536 | 0,01 | EUR 9.100.000 | Arkea Home Loans SFH SA RegS 1,75% 16/5/2032 | 8.946.028 | 0,21 |
| | | 3.313.923 | 0,08 | EUR 7.120.000 | AXA SA RegS FRN 10/3/2043 | 7.115.158 | 0,16 |
| | | | | EUR 6.600.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,25% 29/6/2028 | 5.864.232 | 0,14 |
| Zypern | | | | USD 300.000 | BNP Paribas SA FRN 29/9/2049^ | 215.224 | 0,01 |
| EUR 1.207.000 | Bank of Cyprus PCL RegS FRN 24/6/2027 | 1.001.267 | 0,02 | EUR 353.554 | BNP Paribas SA 29/10/2049 (Zero Coupon) | 286.379 | 0,01 |
| EUR 25.694.000 | Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023 | 26.667.546 | 0,61 | EUR 8.900.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 15/7/2025^ | 8.654.271 | 0,20 |
| EUR 35.975.000 | Cyprus Government International Bond RegS 2,75% 27/6/2024 | 37.336.294 | 0,86 | GBP 2.500.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 24/5/2031 | 2.679.123 | 0,06 |
| EUR 57.967.000 | Cyprus Government International Bond RegS 0,625% 3/12/2024^ | 56.832.586 | 1,31 | EUR 13.400.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 31/3/2032 | 12.772.612 | 0,29 |
| EUR 36.517.000 | Cyprus Government International Bond RegS 0,95% 20/1/2032 | 31.016.809 | 0,72 | EUR 1.200.000 | BPCE SA RegS 0,625% 26/9/2023 | 1.197.036 | 0,03 |
| | | 152.854.502 | 3,52 | EUR 4.200.000 | BPCE SA RegS 0,125% 4/12/2024^ | 4.086.180 | 0,09 |
| Dänemark | | | | GBP 4.600.000 | BPCE SA RegS FRN 30/11/2032 | 4.881.474 | 0,11 |
| EUR 10.200.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 10/11/2024 | 10.024.764 | 0,23 | EUR 10.000.000 | BPCE SA RegS FRN 13/10/2046 | 7.851.800 | 0,18 |
| EUR 26.700.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 15/5/2031 | 24.099.954 | 0,55 | EUR 13.800.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 21/1/2027^ | 12.887.268 | 0,30 |
| DKK 307.074.665 | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 0,50% 1/10/2050 | 31.930.902 | 0,74 | EUR 16.000.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 10/11/2027 | 14.696.160 | 0,34 |
| DKK 116.661.294 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | 12.882.387 | 0,30 | EUR 19.100.000 | BPCE SFH SA RegS 1,125% 12/4/2030 | 18.179.762 | 0,42 |
| DKK 0 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | — | 0,00 | EUR 7.200.000 | BPCE SFH SA RegS 0,125% 3/12/2030 | 6.250.752 | 0,14 |
| DKK 123.147.783 | Nykredit Realkredit A/S RegS 2,00% 1/10/2053 | 14.442.887 | 0,33 | EUR 9.700.000 | BPCE SFH SA RegS 1,75% 27/5/2032 | 9.529.086 | 0,22 |
| EUR 879.000 | Orsted A/S RegS FRN 9/12/3019^ | 789.781 | 0,02 | EUR 2.331.000 | Casino Guichard Perrachon SA FRN 29/1/2049 | 634.498 | 0,01 |
| DKK 99.194.133 | Realkredit Danmark A/S RegS 0,50% 1/10/2050 | 10.304.352 | 0,24 | EUR 1.100.000 | Casino Guichard Perrachon SA RegS FRN 31/12/2049 | 470.063 | 0,01 |
| | | 104.475.027 | 2,41 | EUR 1.100.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,875% 21/9/2023 | 1.099.010 | 0,03 |
| Estland | | | | EUR 3.600.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,625% 15/3/2024^ | 3.553.956 | 0,08 |
| EUR 5.700.000 | Elering AS RegS 0,875% 3/5/2023 | 5.695.696 | 0,13 | EUR 5.400.000 | Coentreprise de Transport d'Electricite SA RegS 0,875% 29/9/2024 | 5.317.866 | 0,12 |
| | | 5.695.696 | 0,13 | EUR 7.600.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,125% 23/5/2029^ | 6.878.836 | 0,16 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------|---|------------------------|--------------------|----------------|---|------------------------|--------------------|
| | Frankreich Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | |
| EUR 34.900.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA RegS 0,625% 4/3/2027 | 33.523.195 | 0,77 | EUR 1.000.000 | Harmony French Home Loans FCT '2022-1 B' RegS FRN 27/5/2062 | 996.445 | 0,02 |
| EUR 242.914 | E-Carat SA 'B' RegS FRN 20/12/2028 | 242.060 | 0,01 | EUR 12.500.000 | HSBC SFH France SA RegS 0,50% 17/4/2025* | 12.227.125 | 0,28 |
| EUR 60.729 | E-Carat SA 'C' RegS FRN 20/12/2028 | 60.269 | 0,00 | EUR 711.000 | Korian SA RegS FRN 31/12/2099 | 258.953 | 0,01 |
| EUR 60.728 | E-Carat SA 'D' RegS FRN 20/12/2028 | 60.240 | 0,00 | GBP 300.000 | Korian SA RegS FRN 31/12/2099 | 323.395 | 0,01 |
| EUR 91.093 | E-Carat SA 'E' RegS FRN 20/12/2028 | 90.600 | 0,00 | EUR 7.300.000 | La Banque Postale SA RegS FRN 2/8/2032 | 6.198.284 | 0,14 |
| EUR 500.000 | Electricite de France SA RegS 4,50% 12/11/2040 | 557.620 | 0,01 | EUR 920.000 | La Financiere Atalian SASU RegS 4,00% 15/5/2024^ | 821.100 | 0,02 |
| GBP 500.000 | Electricite de France SA RegS FRN 22/7/2049 | 545.320 | 0,01 | GBP 200.000 | La Financiere Atalian SASU RegS 6,625% 15/5/2025 | 208.750 | 0,01 |
| EUR 800.000 | Electricite de France SA RegS 2,00% 9/12/2049 | 553.344 | 0,01 | EUR 3.600.000 | Orange SA RegS 0,75% 29/6/2034 | 2.857.572 | 0,07 |
| GBP 150.000 | Electricite de France SA RegS 5,125% 22/9/2050 | 190.707 | 0,00 | EUR 755.000 | Picard Groupe SAS RegS 3,875% 1/7/2026* | 672.584 | 0,02 |
| EUR 600.000 | Electricite de France SA RegS FRN 31/12/2099^ | 512.610 | 0,01 | EUR 4.500.000 | Schneider Electric SE RegS 12/6/2023 (Zero Coupon)^ | 4.471.380 | 0,10 |
| EUR 1.200.000 | Electricite de France SA RegS FRN 31/12/2099 | 950.460 | 0,02 | EUR 22.500.000 | Societe Du Grand Paris EPIC RegS 1,625% 8/4/2042^ | 19.931.400 | 0,46 |
| GBP 10.500.000 | Electricite de France SA RegS FRN 31/12/2099 | 11.921.597 | 0,28 | EUR 13.000.000 | Societe Generale SA FRN 24/11/2030 | 11.884.600 | 0,27 |
| EUR 3.600.000 | Engie SA RegS 0,375% 26/10/2029 | 3.097.548 | 0,07 | EUR 43.100.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,01% 2/12/2026^ | 40.393.751 | 0,93 |
| EUR 3.600.000 | Engie SA RegS 1,25% 24/10/2041 | 2.500.956 | 0,06 | USD 600.000 | TotalEnergies SE RegS 0,50% 2/12/2022 | 602.381 | 0,01 |
| EUR 7.600.000 | Faurecia SE RegS 2,75% 15/2/2027 | 6.539.572 | 0,15 | EUR 295.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 29/12/2049 | 297.213 | 0,01 |
| EUR 2.500.000 | Faurecia SE RegS 3,75% 15/6/2028 | 2.192.575 | 0,05 | EUR 300.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 244.737 | 0,01 |
| EUR 2.050.410 | FCT Autonoria '2019-1 B' RegS FRN 25/9/2035 | 2.033.292 | 0,05 | EUR 13.500.000 | UNEDIC ASSEO RegS 1,75% 25/11/2032 | 13.315.185 | 0,31 |
| EUR 151.882 | FCT Autonoria '2019-1 C' RegS FRN 25/9/2035 | 150.177 | 0,00 | EUR 3.700.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 3.503.345 | 0,08 |
| EUR 114.083 | FCT Autonoria '2019-1 D' RegS FRN 25/9/2035 | 111.885 | 0,00 | EUR 5.800.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 5.064.386 | 0,12 |
| EUR 151.654 | FCT Autonoria '2019-1 E' RegS FRN 25/9/2035 | 148.034 | 0,00 | EUR 1.400.000 | Verallia SA RegS 1,875% 10/11/2031 | 1.172.500 | 0,03 |
| EUR 151.882 | FCT Autonoria '2019-1 F' RegS FRN 25/9/2035 | 148.572 | 0,00 | | | 450.333.250 | 10,38 |
| EUR 611.333 | FCT Noria '2018-1 B' RegS FRN 25/6/2038 | 609.163 | 0,01 | | Deutschland | | |
| EUR 539.411 | FCT Noria '2018-1 C' RegS FRN 25/6/2038 | 536.056 | 0,01 | EUR 200.000 | ADLER Real Estate AG RegS 1,875% 27/4/2023 | 162.046 | 0,00 |
| EUR 251.725 | FCT Noria '2018-1 D' RegS FRN 25/6/2038 | 248.023 | 0,01 | EUR 200.000 | ADLER Real Estate AG RegS 2,125% 6/2/2024 | 152.228 | 0,00 |
| EUR 269.706 | FCT Noria '2018-1 E' RegS FRN 25/6/2038 | 264.553 | 0,01 | EUR 100.000 | ADLER Real Estate AG RegS 3,00% 27/4/2026 | 73.447 | 0,00 |
| EUR 2.100.000 | FCT Noria '2021-1 C' RegS FRN 25/10/2049 | 2.046.295 | 0,05 | EUR 5.400.000 | Allianz SE RegS FRN 31/12/2099 | 4.354.938 | 0,10 |
| EUR 900.000 | FCT Noria '2021-1 D' RegS FRN 25/10/2049 | 866.730 | 0,02 | EUR 5.200.000 | Allianz SE RegS FRN 31/12/2099 | 4.307.576 | 0,10 |
| EUR 300.000 | FCT Pixel '2021-1 D' RegS FRN 25/2/2038 | 292.016 | 0,01 | EUR 4.400.000 | Bayerische Landesbank RegS FRN 22/11/2032^ | 3.875.564 | 0,09 |
| EUR 28.869.726 | France Government Bond OAT RegS 0,10% 25/7/2038 | 31.167.468 | 0,72 | EUR 17.166.000 | Berlin Hyp AG RegS 0,01% 24/8/2026 | 16.187.881 | 0,37 |
| EUR 1.415.000 | Goldstory SASU RegS 5,375% 1/3/2026^ | 1.287.650 | 0,03 | EUR 7.404.000 | Commerzbank AG RegS 0,50% 15/3/2027 | 7.066.452 | 0,16 |
| EUR 7.423.180 | Harmony French Home Loans FCT '2020-2 A' RegS FRN 27/8/2061 | 7.415.113 | 0,17 | EUR 5.000.000 | Deutsche Bahn Finance GMBH RegS 1,125% 29/5/2051 | 3.476.900 | 0,08 |
| EUR 4.500.000 | Harmony French Home Loans FCT '2020-2 B' RegS FRN 27/8/2061 | 4.516.701 | 0,10 | GBP 9.000.000 | Deutsche Bank AG RegS 2,625% 16/12/2024 | 10.251.828 | 0,24 |
| EUR 7.198.909 | Harmony French Home Loans FCT '2021-1 A' RegS FRN 27/5/2061 | 7.198.952 | 0,17 | GBP 9.000.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/6/2026 | 10.499.001 | 0,24 |
| EUR 600.000 | Harmony French Home Loans FCT '2021-1 B' RegS FRN 27/5/2061 | 598.320 | 0,01 | EUR 9.600.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/5/2028 | 9.566.880 | 0,22 |
| | | | | EUR 300.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 19/5/2031 | 311.133 | 0,01 |
| | | | | EUR 11.200.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/6/2032 | 10.757.376 | 0,25 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------|---|------------------------|--------------------|----------------|---|------------------------|--------------------|
| | Deutschland Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | |
| EUR 400.000 | Deutsche Lufthansa AG RegS 2,875% 11/2/2025 | 389.252 | 0,01 | EUR 102.933 | Red & Black Auto Germany 6 UG 'D' RegS FRN 15/10/2028 | 102.339 | 0,00 |
| EUR 100.000 | Deutsche Lufthansa AG RegS 3,75% 11/2/2028 | 90.753 | 0,00 | EUR 500.000 | Red & Black Auto Germany 8 UG 'B' RegS FRN 15/9/2030 | 493.466 | 0,01 |
| EUR 1.200.000 | Deutsche Lufthansa AG RegS 3,50% 14/7/2029 | 1.039.788 | 0,03 | EUR 400.000 | Red & Black Auto Germany 8 UG 'C' RegS FRN 15/9/2030 | 390.616 | 0,01 |
| EUR 7.300.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 27/10/2025 | 6.797.687 | 0,16 | EUR 100.000 | Red & Black Auto Germany 8 UG 'D' RegS FRN 15/9/2030 | 96.358 | 0,00 |
| EUR 9.600.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,01% 25/8/2026 | 9.044.064 | 0,21 | EUR 29.267.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,60% 4/6/2041^ | 22.686.608 | 0,52 |
| EUR 6.283.000 | Deutsche Telekom AG RegS 1,75% 9/12/2049^ | 4.757.362 | 0,11 | EUR 9.190.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 1,95% 26/9/2078 | 8.274.492 | 0,19 |
| EUR 600.000 | DIC Asset AG RegS 2,25% 22/9/2026 | 488.250 | 0,01 | EUR 3.015.000 | Tele Columbus AG RegS 3,875% 2/5/2025^ | 2.686.365 | 0,06 |
| EUR 20.263.000 | DZ HYP AG RegS 0,01% 26/10/2026 | 19.041.952 | 0,44 | EUR 22.800.000 | UniCredit Bank AG RegS 0,50% 23/2/2027 | 21.776.964 | 0,50 |
| EUR 15.875.000 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 1,875% 31/3/2028 | 14.551.501 | 0,34 | EUR 12.000.000 | Volkswagen Financial Services AG RegS 1,375% 16/10/2023 | 12.037.200 | 0,28 |
| EUR 6.000.000 | Hamburg Commercial Bank AG RegS FRN 22/9/2026 | 5.583.660 | 0,13 | EUR 8.012.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,375% 20/7/2026 | 7.350.129 | 0,17 |
| EUR 180.000 | INEOS Styrolution Group GmbH RegS 2,25% 16/1/2027 | 157.865 | 0,00 | EUR 3.122.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,50% 12/1/2029 | 2.695.535 | 0,06 |
| EUR 25.000.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,01% 5/5/2027 | 23.588.000 | 0,54 | EUR 8.178.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,625% 19/7/2029 | 7.005.193 | 0,16 |
| EUR 25.923.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,000% 10/1/2031 | 22.633.371 | 0,52 | EUR 6.200.000 | Vonovia SE RegS 1,00% 16/6/2033^ | 4.711.876 | 0,11 |
| EUR 24.413.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,125% 9/1/2032 | 21.129.207 | 0,49 | EUR 6.700.000 | ZF Finance GmbH RegS 2,75% 25/5/2027 | 5.803.741 | 0,13 |
| EUR 10.260.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,375% 20/5/2036 | 8.348.049 | 0,19 | EUR 2.500.000 | ZF Finance GmbH RegS 3,75% 21/9/2028 | 2.207.025 | 0,05 |
| EUR 55.966.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 1,125% 31/3/2037^ | 50.241.798 | 1,16 | | | 454.130.771 | 10,47 |
| EUR 15.748.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 1,125% 15/6/2037^ | 14.083.594 | 0,33 | | Griechenland | | |
| EUR 5.750.000 | Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 0,875% 15/9/2025 | 5.672.777 | 0,13 | EUR 10.225.000 | Alpha Bank SA RegS 2,50% 5/2/2023 | 10.359.663 | 0,24 |
| EUR 11.200.000 | Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 2,20% 9/5/2029^ | 9.636.368 | 0,22 | EUR 5.220.000 | Hellenic Republic Government Bond RegS 3,875% 12/3/2029 | 5.506.474 | 0,13 |
| EUR 7.900.000 | Landesbank Hessen- Thueringen Girozentrale RegS 0,01% 19/7/2027 | 7.323.063 | 0,17 | EUR 10.849.000 | Hellenic Republic Government Bond RegS 1,50% 18/6/2030 | 9.443.729 | 0,22 |
| EUR 3.100.000 | LANXESS AG RegS 0,625% 1/12/2029^ | 2.550.649 | 0,06 | EUR 16.730.000 | Hellenic Republic Government Bond RegS 1,875% 24/1/2052 | 10.631.915 | 0,24 |
| EUR 8.700.000 | Merck Financial Services GmbH RegS 0,005% 15/12/2023^ | 8.606.388 | 0,20 | | | 35.941.781 | 0,83 |
| EUR 11.014.000 | Muenchener Hypothekenbank eG RegS 1,25% 14/2/2030^ | 10.664.305 | 0,25 | | Hongkong | | |
| EUR 4.040.000 | Nidda Healthcare Holding GmbH RegS 3,50% 30/9/2024^ | 3.764.391 | 0,09 | USD 250.000 | Bank of East Asia Ltd RegS FRN 22/4/2032 | 233.180 | 0,00 |
| EUR 28.233.000 | NRW Bank RegS 0,25% 26/1/2032 | 24.483.940 | 0,57 | USD 284.000 | Bank of East Asia Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 266.768 | 0,01 |
| EUR 102.934 | Red & Black Auto Germany 6 UG 'C' RegS FRN 15/10/2028 | 101.580 | 0,00 | USD 284.000 | Bank of East Asia Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 267.958 | 0,01 |
| | | | | USD 227.000 | Nanyang Commercial Bank Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 211.997 | 0,00 |
| | | | | USD 250.000 | Nanyang Commercial Bank Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 238.124 | 0,01 |
| | | | | USD 227.000 | Yango Justice International Ltd 10,25% 15/9/2022 | 16.869 | 0,00 |
| | | | | USD 227.000 | Yango Justice International Ltd RegS 8,25% 25/11/2023 | 18.012 | 0,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-----------------------------|---|------------------------|--------------------|----------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Hongkong Fortsetzung | | | | International Fortsetzung | | | |
| USD 284.000 | Yango Justice International Ltd RegS 7,50% 15/4/2024 | 22.534 | 0,00 | EUR 100.000 | Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc RegS 2,125% 15/8/2026 | 88.047 | 0,00 |
| USD 200.000 | Yanlord Land HK Co Ltd RegS 5,125% 20/5/2026 | 164.668 | 0,00 | GBP 400.000 | Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc RegS 4,75% 15/7/2027 | 374.075 | 0,01 |
| | | 1.440.110 | 0,03 | USD 310.000 | Mongolian Mining Corp/Energy Resources LLC RegS 9,25% 15/4/2024 | 200.244 | 0,01 |
| Ungarn | | | | | | 2.261.070 | 0,05 |
| EUR 11.800.000 | Erste Bank Hungary Zrt RegS FRN 4/2/2026 | 11.210.354 | 0,26 | Irland | | | |
| | | 11.210.354 | 0,26 | EUR 12.225.000 | Abbott Ireland Financing DAC RegS 0,10% 19/11/2024 | 11.875.756 | 0,27 |
| Island | | | | GBP 5.182.156 | Agora Securities UK '2021-1X A' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 5.959.134 | 0,14 |
| EUR 3.375.000 | Iceland Government International Bond RegS 0,625% 3/6/2026* | 3.224.239 | 0,07 | EUR 8.775.000 | AIB Group Plc RegS FRN 4/4/2028 | 8.464.365 | 0,20 |
| EUR 3.275.000 | Iceland Government International Bond RegS 15/4/2028 (Zero Coupon) | 2.923.658 | 0,07 | EUR 400.000 | AlbaCore Euro CLO IV DAC 'D' RegS FRN 15/7/2035 | 388.131 | 0,01 |
| | | 6.147.897 | 0,14 | EUR 150.000 | Anchorage Capital Europe CLO '2021-4X E' DAC RegS FRN 25/4/2034 | 127.769 | 0,00 |
| Indien | | | | EUR 150.000 | Aurium CLO II DAC 'ERR' RegS FRN 22/6/2034 | 125.704 | 0,00 |
| USD 227.000 | Adani Green Energy UP Ltd / Prayatna Developers Pvt Ltd / Parampujya Solar Energ RegS 6,25% 10/12/2024 | 212.010 | 0,00 | EUR 100.000 | Avoca CLO XIV DAC '14X ER' RegS FRN 12/1/2031 | 85.367 | 0,00 |
| USD 300.000 | Axis Bank Ltd/Gift City RegS FRN 31/12/2099 | 250.835 | 0,01 | EUR 100.000 | Avoca CLO XIV DAC '14X FR' RegS FRN 12/1/2031 | 81.526 | 0,00 |
| USD 184.000 | JSW Hydro Energy Ltd RegS 4,125% 18/5/2031 | 147.760 | 0,00 | EUR 275.000 | Avoca CLO XIV DAC '14X SUB' RegS 12/1/2031 (Zero Coupon) | 155.548 | 0,00 |
| USD 284.000 | Manappuram Finance Ltd RegS 5,90% 13/1/2023 | 261.797 | 0,01 | EUR 500.000 | Avoca CLO XV DAC '15X FR' RegS FRN 15/4/2031 | 455.242 | 0,01 |
| USD 600.000 | Power Finance Corp Ltd RegS 4,50% 18/6/2029 | 532.458 | 0,01 | USD 1.600.000 | Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 19/9/2027 | 1.485.652 | 0,04 |
| USD 600.000 | Power Finance Corp Ltd RegS 3,90% 16/9/2029 | 511.165 | 0,01 | EUR 150.000 | BBAM European CLO I DAC 'ER' RegS FRN 22/7/2034 | 127.232 | 0,00 |
| USD 284.000 | ReNew Power Synthetic RegS 6,67% 12/3/2024 | 268.502 | 0,01 | EUR 150.000 | BlueMountain EUR '2021-1X E' CLO DAC RegS FRN 15/4/2034 | 126.469 | 0,00 |
| USD 227.000 | Shriram Transport Finance Co Ltd RegS 5,95% 24/10/2022 | 212.034 | 0,00 | EUR 150.000 | Capital Four CLO II DAC 'E' RegS FRN 15/1/2034 | 129.613 | 0,00 |
| USD 341.000 | Shriram Transport Finance Co Ltd RegS 5,10% 16/7/2023 | 311.933 | 0,01 | EUR 150.000 | CIFC European Funding CLO III DAC 'E' RegS FRN 15/1/2034 | 128.732 | 0,00 |
| USD 375.000 | Summit Digitel Infrastructure Pvt Ltd RegS 2,875% 12/8/2031 | 280.382 | 0,01 | EUR 150.000 | CVC Cordatus Loan Fund XX DAC 'E' RegS FRN 22/6/2034 | 124.664 | 0,00 |
| | | 2.988.876 | 0,07 | EUR 10.550.000 | Eaton Capital Unlimited Co RegS 0,128% 8/3/2026 | 9.798.840 | 0,23 |
| Indonesien | | | | EUR 1.600.000 | eircorn Finance DAC RegS '1,75% 1/11/2024' | 1.552.000 | 0,04 |
| USD 227.000 | Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT RegS 4,20% 23/1/2025 | 206.075 | 0,00 | EUR 5.513.000 | Glencore Capital Finance DAC RegS 1,25% 1/3/2033 | 4.304.936 | 0,10 |
| USD 225.000 | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III RegS 4,40% 6/6/2027 | 212.461 | 0,01 | EUR 7.208.917 | Haus European Loan Conduit No 39 DAC 'A1' RegS FRN 28/7/2051 | 6.979.133 | 0,16 |
| | | 418.536 | 0,01 | EUR 1.038.700 | Haus European Loan Conduit No 39 DAC 'B' RegS FRN 28/7/2051 | 1.004.942 | 0,02 |
| International | | | | EUR 840.757 | Haus European Loan Conduit No 39 DAC 'C' RegS FRN 28/7/2051 | 811.646 | 0,02 |
| EUR 445.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc RegS 3,00% 1/9/2029 | 356.253 | 0,01 | | | | |
| USD 200.000 | Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 5,25% 30/4/2025 | 186.535 | 0,00 | | | | |
| EUR 1.200.000 | Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc RegS 2,125% 15/8/2026 | 1.055.916 | 0,02 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------|--|------------------------|--------------------|---------------|--|------------------------|--------------------|
| | Irland Fortsetzung | | | | Irland Fortsetzung | | |
| EUR 969.720 | Haus European Loan Conduit No 39 DAC 'D' RegS FRN 28/7/2051 | 923.658 | 0,02 | GBP 1.602.232 | Taurus '2021-UK1X A' DAC RegS FRN 17/5/2031 | 1.837.234 | 0,04 |
| EUR 150.000 | Invesco Euro CLO '6X E' RegS FRN 15/7/2034 | 130.010 | 0,00 | GBP 879.540 | Taurus '2021-UK1X B' DAC RegS FRN 17/5/2031 | 1.004.394 | 0,02 |
| EUR 236.574 | Invesco Euro Clo III DAC 'F' RegS FRN 15/7/2032 | 210.546 | 0,01 | GBP 536.063 | Taurus '2021-UK1X C' DAC RegS FRN 17/5/2031 | 607.678 | 0,02 |
| EUR 1.349.951 | Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC 'C' RegS FRN 17/8/2033 | 1.303.715 | 0,03 | GBP 546.982 | Taurus '2021-UK1X D' DAC RegS FRN 17/5/2031 | 614.996 | 0,02 |
| EUR 1.021.423 | Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC 'D' RegS FRN 17/8/2033 | 996.653 | 0,02 | GBP 2.611.577 | Taurus '2021-UK4X A' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 3.015.980 | 0,07 |
| EUR 7.387.479 | Last Mile Securities PE '2021- X1 A1' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 7.247.856 | 0,17 | GBP 1.695.469 | Taurus '2021-UK4X C' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 1.896.327 | 0,04 |
| EUR 1.987.591 | Last Mile Securities PE '2021- X1 A2' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 1.953.802 | 0,05 | GBP 562.474 | Taurus '2021-UK4X D' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 617.146 | 0,02 |
| EUR 938.807 | Last Mile Securities PE '2021- X1 B' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 911.769 | 0,02 | GBP 420.000 | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC RegS 4,875% 15/7/2028 | 438.903 | 0,01 |
| EUR 1.060.782 | Last Mile Securities PE '2021- X1 C' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 1.021.002 | 0,02 | EUR 8.135.000 | Vita Scientia '2022-1X A' DAC RegS FRN 27/2/2033 | 8.100.363 | 0,19 |
| EUR 3.700.000 | Linde Plc RegS 1,00% 30/9/2051 | 2.271.171 | 0,05 | | | 124.402.645 | 2,87 |
| EUR 0 | LT Autorahoitus DAC 'A' RegS FRN 18/4/2030 | — | 0,00 | | Italien | | |
| EUR 150.000 | Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO '2021-1X E' RegS FRN 17/4/2034 | 125.040 | 0,00 | EUR 401.217 | Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen Srl 'B' RegS FRN 15/4/2032 | 399.856 | 0,01 |
| EUR 150.000 | Northwoods Capital 21 Euro DAC '2020-21X ER' RegS FRN 22/7/2034 | 125.483 | 0,00 | EUR 197.522 | Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen Srl 'C' RegS FRN 15/4/2032 | 195.893 | 0,01 |
| EUR 150.000 | Northwoods Capital 23 Euro DAC '2021-23X E' RegS FRN 15/3/2034 | 125.048 | 0,00 | EUR 185.177 | Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen Srl 'D' RegS FRN 15/4/2032 | 185.091 | 0,00 |
| EUR 10.238.261 | Pearl Finance '2020-1 A1' DAC RegS FRN 17/11/2032 | 10.256.434 | 0,24 | EUR 61.726 | Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen Srl 'E' RegS FRN 15/4/2032 | 61.937 | 0,00 |
| EUR 1.128.144 | Pearl Finance '2020-1 A2' DAC RegS FRN 17/11/2032 | 1.130.392 | 0,03 | EUR 2.500.000 | ASTM SpA RegS 1,625% 8/2/2028* | 2.263.500 | 0,05 |
| EUR 1.354.717 | Pearl Finance '2020-1 B' DAC RegS FRN 17/11/2032 | 1.333.042 | 0,03 | EUR 7.600.000 | ASTM SpA RegS 2,375% 25/11/2033* | 6.221.740 | 0,14 |
| EUR 150.000 | Providus CLO V DAC 'E' RegS FRN 15/2/2035 | 123.203 | 0,00 | EUR 3.686.697 | AutoFlorence 1 Srl 'A' RegS FRN 25/12/2042 | 3.683.955 | 0,09 |
| EUR 542.512 | River Green Finance '2020-1 B' DAC RegS FRN 22/1/2032 | 540.028 | 0,01 | EUR 529.658 | AutoFlorence 1 Srl 'B' RegS FRN 25/12/2042 | 532.953 | 0,01 |
| EUR 322.575 | River Green Finance '2020-1 C' DAC RegS FRN 22/1/2032 | 320.678 | 0,01 | EUR 898.000 | Autoflorence 2 Srl 'B' RegS FRN 24/12/2044 | 892.112 | 0,02 |
| EUR 150.000 | Rockford Tower Europe CLO '2021-1X E' DAC RegS FRN 20/4/2034 | 126.970 | 0,00 | EUR 414.000 | Autoflorence 2 Srl 'C' RegS FRN 24/12/2044 | 396.704 | 0,01 |
| EUR 1.600.000 | SCF Rahoituspalvelut IX DAC 'B' RegS FRN 25/10/2030 | 1.592.896 | 0,04 | EUR 222.000 | Autoflorence 2 Srl 'D' RegS FRN 24/12/2044 | 216.755 | 0,01 |
| EUR 150.000 | Sound Point Euro CLO V Funding DAC 'E' RegS FRN 25/7/2035 | 124.862 | 0,00 | EUR 400.000 | Autostrade per l'Italia SpA RegS 1,875% 26/9/2029 | 341.108 | 0,01 |
| EUR 1.150.610 | Taurus '2019-1FR A' DAC RegS FRN 2/2/2031 | 1.137.378 | 0,03 | EUR 908.000 | Autostrade per l'Italia SpA RegS 2,00% 15/1/2030 | 774.615 | 0,02 |
| EUR 329.770 | Taurus '2019-1FR B' DAC RegS FRN 2/2/2031 | 325.087 | 0,01 | EUR 1.440.000 | Banco BPM SpA RegS FRN 29/6/2031 | 1.302.696 | 0,03 |
| EUR 307.574 | Taurus '2019-1FR C' DAC RegS FRN 2/2/2031 | 301.914 | 0,01 | EUR 800.000 | Banco BPM SpA RegS 3,375% 19/1/2032 | 721.000 | 0,02 |
| GBP 9.429.042 | Taurus '2019-UK2 A' DAC RegS FRN 17/11/2029 | 10.969.917 | 0,25 | EUR 143.000 | Brignole Co '2021 B' Srl RegS FRN 24/7/2036 | 139.632 | 0,00 |
| GBP 3.342.241 | Taurus '2019-UK2 B' DAC RegS FRN 17/11/2029 | 3.904.380 | 0,09 | EUR 100.000 | Brignole Co '2021 D' Srl RegS FRN 24/7/2036 | 95.349 | 0,00 |
| GBP 2.089.499 | Taurus '2019-UK2 C' DAC RegS FRN 17/11/2029 | 2.444.289 | 0,06 | EUR 2.317.000 | Cassia '2022-1X A' SRL RegS FRN 22/5/2034 | 2.311.497 | 0,05 |
| | | | | EUR 1.108.000 | Cassia '2022-1X B' SRL RegS FRN 22/5/2034 | 1.108.482 | 0,03 |
| | | | | EUR 6.044.000 | Eni SpA RegS FRN 31/12/2099 | 5.755.520 | 0,13 |
| | | | | EUR 993.000 | Eni SpA RegS FRN 31/12/2099 | 878.626 | 0,02 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------------------|--|------------------------|--------------------|------------------|---|------------------------|--------------------|
| Italien Fortsetzung | | | | Luxemburg | | | |
| EUR 1.550.000 | Gamma Bidco SpA RegS 5,125% 15/7/2025 | 1.491.425 | 0,03 | EUR 300.000 | ADLER Group SA RegS 2,00% 23/11/2023 | 205.803 | 0,00 |
| EUR 500.000 | Gamma Bidco SpA RegS 6,25% 15/7/2025 | 492.840 | 0,01 | EUR 900.000 | ADLER Group SA RegS 3,25% 5/8/2025 [^] | 526.950 | 0,01 |
| USD 3.185.000 | Intesa Sanpaolo SpA FRN 1/6/2032 | 2.438.069 | 0,06 | EUR 200.000 | ADLER Group SA RegS 2,75% 13/11/2026 | 111.674 | 0,00 |
| EUR 5.000.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 2,125% 26/5/2025 | 4.990.450 | 0,12 | EUR 300.000 | ADLER Group SA RegS 2,25% 27/4/2027 | 157.995 | 0,00 |
| EUR 2.025.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS FRN 31/12/2099 [^] | 1.933.369 | 0,05 | EUR 1.075.000 | Altice Financing SA RegS 2,25% 15/1/2025 | 1.014.757 | 0,02 |
| EUR 8.500.000 | Intesa Sanpaolo Vita SpA RegS 2,375% 22/12/2030 | 7.015.305 | 0,16 | EUR 2.298.000 | Altice Financing SA RegS 3,00% 15/1/2028 [^] | 1.954.081 | 0,05 |
| EUR 36.499.315 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,30% 15/5/2028 | 39.193.694 | 0,90 | EUR 931.000 | Altice Financing SA RegS 4,25% 15/8/2029 | 803.751 | 0,02 |
| EUR 600.000 | Nexi SpA RegS 24/2/2028 (Zero Coupon) | 457.626 | 0,01 | EUR 200.000 | Altice Finco SA RegS 4,75% 15/1/2028 | 168.500 | 0,00 |
| EUR 3.249.213 | Progetto Quinto Srl 'A' RegS FRN 27/10/2036 | 3.226.306 | 0,07 | EUR 5.668.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0,632% 4/6/2023 | 5.660.915 | 0,13 |
| EUR 599.000 | Red & Black Auto Italy Srl 'D' RegS FRN 28/12/2031 | 575.199 | 0,01 | EUR 4.060.000 | BL Consumer Credit' 2021-1 A' RegS FRN 25/9/2038 | 4.064.672 | 0,09 |
| EUR 4.381.000 | Snam SpA RegS 0,75% 17/6/2030 [^] | 3.749.698 | 0,09 | EUR 528.000 | BL Consumer Credit '2021-1 C' RegS FRN 25/9/2038 | 519.924 | 0,01 |
| EUR 1.974.000 | Snam SpA RegS 1,00% 12/9/2034 | 1.531.271 | 0,04 | EUR 681.000 | BL Consumer Credit '2021-1 D' RegS FRN 25/9/2038 | 670.639 | 0,02 |
| EUR 1.800.000 | Societa Cattolica Di Assicurazione SPA RegS FRN 14/12/2047 | 1.786.572 | 0,04 | EUR 355.000 | BL Consumer Credit '2021-1 E' RegS FRN 25/9/2038 | 349.580 | 0,01 |
| EUR 552.633 | Sunrise SPV Z70 Srl '2019-1 A' RegS FRN 27/5/2044 | 552.761 | 0,01 | EUR 586.777 | Cirsa Finance International Sarl RegS 6,25% 20/12/2023 | 585.298 | 0,01 |
| EUR 1.300.000 | Telecom Italia SpA RegS 1,625% 18/1/2029 | 1.059.500 | 0,03 | EUR 1.340.000 | DH Europe Finance II Sarl 1,35% 18/9/2039 | 1.009.435 | 0,02 |
| EUR 10.100.000 | UniCredit SpA RegS 6,95% 31/10/2022 | 10.350.379 | 0,24 | EUR 1.949.000 | DH Europe Finance II Sarl 1,80% 18/9/2049 | 1.441.734 | 0,03 |
| EUR 14.200.000 | UniCredit SpA RegS FRN 16/6/2026 | 13.611.552 | 0,31 | EUR 60.140.000 | European Financial Stability Facility RegS 19/4/2024 (Zero Coupon) [^] | 59.393.663 | 1,37 |
| EUR 4.900.000 | UniCredit SpA RegS 1,625% 18/1/2032 [^] | 4.089.197 | 0,09 | EUR 1.300.000 | European TopSoho Sarl RegS 4,00% 21/9/2022 | 1.163.123 | 0,03 |
| | | 127.024.234 | 2,93 | EUR 800.000 | FACT Master SA '2021-1 B' RegS FRN 20/7/2028 | 777.814 | 0,02 |
| Japan | | | | EUR 1.083.657 | FACT SA '2018-1 A' RegS 20/11/2025 (Zero Coupon) | 1.083.260 | 0,02 |
| USD 470.000 | Asahi Mutual Life Insurance Co RegS FRN 31/12/2099 | 446.471 | 0,01 | EUR 2.540.000 | Garfunkelux Holdco 3 SA RegS 6,75% 1/11/2025 [^] | 2.411.197 | 0,06 |
| GBP 10.400.000 | Development Bank of Japan Inc RegS 1,25% 31/1/2025 | 11.934.553 | 0,27 | EUR 300.000 | Kleopatra Finco Sarl RegS 4,25% 1/3/2026 | 257.535 | 0,01 |
| EUR 637.000 | Rakuten Group Inc RegS FRN 31/12/2099 | 514.435 | 0,01 | EUR 550.000 | Kleopatra Holdings 2 SCA RegS 6,50% 1/9/2026 | 374.347 | 0,01 |
| EUR 700.000 | SoftBank Group Corp RegS 2,125% 6/7/2024 [^] | 660.170 | 0,02 | EUR 0 | Limes Funding SA - Compartment '2021-1 A' FRN 22/9/2030 | — | 0,00 |
| EUR 529.000 | SoftBank Group Corp RegS 5,00% 15/4/2028 | 481.147 | 0,01 | EUR 5.100.000 | Medtronic Global Holdings SCA 0,25% 2/7/2025 | 4.904.976 | 0,11 |
| EUR 1.686.000 | SoftBank Group Corp RegS 4,00% 19/9/2029 | 1.402.799 | 0,03 | EUR 730.000 | Medtronic Global Holdings SCA 1,125% 7/3/2027 | 704.202 | 0,02 |
| USD 400.000 | SoftBank Group Corp RegS FRN 31/12/2099 | 352.131 | 0,01 | EUR 300.000 | Monitchem HoldCo 3 SA RegS 5,25% 15/3/2025 [^] | 290.520 | 0,01 |
| EUR 2.071.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2,00% 9/7/2040 [^] | 1.650.628 | 0,04 | EUR 1.600.000 | Motion Finco Sarl RegS 7,00% 15/5/2025 | 1.627.520 | 0,04 |
| | | 17.442.334 | 0,40 | EUR 7.525.000 | Nestle Finance International Ltd RegS 0,375% 3/12/2040 [^] | 5.022.335 | 0,12 |
| Jersey | | | | EUR 5.375.000 | P3 Group Sarl RegS 1,625% 26/1/2029 | 4.300.806 | 0,10 |
| USD 6.520.000 | Aptiv Plc 4,15% 1/5/2052 | 4.850.469 | 0,11 | | | | |
| GBP 400.000 | Cornwall Jersey Ltd RegS 0,75% 16/4/2026 | 347.963 | 0,01 | | | | |
| GBP 700.000 | Galaxy Bidco Ltd RegS 6,50% 31/7/2026 | 792.807 | 0,02 | | | | |
| GBP 600.000 | Intu Jersey 2 Ltd RegS 2,875% 1/11/2022 | 174.470 | 0,00 | | | | |
| EUR 787.000 | Kane Bidco Ltd RegS 5,00% 15/2/2027 [^] | 731.997 | 0,02 | | | | |
| | | 6.897.706 | 0,16 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|------------------------------|---|------------------------|--------------------|--------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Luxemburg Fortsetzung | | | | Niederlande Fortsetzung | | | |
| EUR 4.146.040 | SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 B' RegS FRN 14/11/2034 | 4.127.158 | 0,10 | EUR 6.000.000 | de Volksbank NV RegS FRN 4/5/2027 | 5.923.800 | 0,14 |
| EUR 1.884.563 | SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 C' RegS FRN 14/11/2034 | 1.866.712 | 0,04 | EUR 3.600.000 | de Volksbank NV RegS FRN 22/10/2030 | 3.417.624 | 0,08 |
| EUR 1.055.356 | SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 D' RegS FRN 14/11/2034 | 1.042.371 | 0,02 | EUR 4.524.975 | Domi '2021-1 A' BV RegS FRN 15/6/2053 | 4.489.583 | 0,10 |
| EUR 4.450.000 | Segro Capital Sarl RegS 1,875% 23/3/2030 | 4.130.890 | 0,10 | EUR 9.924.000 | Domi '2022-1 A' BV RegS FRN 15/4/2054 | 9.914.937 | 0,23 |
| EUR 7.400.000 | SES SA RegS FRN 31/12/2099 | 6.674.578 | 0,15 | EUR 5.060.756 | Dutch Property Finance '2020-2 A' BV RegS FRN 28/1/2058 | 5.038.116 | 0,12 |
| EUR 3.100.000 | Silver Arrow SA Compartment 10 'B' RegS FRN 15/3/2027 | 3.079.629 | 0,07 | EUR 290.000 | Dutch Property Finance '2020-2 B' BV RegS FRN 28/1/2058 | 288.619 | 0,01 |
| EUR 300.000 | Silver Arrow SA Compartment 10 'C' RegS FRN 15/3/2027 | 298.487 | 0,01 | EUR 6.284.822 | Dutch Property Finance '2021-1 A' BV RegS FRN 28/7/2058 | 6.224.795 | 0,14 |
| EUR 300.000 | Silver Arrow SA Compartment 10 'D' RegS FRN 15/3/2027 | 298.191 | 0,01 | EUR 739.000 | Dutch Property Finance '2021-1 B' BV RegS FRN 28/7/2058 | 728.286 | 0,02 |
| EUR 897.000 | Summer BC Holdco B Sarl RegS 5,75% 31/10/2026 | 871.211 | 0,02 | EUR 820.000 | Dutch Property Finance '2021-2 B' BV RegS FRN 28/4/2059 | 798.431 | 0,02 |
| EUR 6.400.000 | Traton Finance Luxembourg SA RegS 1,25% 24/3/2033 | 5.004.416 | 0,12 | EUR 504.000 | Dutch Property Finance '2021-2 C' BV RegS FRN 28/4/2059 | 484.813 | 0,01 |
| EUR 1.100.000 | Vivion Investments Sarl RegS 3,00% 8/8/2024^ | 997.150 | 0,02 | EUR 3.725.000 | ELM BV for Firmenich International SA RegS FRN 31/12/2099 | 3.716.284 | 0,09 |
| | | 129.947.799 | 3,00 | EUR 13.550.000 | Enel Finance International NV RegS 28/5/2026 (Zero Coupon) | 12.450.417 | 0,29 |
| Malaysia | | | | EUR 7.475.000 | Enel Finance International NV RegS 0,875% 28/9/2034 | 5.696.548 | 0,13 |
| USD 280.000 | Dua Capital Ltd RegS 2,78% 11/5/2031 | 220.570 | 0,00 | EUR 13.800.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 12.801.846 | 0,29 |
| USD 400.000 | Misc Capital Two Labuan Ltd RegS 3,75% 6/4/2027 | 359.195 | 0,01 | EUR 3.500.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 3.512.565 | 0,08 |
| | | 579.765 | 0,01 | EUR 3.600.000 | ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025 | 3.449.340 | 0,08 |
| Mauritius | | | | EUR 14.700.000 | ING Groep NV RegS FRN 18/2/2029^ | 12.735.639 | 0,29 |
| USD 200.000 | CA Magnum Holdings RegS 5,375% 31/10/2026 | 170.595 | 0,00 | EUR 4.900.000 | ING Groep NV RegS FRN 16/2/2031 | 4.482.226 | 0,10 |
| USD 200.000 | Greenko Solar Mauritius Ltd RegS 5,95% 29/7/2026 | 182.607 | 0,00 | EUR 8.000.000 | ING Groep NV RegS FRN 26/5/2031 | 7.651.200 | 0,18 |
| USD 200.000 | Greenko Wind Projects Mauritius Ltd RegS 5,50% 6/4/2025 | 183.151 | 0,01 | EUR 2.542.584 | Jubilee Place '2020-1 A' BV RegS FRN 17/10/2057 | 2.533.933 | 0,06 |
| USD 250.000 | India Green Energy Holdings RegS 5,375% 29/4/2024 | 226.143 | 0,01 | EUR 5.179.043 | Jubilee Place '2021-1 A' BV RegS FRN 17/7/2058 | 5.134.002 | 0,12 |
| USD 511.000 | Network i2i Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 471.682 | 0,01 | EUR 6.014.511 | Jubilee Place 'A' RegS FRN 17/1/2059 | 5.986.393 | 0,14 |
| | | 1.234.178 | 0,03 | EUR 407.000 | Jubilee Place 'B' RegS FRN 17/1/2059 | 399.002 | 0,01 |
| Montenegro | | | | EUR 201.000 | Jubilee Place 'C' RegS FRN 17/1/2059 | 197.081 | 0,00 |
| EUR 2.000.000 | Montenegro Government International Bond RegS 3,375% 21/4/2025^ | 1.860.860 | 0,04 | EUR 300.000 | Just Eat Takeaway.com NV RegS 9/8/2025 (Zero Coupon) | 222.390 | 0,01 |
| EUR 39.793.000 | Montenegro Government International Bond RegS 2,875% 16/12/2027 | 32.723.574 | 0,76 | EUR 200.000 | Just Eat Takeaway.com NV RegS 0,625% 9/2/2028 | 128.296 | 0,00 |
| EUR 4.900.000 | Montenegro Government International Bond RegS 2,55% 3/10/2029 | 3.620.059 | 0,08 | EUR 254.466 | Magoi '2019-1 B' BV RegS FRN 27/7/2039 | 253.435 | 0,01 |
| | | 38.204.493 | 0,88 | EUR 84.758 | Magoi '2019-1 C' BV RegS FRN 27/7/2039 | 84.244 | 0,00 |
| Niederlande | | | | EUR 42.484 | Magoi '2019-1 D' BV RegS FRN 27/7/2039 | 42.253 | 0,00 |
| EUR 6.050.000 | Adecco International Financial Services BV RegS 0,125% 21/9/2028^ | 5.166.337 | 0,12 | EUR 42.483 | Magoi '2019-1 E' BV RegS FRN 27/7/2039 | 42.481 | 0,00 |
| EUR 915.000 | Athora Netherlands NV RegS FRN 15/7/2031^ | 831.241 | 0,02 | EUR 11.000.000 | Naturgy Finance BV RegS FRN 31/12/2099^ | 9.643.920 | 0,22 |
| EUR 8.275.000 | Athora Netherlands NV RegS FRN 31/8/2032 | 8.418.489 | 0,19 | | | | |
| EUR 4.150.000 | Coloplast Finance BV RegS 2,25% 19/5/2027 | 4.140.746 | 0,10 | | | | |
| EUR 12.700.000 | de Volksbank NV RegS 0,75% 25/6/2023 | 12.716.256 | 0,29 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|-----------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Niederlande Fortsetzung | | | | Norwegen Fortsetzung | | | |
| EUR 7.396.700 | Netherlands Government Bond RegS 2,75% 15/1/2047 | 9.173.683 | 0,21 | USD 3.205.000 | Norske Skogindustrier ASA 7,125% 15/10/2033 | 539 | 0,00 |
| EUR 500.000 | Saipem Finance International BV RegS 3,375% 15/7/2026 | 437.280 | 0,01 | EUR 18.240.000 | SpareBank 1 Boligkredit AS RegS 1,75% 11/5/2032 | 17.857.142 | 0,41 |
| EUR 4.200.000 | Silver Arrow Athlon NL '2021-1 A' BV RegS FRN 26/4/2031 | 4.198.742 | 0,10 | EUR 7.200.000 | Telenor ASA RegS 25/9/2023 (Zero Coupon) | 7.121.520 | 0,16 |
| EUR 750.000 | Stellantis NV RegS 2,75% 1/4/2032 | 685.755 | 0,02 | | | 46.643.055 | 1,07 |
| EUR 375.000 | Sudzucker International Finance BV RegS FRN 29/6/2049 | 322.031 | 0,01 | Pakistan | | | |
| EUR 1.048.750 | Summer BidCo BV RegS 9,00% 15/11/2025^ | 975.935 | 0,02 | USD 300.000 | Pakistan Water & Power Development Authority RegS 7,50% 4/6/2031 | 161.027 | 0,00 |
| EUR 3.300.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 3.309.900 | 0,08 | | | 161.027 | 0,00 |
| EUR 7.975.000 | TenneT Holding BV RegS 0,875% 16/6/2035^ | 6.286.533 | 0,14 | Panama | | | |
| EUR 716.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3,75% 9/5/2027 | 656.987 | 0,02 | EUR 1.100.000 | Carnival Corp RegS 10,125% 1/2/2026 | 1.183.325 | 0,03 |
| EUR 6.218.000 | Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1,625% 18/10/2041 | 4.846.744 | 0,11 | | | 1.183.325 | 0,03 |
| EUR 1.067.000 | Titan Holdings II BV RegS 5,125% 15/7/2029 | 932.003 | 0,02 | Philippinen | | | |
| EUR 1.000.000 | Trivium Packaging Finance BV RegS 3,75% 15/8/2026^ | 965.150 | 0,02 | USD 200.000 | Globe Telecom Inc RegS FRN 31/12/2099 | 176.429 | 0,00 |
| EUR 300.000 | United Group BV RegS 4,875% 1/7/2024 | 291.006 | 0,01 | USD 227.000 | Rizal Commercial Banking Corp RegS FRN 31/12/2099 | 205.860 | 0,01 |
| EUR 713.000 | United Group BV RegS 4,625% 15/8/2028 | 605.351 | 0,01 | | | 382.289 | 0,01 |
| EUR 1.178.000 | United Group BV RegS 5,25% 1/2/2030 | 977.540 | 0,02 | Polen | | | |
| EUR 200.000 | Vonovia Finance BV RegS 2,125% 22/3/2030 | 184.908 | 0,00 | EUR 19.025.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 2,75% 25/5/2032 | 19.042.836 | 0,44 |
| EUR 100.000 | Vonovia Finance BV RegS 2,25% 7/4/2030 | 93.117 | 0,00 | | | 19.042.836 | 0,44 |
| EUR 2.700.000 | Vonovia Finance BV RegS 1,00% 28/1/2041 | 1.678.293 | 0,04 | Portugal | | | |
| EUR 1.650.000 | VZ Vendor Financing II BV RegS 2,875% 15/1/2029 | 1.376.579 | 0,03 | EUR 171.317 | Ares Lusitani-STC SA / Pelican Finance 2 'C' RegS FRN 25/1/2035 | 168.559 | 0,00 |
| EUR 1.100.000 | Ziggo BV RegS 2,875% 15/1/2030^ | 923.109 | 0,02 | EUR 1.199.217 | Ares Lusitani-STC SA / Pelican Finance 2 'D' RegS FRN 25/1/2035 | 1.184.080 | 0,03 |
| | | 198.666.214 | 4,58 | EUR 6.500.000 | Caixa Economica Montepio Geral Caixa Economica Bancaria SA RegS 0,875% 17/10/2022 | 6.520.735 | 0,15 |
| Neuseeland | | | | EUR 1.300.000 | EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 14/3/2082 | 1.107.769 | 0,03 |
| EUR 9.270.000 | ASB Finance Ltd RegS 0,25% 21/5/2031 | 7.971.180 | 0,18 | EUR 3.000.000 | EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 14/3/2082^ | 2.353.050 | 0,05 |
| EUR 10.000.000 | Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023 | 9.984.000 | 0,23 | EUR 2.737.066 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 1,00% 12/4/2052 | 1.700.211 | 0,04 |
| NZD 65.107.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,00% 20/9/2025 | 48.803.251 | 1,13 | EUR 500.000 | SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Ulisses Finance No. 1 'B' RegS FRN 20/3/2033 | 501.543 | 0,01 |
| NZD 2.276.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 3,00% 20/9/2030 | 1.802.810 | 0,04 | EUR 55.745 | SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Ulisses Finance No. 1 'A' RegS FRN 20/3/2033 | 55.786 | 0,00 |
| NZD 4.926.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,50% 20/9/2040 | 3.726.182 | 0,09 | EUR 800.000 | SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Ulisses Finance No. 1 'C' RegS FRN 20/3/2033 | 794.770 | 0,02 |
| | | 72.287.423 | 1,67 | EUR 900.000 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Ulisses Finance No. 2 'D' RegS FRN 23/9/2038 | 884.102 | 0,02 |
| Norwegen | | | | EUR 200.000 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Viriato Finance No 1 'B' RegS FRN 28/10/2040 | 197.397 | 0,00 |
| USD 40.000 | DNB Bank ASA FRN 29/8/2049 | 26.327 | 0,00 | | | | |
| EUR 15.100.000 | DNB Bank ASA RegS 0,05% 14/11/2023 | 14.908.230 | 0,34 | | | | |
| EUR 6.350.000 | DNB Bank ASA RegS FRN 18/1/2028^ | 5.866.447 | 0,14 | | | | |
| EUR 1.000.000 | Explorer II AS 3,375% 24/2/2025^ | 862.850 | 0,02 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------|---|------------------------|--------------------|----------------|--|------------------------|--------------------|
| | Portugal Fortsetzung | | | | Spanien Fortsetzung | | |
| EUR 700.000 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Viriato Finance No 1 'C' RegS FRN 28/10/2040 | 668.500 | 0,02 | EUR 2.800.000 | Banco de Sabadell SA RegS 0,875% 22/7/2025 | 2.663.920 | 0,06 |
| EUR 2.039.048 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta VI RegS 1,10% 13/2/2023 | 2.042.851 | 0,05 | EUR 5.400.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 24/3/2026 | 5.271.264 | 0,12 |
| EUR 11.917.608 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta VII RegS 0,70% 12/2/2024 | 11.825.301 | 0,27 | EUR 2.800.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 11/3/2027* | 2.648.604 | 0,06 |
| | | 30.004.654 | 0,69 | EUR 7.100.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 16/6/2028* | 6.123.821 | 0,14 |
| | | | | EUR 13.200.000 | Banco Santander SA RegS FRN 31/12/2099 | 10.571.484 | 0,24 |
| | Rumänien | | | EUR 4.376.625 | BBVA Consumer Auto '2020-1 A' FTA RegS FRN 20/1/2036 6/4/2028 | 4.389.694 | 0,10 |
| EUR 25.225.000 | Romanian Government International Bond RegS 2,125% 7/3/2028 | 22.276.828 | 0,51 | GBP 4.200.000 | CaixaBank SA RegS FRN 6/4/2028 | 4.820.859 | 0,11 |
| EUR 9.877.000 | Romanian Government International Bond RegS 3,624% 26/5/2030* | 9.006.935 | 0,21 | EUR 2.500.000 | Cellnex Finance Co SA RegS 1,50% 8/6/2028 | 2.106.475 | 0,05 |
| | | 31.283.763 | 0,72 | EUR 6.900.000 | Cellnex Finance Co SA RegS 2,00% 15/2/2033 | 5.146.434 | 0,12 |
| | Singapur | | | EUR 500.000 | Cellnex Telecom SA RegS 1,50% 16/1/2026 | 721.225 | 0,02 |
| USD 200.000 | ABJA Investment Co Pte Ltd RegS 5,95% 31/7/2024 | 192.765 | 0,01 | EUR 2.100.000 | Cellnex Telecom SA RegS 1,75% 23/10/2030^ | 1.659.189 | 0,04 |
| USD 200.000 | GLP Pte Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 163.888 | 0,00 | EUR 3.500.000 | Cellnex Telecom SA RegS 0,75% 20/11/2031 | 2.736.650 | 0,06 |
| USD 200.000 | LMIRT Capital Pte Ltd RegS 7,25% 19/6/2024 | 184.831 | 0,01 | EUR 543.000 | Food Service Project SA RegS 5,50% 21/1/2027 | 500.038 | 0,01 |
| USD 200.000 | TML Holdings Pte Ltd RegS 4,35% 9/6/2026 | 171.930 | 0,00 | EUR 2.528.163 | FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 A' RegS FRN 20/3/2033 | 2.527.291 | 0,06 |
| | | 713.414 | 0,02 | EUR 632.041 | FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 B' RegS FRN 20/3/2033 | 618.563 | 0,01 |
| | Südkorea | | | EUR 189.612 | FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 C' RegS FRN 20/3/2033 | 184.910 | 0,00 |
| USD 400.000 | Hana Bank RegS 3,25% 30/3/2027 | 365.401 | 0,01 | EUR 316.020 | FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 D' RegS 3,50% 20/3/2033 | 308.557 | 0,01 |
| USD 450.000 | Shinhan Financial Group Co Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 380.111 | 0,01 | EUR 300.000 | International Consolidated Airlines Group SA RegS 2,75% 25/3/2025 | 279.633 | 0,01 |
| USD 400.000 | Tongyang Life Insurance Co Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 363.594 | 0,01 | EUR 500.000 | International Consolidated Airlines Group SA RegS 1,125% 18/5/2028 | 392.025 | 0,01 |
| | | 1.109.106 | 0,03 | EUR 500.000 | International Consolidated Airlines Group SA RegS 3,75% 25/3/2029 | 414.865 | 0,01 |
| | Spanien | | | EUR 2.190.000 | Kaixo Bondco Telecom SA RegS 5,125% 30/9/2029 | 1.850.572 | 0,04 |
| EUR 273.000 | Almirall SA RegS 2,125% 30/9/2026^ | 260.153 | 0,01 | EUR 680.000 | Lorca Telecom Bondco SA RegS 4,00% 18/9/2027 | 638.758 | 0,02 |
| EUR 313.525 | Autonomia Spain '2019-SP B' RegS FRN 25/12/2035 | 310.490 | 0,01 | EUR 5.300.000 | Santander Consumer Finance SA RegS 1,00% 27/2/2024 | 5.272.811 | 0,12 |
| EUR 261.271 | Autonomia Spain '2019-SP C' RegS FRN 25/12/2032 | 258.129 | 0,01 | EUR 1.397.000 | Tendam Brands SAU RegS 5,00% 15/9/2024* | 1.369.060 | 0,03 |
| EUR 156.763 | Autonomia Spain '2019-SP D' RegS FRN 25/12/2035 | 152.670 | 0,00 | | | 77.865.751 | 1,79 |
| EUR 156.763 | Autonomia Spain '2019-SP E' RegS FRN 25/12/2035 | 152.456 | 0,00 | | Supranationale Anleihen | | |
| EUR 104.508 | Autonomia Spain '2019-SP F' RegS FRN 25/12/2032 | 102.260 | 0,00 | EUR 40.420.000 | European Investment Bank RegS 15/11/2027 (Zero Coupon) | 37.809.272 | 0,87 |
| EUR 7.600.000 | Autonomia Spain 2021 FT 'A' RegS FRN 31/1/2039 | 7.579.035 | 0,18 | EUR 13.234.000 | European Investment Bank RegS 0,05% 15/11/2029 | 11.920.129 | 0,27 |
| EUR 2.300.000 | Autonomia Spain 2021 FT 'B' RegS FRN 31/1/2039 | 2.259.040 | 0,05 | EUR 16.152.000 | European Investment Bank RegS 1,50% 15/6/2032 | 15.874.993 | 0,37 |
| EUR 2.100.000 | Autonomia Spain 2021 FT 'C' RegS FRN 31/1/2039 | 2.027.489 | 0,05 | EUR 9.515.000 | European Stability Mechanism RegS 0,125% 22/4/2024^ | 9.411.858 | 0,22 |
| EUR 900.000 | Autonomia Spain 2021 FT 'D' RegS FRN 31/1/2039 | 867.034 | 0,02 | | | | |
| EUR 500.000 | Autonomia Spain 2021 FT 'E' RegS FRN 31/1/2039 | 486.475 | 0,01 | | | | |
| EUR 200.000 | Autonomia Spain 2021 FT 'F' RegS FRN 31/1/2039 | 193.818 | 0,00 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|-----------------------|--|------------------------|--------------------|
| Supranationale Anleihen Fortsetzung | | | | Großbritannien | | | |
| EUR 7.700.000 | European Union RegS 0,70% 6/7/2051 | 5.441.744 | 0,13 | GBP 732.398 | Albion NO 4 Plc 'A' RegS FRN 17/8/2062 | 862.701 | 0,02 |
| EUR 7.039.000 | International Bank for Reconstruction & Development 0,20% 21/1/2061 | 3.700.754 | 0,08 | GBP 2.911.176 | Atlas Funding '2021-1 A' Plc RegS FRN 25/7/2058 | 3.414.227 | 0,08 |
| | | 84.158.750 | 1,94 | GBP 306.000 | Atlas Funding '2021-1 B' Plc RegS FRN 25/7/2058 | 356.527 | 0,01 |
| Schweden | | | | GBP 100.000 | Atlas Funding '2021-1 C' Plc RegS FRN 25/7/2058 | 115.356 | 0,00 |
| EUR 400.000 | Heimstaden Bostad AB RegS FRN 14/10/2027 | 314.948 | 0,01 | GBP 100.000 | Atlas Funding '2021-1 D' Plc RegS FRN 25/7/2058 | 115.635 | 0,00 |
| EUR 6.800.000 | Kommuninvest I Sverige AB RegS 0,875% 1/9/2029* | 6.443.204 | 0,15 | GBP 764.893 | Auto ABS UK Loans '2019-UK1 A' Plc RegS FRN 27/11/2027 | 898.721 | 0,02 |
| EUR 5.825.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS FRN 1/6/2033 | 5.813.175 | 0,13 | GBP 826.465 | Azure Finance NO 2 Plc 'A' RegS FRN 20/7/2030 | 971.288 | 0,02 |
| EUR 4.844.000 | Swedbank AB RegS 0,25% 2/11/2026 | 4.483.558 | 0,10 | GBP 555.000 | Azure Finance NO 2 Plc 'C' RegS FRN 20/7/2030 | 651.175 | 0,01 |
| EUR 4.550.000 | Swedbank AB RegS 1,30% 17/2/2027 | 4.305.710 | 0,10 | USD 5.600.000 | Barclays Plc FRN 31/12/2099 | 5.340.351 | 0,12 |
| EUR 1.000.000 | Verisure Holding AB RegS 3,50% 15/5/2023* | 995.600 | 0,02 | GBP 1.198.000 | Barley Hill NO 2 Plc 'B' RegS FRN 27/8/2058 | 1.402.294 | 0,03 |
| EUR 648.000 | Verisure Holding AB RegS FRN 15/4/2025* | 647.022 | 0,02 | GBP 286.000 | Barley Hill NO 2 Plc 'C' RegS FRN 27/8/2058 | 333.704 | 0,01 |
| EUR 400.000 | Verisure Holding AB RegS 3,25% 15/2/2027 | 355.800 | 0,01 | GBP 6.121.000 | Bellis Acquisition Co Plc RegS 3,25% 16/2/2026 | 6.109.053 | 0,14 |
| | | 23.359.017 | 0,54 | GBP 300.000 | Bellis Acquisition Co Plc RegS 4,50% 16/2/2026 | 308.320 | 0,01 |
| Schweiz | | | | GBP 100.000 | Bellis Finco Plc RegS 4,00% 16/2/2027 | 90.139 | 0,00 |
| EUR 5.408.000 | Credit Suisse AG RegS 0,25% 5/1/2026 | 4.976.766 | 0,12 | GBP 200.000 | BP Capital Markets Plc RegS 1,00% 28/4/2023 | 252.676 | 0,01 |
| EUR 6.050.000 | Credit Suisse AG RegS 0,25% 1/9/2028 | 5.068.206 | 0,12 | EUR 10.111.000 | BP Capital Markets Plc RegS FRN 31/12/2099 | 9.443.573 | 0,22 |
| GBP 8.860.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 12/9/2025 | 9.998.647 | 0,23 | GBP 3.468.077 | Brass No 10 Plc 'A2' RegS FRN 16/4/2069 | 4.054.300 | 0,09 |
| EUR 25.675.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028 | 22.578.082 | 0,52 | GBP 1.197.000 | Brass NO 6 Plc 'A' RegS FRN 16/12/2060 | 1.406.314 | 0,03 |
| GBP 5.130.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 15/11/2029 | 5.220.785 | 0,12 | GBP 2.615.340 | Brass NO 7 Plc 'A' RegS FRN 16/10/2059 | 3.075.495 | 0,07 |
| EUR 8.600.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2032 | 7.918.278 | 0,18 | GBP 947.084 | Brass NO 8 Plc 'A2' RegS FRN 16/11/2066 | 1.113.541 | 0,03 |
| EUR 9.300.000 | UBS AG RegS 0,01% 29/6/2026 | 8.585.388 | 0,20 | USD 2.400.000 | British Telecommunications Plc FRN 23/11/2081 | 2.036.344 | 0,05 |
| EUR 15.450.000 | UBS Group AG RegS FRN 3/11/2026 | 14.416.086 | 0,33 | EUR 9.325.000 | Cadent Finance Plc RegS 0,625% 19/3/2030 | 7.836.264 | 0,18 |
| | | 78.762.238 | 1,82 | GBP 382.000 | Canada Square Funding '2021- 2 B' Plc RegS FRN 17/6/2058 | 437.849 | 0,01 |
| Thailand | | | | GBP 102.000 | Canada Square Funding '2021- 2 C' Plc RegS FRN 17/6/2058 | 116.847 | 0,00 |
| USD 227.000 | Bangkok Bank PCL RegS FRN 25/9/2034 | 190.392 | 0,00 | GBP 317.000 | Canada Square Funding 'C' RegS FRN 17/1/2059 | 356.659 | 0,01 |
| USD 398.000 | Bangkok Bank PCL RegS FRN 31/12/2099 | 357.136 | 0,01 | GBP 178.000 | Canada Square Funding 'D' RegS FRN 17/1/2059 | 199.391 | 0,00 |
| USD 475.000 | GC Treasury Center Co Ltd RegS 4,40% 30/3/2032 | 421.179 | 0,01 | GBP 300.000 | Canary Wharf Finance II Plc 'C2' RegS FRN 22/10/2037 | 298.787 | 0,01 |
| USD 227.000 | Kasikornbank PCL RegS FRN 2/10/2031 | 194.897 | 0,00 | GBP 2.051.000 | Canary Wharf Finance II Plc 'D2' RegS FRN 22/10/2037 | 2.030.655 | 0,05 |
| USD 398.000 | Kasikornbank PCL RegS FRN 31/12/2099 | 359.966 | 0,01 | EUR 400.000 | Carnival Plc 1,00% 28/10/2029 | 259.606 | 0,01 |
| USD 200.000 | Krung Thai Bank PCL RegS FRN 31/12/2099 | 169.264 | 0,00 | EUR 10.250.000 | Chanel Ceres Plc RegS 1,00% 31/7/2031 | 8.763.237 | 0,20 |
| USD 200.000 | Minor International PCL RegS FRN 31/12/2099 | 172.691 | 0,00 | EUR 5.125.000 | Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050 | 4.930.045 | 0,11 |
| USD 295.000 | Muang Thai Life Assurance PCL RegS FRN 27/1/2037 | 253.060 | 0,01 | GBP 1.625.000 | Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050 | 1.783.136 | 0,04 |
| USD 227.000 | TMBThanachart Bank PCL RegS FRN 31/12/2099 | 202.186 | 0,01 | GBP 2.769.332 | CMF '2020-1 A' Plc RegS FRN 16/1/2057 | 3.236.161 | 0,07 |
| | | 2.320.771 | 0,05 | GBP 220.000 | CMF '2020-1 B' Plc RegS FRN 16/1/2057 | 254.677 | 0,01 |
| Vereinigte Arabische Emirate | | | | | | | |
| USD 700.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC RegS 3,50% 31/3/2027 | 646.091 | 0,01 | | | | |
| | | 646.091 | 0,01 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-----------------------------------|---|------------------------|--------------------|-----------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| GBP 100.000 | CMF '2020-1 C' Plc RegS FRN 16/1/2057 | 115.572 | 0,00 | GBP 669.000 | Gemgarto '2021-1X B' Plc RegS FRN 16/12/2067 | 779.945 | 0,02 |
| GBP 3.404.000 | Dignity Finance Plc RegS 4,696% 31/12/2049 | 3.870.869 | 0,09 | GBP 218.000 | Gemgarto '2021-1X C' Plc RegS FRN 16/12/2067 | 253.015 | 0,01 |
| GBP 1.600.000 | Dowson '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/10/2028 | 1.855.800 | 0,04 | GBP 1.142.896 | Gemgarto '2021-1X X' Plc RegS FRN 16/12/2067 | 1.349.970 | 0,03 |
| GBP 1.300.000 | Dowson '2021-2 C' Plc RegS FRN 20/10/2028 | 1.491.873 | 0,03 | EUR 11.050.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 23/9/2023 (Zero Coupon)^ | 10.942.152 | 0,25 |
| GBP 1.746.143 | Dowson '2022-1 A' Plc RegS FRN 20/1/2029 | 2.047.495 | 0,05 | GBP 4.164.746 | Gosforth Funding '2017-1X A2' Plc RegS FRN 19/12/2059 | 4.895.807 | 0,11 |
| GBP 1.868.000 | Dowson '2022-1 B' Plc RegS FRN 20/1/2029 | 2.188.286 | 0,05 | GBP 3.428.073 | Gosforth Funding '2018-1X A2' Plc RegS FRN 25/8/2060 | 4.036.146 | 0,09 |
| GBP 407.000 | Dowson '2022-1 C' Plc RegS FRN 20/1/2029 | 469.348 | 0,01 | GBP 1.000.000 | Greene King Finance Plc FRN 15/12/2034 | 973.628 | 0,02 |
| GBP 213.000 | Dowson '2022-1 D' Plc RegS FRN 20/1/2029 | 241.975 | 0,01 | GBP 2.612.789 | Greene King Finance Plc RegS FRN 15/12/2033 | 2.935.630 | 0,07 |
| EUR 1.625.000 | EC Finance Plc RegS 3,00% 15/10/2026 | 1.523.600 | 0,04 | GBP 1.615.000 | Greene King Finance Plc RegS 3,593% 15/3/2035^ | 1.828.891 | 0,04 |
| GBP 4.696.000 | E-Carat 12 Plc 'A' RegS FRN 18/8/2029 | 5.483.999 | 0,13 | GBP 849.655 | Greene King Finance Plc RegS 4,064% 15/3/2035 | 980.416 | 0,02 |
| GBP 1.166.667 | Economic Master Issuer '2020- 1X A1' Plc RegS FRN 25/6/2072 | 1.369.012 | 0,03 | GBP 741.000 | Harben Finance '2017-1RX C' RegS FRN 28/9/2055 | 825.693 | 0,02 |
| GBP 4.444.000 | Economic Master Issuer Plc '2021-1X A' RegS FRN 25/6/2073 | 5.168.357 | 0,12 | GBP 441.000 | Harben Finance '2017-1RX D' RegS FRN 28/9/2055 | 488.347 | 0,01 |
| EUR 230.000 | eG Global Finance Plc RegS 3,625% 7/2/2024^ | 220.225 | 0,01 | GBP 3.329.782 | Hops Hill No 1 Plc 'A' RegS FRN 27/5/2054 | 3.892.906 | 0,09 |
| EUR 300.000 | eG Global Finance Plc RegS 4,375% 7/2/2025 | 284.112 | 0,01 | GBP 345.980 | Hops Hill No 1 Plc 'B' RegS FRN 27/5/2054 | 403.882 | 0,01 |
| EUR 722.000 | eG Global Finance Plc RegS 6,25% 30/10/2025^ | 696.716 | 0,02 | GBP 199.992 | Hops Hill No 1 Plc 'C' RegS FRN 27/5/2054 | 232.334 | 0,01 |
| GBP 2.237.622 | Elvet Mortgages '2018-1 A' Plc RegS FRN 22/10/2058 | 2.630.593 | 0,06 | GBP 99.997 | Hops Hill No 1 Plc 'D' RegS FRN 27/5/2054 | 116.609 | 0,00 |
| GBP 3.000.527 | Elvet Mortgages '2021-1 A' Plc FRN 22/10/2063 | 3.505.766 | 0,08 | USD 230.000 | HSBC Bank Plc FRN 29/6/2049 | 171.030 | 0,00 |
| GBP 155.000 | Finsbury Square '2019-2 C' Plc RegS FRN 16/9/2069 | 181.923 | 0,00 | USD 920.000 | HSBC Bank Plc FRN 29/6/2049 | 683.750 | 0,02 |
| GBP 145.000 | Finsbury Square '2019-2 D' Plc RegS FRN 16/9/2069 | 169.965 | 0,00 | USD 600.000 | HSBC Bank Plc FRN 30/9/2049 | 445.874 | 0,01 |
| GBP 1.023.318 | Finsbury Square '2019-3 A' Plc RegS FRN 16/12/2069 | 1.201.446 | 0,03 | EUR 19.200.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 24/9/2029^ | 16.572.288 | 0,38 |
| GBP 348.998 | Finsbury Square '2019-3 C' Plc RegS FRN 16/12/2069 | 409.066 | 0,01 | EUR 1.500.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc RegS 2,20% 15/1/2024^ | 1.418.910 | 0,03 |
| GBP 2.075.247 | Finsbury Square '2020-1X A' Plc RegS FRN 16/3/2070 | 2.429.548 | 0,06 | GBP 3.618.428 | Jupiter Mortgage NO 1 Plc 'A' RegS FRN 20/7/2060 | 4.217.887 | 0,10 |
| GBP 214.960 | Finsbury Square '2020-1X C' Plc RegS FRN 16/3/2070 | 250.379 | 0,01 | GBP 3.092.712 | Kenrick NO 3 Plc 'A' RegS FRN 11/10/2054 | 3.632.609 | 0,08 |
| GBP 1.354.419 | Finsbury Square '2020-2X A' Plc RegS FRN 16/6/2070 | 1.592.924 | 0,04 | GBP 4.108.200 | Lanark Master Issuer Plc '2017- 1X 2A' RegS FRN 22/12/2069 | 4.830.239 | 0,11 |
| GBP 7.132.972 | Finsbury Square '2021-1GRX AGRN' RegS FRN 16/12/2067 | 8.127.207 | 0,19 | GBP 6.900.000 | Lanark Master Issuer Plc '2018- 1X 2A' RegS FRN 22/12/2069 | 8.103.610 | 0,19 |
| GBP 3.573.000 | Finsbury Square '2021-1GRX B' RegS FRN 16/12/2067 | 4.053.401 | 0,09 | GBP 1.099.000 | Lanark Master Issuer Plc '2020- 1X 2A' RegS FRN 22/12/2069 | 1.291.894 | 0,03 |
| GBP 1.045.000 | Finsbury Square '2021-1GRX C' RegS FRN 16/12/2067 | 1.163.635 | 0,03 | GBP 8.248.121 | Lanebrook Mortgage Transaction '2020-1 A1' Plc RegS FRN 12/6/2057 | 9.671.209 | 0,22 |
| GBP 371.000 | Finsbury Square '2021-2X C' Plc RegS FRN 16/12/2071 | 412.314 | 0,01 | GBP 630.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2020-1 B' Plc RegS FRN 12/6/2057 | 742.755 | 0,02 |
| GBP 201.000 | Finsbury Square '2021-2X D' Plc RegS FRN 16/12/2071 | 221.765 | 0,01 | GBP 370.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2020-1 C' Plc RegS FRN 12/6/2057 | 434.300 | 0,01 |
| GBP 10.155.786 | Gemgarto '2018-1 A' Plc RegS FRN 16/9/2065 | 11.941.915 | 0,28 | GBP 266.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2021-1 B' Plc Regs FRN 20/7/2058 | 302.561 | 0,01 |
| GBP 1.585.629 | Gemgarto '2018-1 B' Plc RegS FRN 16/9/2065 | 1.857.206 | 0,04 | GBP 159.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2021-1 C' Plc Regs FRN 20/7/2058 | 178.051 | 0,00 |
| GBP 654.847 | Gemgarto '2018-1 C' Plc RegS FRN 16/9/2065 | 769.034 | 0,02 | | | | |
| GBP 234.945 | Gemgarto '2018-1 D' Plc RegS FRN 16/9/2065 | 275.740 | 0,01 | | | | |
| GBP 5.850.153 | Gemgarto '2021-1X A' Plc RegS FRN 16/12/2067 | 6.840.588 | 0,16 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-----------------------------------|--|------------------------|--------------------|-----------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| GBP 103.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2021-1 D' Plc Regs FRN 20/7/2058 | 115.807 | 0,00 | GBP 1.096.000 | Ocado Group Plc RegS 3,875% 8/10/2026 [^] | 1.059.652 | 0,02 |
| GBP 20.517.000 | LCR Finance Plc RegS 4,50% 7/12/2028 | 27.524.827 | 0,63 | GBP 648.345 | Orbita Funding '2020-1 A' Plc RegS FRN 17/3/2027 | 761.402 | 0,02 |
| GBP 13.388.000 | Lloyds Bank Plc RegS 7,625% 22/4/2025 | 17.394.752 | 0,40 | EUR 12.670.000 | OTE Plc RegS 0,875% 24/9/2026 [^] | 12.241.501 | 0,28 |
| GBP 4.562.000 | Lloyds Banking Group Plc FRN 15/12/2031 | 4.838.683 | 0,11 | EUR 701.169 | Paragon Mortgages No 12 Plc 'A2B' RegS 15/11/2038 (Zero Coupon) | 675.531 | 0,02 |
| GBP 3.297.849 | London Wall Mortgage Capital Plc '2021-FL1 A' RegS FRN 15/5/2051 | 3.826.440 | 0,09 | GBP 5.617.860 | Paragon Mortgages No 25 Plc 'A' RegS FRN 15/5/2050 | 6.581.770 | 0,15 |
| GBP 934.000 | Market Bidco Finco Plc RegS 5,50% 4/11/2027 | 952.175 | 0,02 | GBP 975.000 | Paragon Mortgages No 25 Plc 'B' RegS FRN 15/5/2050 | 1.138.529 | 0,03 |
| GBP 600.000 | Marks & Spencer Plc RegS 4,25% 8/12/2023 | 702.415 | 0,02 | GBP 770.000 | Paragon Mortgages No 25 Plc 'C' RegS FRN 15/5/2050 | 898.176 | 0,02 |
| GBP 107.312 | Metrocentre Finance Plc 8,75% 6/12/2023 | 64.593 | 0,00 | GBP 5.730.000 | PCL Funding IV Plc '2020-1 A' RegS FRN 15/9/2024 | 6.734.969 | 0,16 |
| GBP 2.080.000 | Mitchells & Butlers Finance Plc RegS 6,469% 15/9/2030 | 2.567.108 | 0,06 | GBP 605.000 | PCL Funding IV Plc '2020-1 B' RegS FRN 15/9/2024 | 710.640 | 0,02 |
| GBP 955.000 | Mitchells & Butlers Finance Plc RegS FRN 15/9/2034 | 898.380 | 0,02 | GBP 230.000 | PCL Funding IV Plc '2020-1 C' RegS FRN 15/9/2024 | 270.362 | 0,01 |
| GBP 1.165.000 | Mitchells & Butlers Finance Plc RegS FRN 15/6/2036 | 1.110.989 | 0,03 | GBP 4.402.000 | PCL Funding V Plc '2021-1 A' RegS FRN 15/10/2025 | 5.155.411 | 0,12 |
| GBP 4.783.560 | Mortimer BTL '2021-1 A' Plc RegS FRN 23/6/2053 | 5.478.440 | 0,13 | GBP 486.000 | PCL Funding V Plc '2021-1 B' RegS FRN 15/10/2025 | 564.160 | 0,01 |
| GBP 334.000 | Mortimer BTL '2021-1 B' Plc RegS FRN 23/6/2053 | 384.591 | 0,01 | GBP 115.000 | PCL Funding V Plc '2021-1 C' RegS FRN 15/10/2025 | 133.631 | 0,00 |
| GBP 110.000 | Mortimer BTL '2021-1 C' Plc RegS FRN 23/6/2053 | 124.757 | 0,00 | GBP 5.305.000 | Penarth Master Issuer Plc '2018-1X A2' RegS FRN 18/3/2025 | 6.232.901 | 0,14 |
| GBP 172.606 | Motor '2016-1 D' Plc RegS 4,25% 25/11/2025 | 202.931 | 0,00 | GBP 2.973.750 | Permanent Master Issuer Plc '2019-1X 1A2' RegS FRN 15/7/2058 | 3.495.261 | 0,08 |
| GBP 285.000 | Motor '2016-1 E' Plc RegS 5,25% 25/11/2025 | 334.164 | 0,01 | GBP 1.815.000 | Polaris '2022-1 B' Plc RegS FRN 23/10/2059 | 2.115.750 | 0,05 |
| EUR 5.575.000 | National Grid Plc RegS 2,949% 30/3/2030 | 5.560.226 | 0,13 | GBP 421.000 | Polaris '2022-1 C' Plc RegS FRN 23/10/2059 | 488.005 | 0,01 |
| EUR 12.500.000 | National Westminster Bank Plc RegS 0,50% 15/5/2024 | 12.358.250 | 0,28 | GBP 307.000 | Polaris '2022-1 D' Plc RegS FRN 23/10/2059 | 358.081 | 0,01 |
| EUR 6.598.000 | Nationwide Building Society RegS 0,25% 14/9/2028 | 5.738.808 | 0,13 | GBP 538.000 | Polaris '2022-1 E' Plc RegS FRN 23/10/2059 | 621.806 | 0,01 |
| GBP 3.330.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 29/3/2029 | 3.847.884 | 0,09 | GBP 4.453.000 | Precise Mortgage Funding '2019-1B A2' Plc RegS FRN 12/12/2055 | 5.230.523 | 0,12 |
| GBP 19.747.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 14/8/2030 | 22.529.155 | 0,52 | GBP 115.000 | Precise Mortgage Funding '2020-1B B' Plc RegS FRN 16/10/2056 | 133.615 | 0,00 |
| GBP 6.873.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 28/11/2031 | 7.295.901 | 0,17 | GBP 100.000 | Precise Mortgage Funding '2020-1B C' Plc RegS FRN 16/10/2056 | 116.012 | 0,00 |
| USD 1.877.000 | Neptune Energy Bondco Plc 6,625% 15/5/2025 [^] | 1.733.971 | 0,04 | GBP 100.000 | Precise Mortgage Funding '2020-1B D' Plc RegS FRN 16/10/2056 | 115.714 | 0,00 |
| GBP 3.121.000 | Newday Funding Master Issuer Plc '2021-1X A1' RegS FRN 15/3/2029 | 3.643.932 | 0,08 | GBP 127.318 | Premiertel Plc 6,175% 8/5/2032 | 160.862 | 0,00 |
| GBP 775.000 | Newday Funding Master Issuer Plc '2021-1X B' RegS FRN 15/3/2029 | 903.000 | 0,02 | GBP 5.200.000 | Prs Finance Plc RegS 2,00% 23/1/2029 | 5.941.244 | 0,14 |
| GBP 677.000 | Newday Funding Master Issuer Plc '2021-3X B' RegS FRN 15/11/2029 | 787.680 | 0,02 | GBP 4.360.146 | Residential Mortgage Securities 32 Plc 'A' RegS FRN 20/6/2070 | 5.125.449 | 0,12 |
| GBP 6.800.000 | Newday Partnership Funding '2017-1 A' Plc RegS FRN 15/12/2027 | 7.965.982 | 0,18 | GBP 525.000 | Residential Mortgage Securities 32 Plc 'C' RegS FRN 20/6/2070 | 611.874 | 0,01 |
| EUR 295.759 | Newgate Funding Plc '2006-1 BB' RegS 1/12/2050 (Zero Coupon) | 294.071 | 0,01 | GBP 3.969.947 | RMAC NO 2 Plc '2018-2 A' RegS FRN 12/6/2046 | 4.664.428 | 0,11 |
| GBP 9.683.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 18/6/2073 | 11.449.491 | 0,26 | GBP 410.000 | RMAC NO 2 Plc '2018-2 B' RegS FRN 12/6/2046 | 482.118 | 0,01 |
| EUR 1.536.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 5/9/2082 [^] | 1.347.226 | 0,03 | GBP 420.000 | RMAC NO 2 Plc '2018-2 C' RegS FRN 12/6/2046 | 493.531 | 0,01 |
| GBP 8.817.521 | Oat Hill NO 2 Plc 'A' RegS FRN 27/5/2046 | 10.352.573 | 0,24 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------|---|------------------------|--------------------|---------------|--|------------------------|--------------------|
| | Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | |
| EUR 2.032.873 | RMAC Securities No 1 Plc '2006-NS1X M1C' RegS 12/6/2044 (Zero Coupon) | 1.976.611 | 0,05 | GBP 382.999 | Tower Bridge Funding '2021-1 B' Plc RegS FRN 21/7/2064 | 448.300 | 0,01 |
| GBP 3.345.000 | Sage AR Funding No 1 Plc 'A' RegS FRN 17/11/2030 | 3.901.461 | 0,09 | GBP 364.999 | Tower Bridge Funding '2021-1 C' Plc RegS FRN 21/7/2064 | 427.788 | 0,01 |
| GBP 1.085.000 | Sage AR Funding No 1 Plc 'B' RegS FRN 17/11/2030 | 1.256.252 | 0,03 | GBP 253.000 | Tower Bridge Funding '2021-1 D' Plc RegS FRN 21/7/2064 | 295.980 | 0,01 |
| GBP 535.000 | Sage AR Funding No 1 Plc 'C' RegS FRN 17/11/2030 | 625.321 | 0,01 | GBP 3.020.113 | Tower Bridge Funding '2021-2 A' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 3.521.351 | 0,08 |
| EUR 13.400.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 28/2/2025 | 13.080.142 | 0,30 | GBP 252.999 | Tower Bridge Funding '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 287.936 | 0,01 |
| GBP 12.170.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 17/11/2029 | 13.207.011 | 0,30 | GBP 139.999 | Tower Bridge Funding '2021-2 C' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 158.584 | 0,00 |
| EUR 8.175.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 13/9/2029 | 7.035.241 | 0,16 | GBP 168.999 | Tower Bridge Funding '2021-2 D' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 191.602 | 0,00 |
| GBP 123.000 | Satus '2021-1 D' Plc RegS FRN 17/8/2028 | 139.560 | 0,00 | GBP 4.357.000 | Tower Bridge Funding '2022-1X A' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 5.037.466 | 0,12 |
| GBP 247.000 | Satus '2021-1 E' Plc RegS FRN 17/8/2028 | 284.954 | 0,01 | GBP 378.000 | Tower Bridge Funding '2022-1X B' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 429.400 | 0,01 |
| GBP 500.000 | Sherwood Financing Plc RegS 6,00% 15/11/2026 | 514.689 | 0,01 | GBP 264.000 | Tower Bridge Funding '2022-1X C' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 297.525 | 0,01 |
| GBP 5.433.641 | Silk Road Finance Number Six Plc '2019-2 A' RegS FRN 21/9/2067 | 6.394.294 | 0,15 | GBP 422.000 | Travis Perkins Plc RegS 4,50% 7/9/2023 | 494.032 | 0,01 |
| GBP 4.441.500 | Silverstone Master Issuer Plc '2018-1X 2A' RegS FRN 21/1/2070 | 5.218.392 | 0,12 | GBP 4.739.551 | Turbo Finance 9 Plc 'A' RegS FRN 20/8/2028 | 5.569.556 | 0,13 |
| GBP 4.500.000 | Silverstone Master Issuer Plc '2020-1X 1A' RegS FRN 21/1/2070 | 5.284.038 | 0,12 | GBP 1.594.000 | Turbo Finance 9 Plc 'B' RegS FRN 20/8/2028 | 1.858.704 | 0,04 |
| USD 5.195.000 | Standard Chartered Plc RegS FRN 23/3/2025 | 4.619.513 | 0,11 | GBP 4.671.113 | Twin Bridges '2018-1 A' Plc RegS FRN 12/9/2050 | 5.478.812 | 0,13 |
| GBP 924.000 | Stanlington No 2 Plc 'A' RegS FRN 12/6/2056 | 1.075.378 | 0,02 | GBP 1.685.000 | Twin Bridges '2018-1 B' Plc RegS FRN 12/9/2050 | 1.965.211 | 0,05 |
| GBP 2.261.000 | Stanlington No 2 Plc 'B' RegS FRN 12/6/2056 | 2.608.833 | 0,06 | GBP 3.483.000 | Twin Bridges '2018-1 C' Plc RegS FRN 12/9/2050 | 4.069.315 | 0,09 |
| GBP 280.000 | Stanlington No 2 Plc 'C' RegS FRN 12/6/2056 | 316.244 | 0,01 | GBP 2.040.000 | Twin Bridges '2018-1 D' Plc RegS FRN 12/9/2050 | 2.368.575 | 0,05 |
| GBP 259.000 | Stanlington No 2 Plc 'D' RegS FRN 12/6/2056 | 290.170 | 0,01 | GBP 1.910.695 | Twin Bridges '2019-1 A' Plc RegS FRN 12/12/2052 | 2.246.522 | 0,05 |
| GBP 450.000 | Stanlington No 2 Plc 'E' RegS FRN 12/6/2056 | 506.640 | 0,01 | GBP 385.000 | Twin Bridges '2019-1 B' Plc RegS FRN 12/12/2052 | 452.439 | 0,01 |
| GBP 1.741.000 | Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc RegS 8,25% 31/7/2025 | 2.004.458 | 0,05 | GBP 550.000 | Twin Bridges '2019-1 C' Plc RegS FRN 12/12/2052 | 646.570 | 0,01 |
| GBP 950.000 | Stonegate Pub Co Financing Plc RegS 8,00% 13/7/2025 | 1.091.080 | 0,03 | GBP 1.620.078 | Twin Bridges '2019-2 A' Plc RegS FRN 12/6/2053 | 1.905.337 | 0,04 |
| GBP 245.000 | Telereal Securitisation Plc FRN 10/9/2031 | 243.415 | 0,01 | GBP 1.196.000 | Twin Bridges '2019-2 B' Plc RegS FRN 12/6/2053 | 1.404.792 | 0,03 |
| GBP 496.719 | Tesco Property Finance 1 Plc RegS 7,623% 13/7/2039 | 737.191 | 0,02 | GBP 565.000 | Twin Bridges '2019-2 C' Plc RegS FRN 12/6/2053 | 663.265 | 0,02 |
| GBP 4.590.355 | Tesco Property Finance 3 Plc RegS 5,744% 13/4/2040 | 5.999.326 | 0,14 | GBP 250.000 | Twin Bridges '2019-2 D' Plc RegS FRN 12/6/2053 | 293.184 | 0,01 |
| GBP 1.321.612 | Tesco Property Finance 4 Plc RegS 5,801% 13/10/2040 | 1.728.590 | 0,04 | GBP 5.939.959 | Twin Bridges '2020-1 A' Plc RegS FRN 12/12/2054 | 6.987.426 | 0,16 |
| GBP 156.000 | Together Asset Backed Securitisation '2021-1ST1 B' Plc RegS FRN 12/7/2063 | 176.974 | 0,00 | GBP 1.145.000 | Twin Bridges '2020-1 B' Plc RegS FRN 12/12/2054 | 1.343.349 | 0,03 |
| GBP 107.000 | Together Asset Backed Securitisation '2021-1ST1 C' Plc RegS FRN 12/7/2063 | 120.531 | 0,00 | GBP 390.000 | Twin Bridges '2020-1 C' Plc RegS FRN 12/12/2054 | 452.038 | 0,01 |
| GBP 3.641.486 | Tower Bridge Funding '2020-1 A' Plc RegS FRN 20/9/2063 | 4.289.814 | 0,10 | GBP 225.000 | Twin Bridges '2020-1 D' Plc RegS FRN 12/12/2054 | 264.465 | 0,01 |
| GBP 695.000 | Tower Bridge Funding '2020-1 B' Plc RegS FRN 20/9/2063 | 819.505 | 0,02 | GBP 4.012.045 | Twin Bridges '2021-1 A' Plc RegS FRN 12/3/2055 | 4.648.590 | 0,11 |
| GBP 145.000 | Tower Bridge Funding '2020-1 C' Plc RegS FRN 20/9/2063 | 170.962 | 0,00 | GBP 1.310.000 | Twin Bridges '2021-1 B' Plc RegS FRN 12/3/2055 | 1.483.820 | 0,03 |
| GBP 115.000 | Tower Bridge Funding '2020-1 D' Plc RegS FRN 20/9/2063 | 136.147 | 0,00 | | | | |
| GBP 5.261.245 | Tower Bridge Funding '2021-1 A' Plc RegS FRN 21/7/2064 | 6.176.905 | 0,14 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------------------|--|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| GBP 436.000 | Twin Bridges '2021-1 C' Plc RegS FRN 12/3/2055 | 489.029 | 0,01 | GBP 4.390.000 | Bank of America Corp RegS FRN 2/6/2029 | 4.668.375 | 0,11 |
| GBP 220.000 | Twin Bridges '2021-1 D' Plc RegS FRN 12/3/2055 | 246.645 | 0,01 | GBP 6.960.000 | Bank of America Corp RegS FRN 27/4/2031 | 8.123.342 | 0,19 |
| GBP 986.000 | Twin Bridges '2021-2 B' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 1.099.139 | 0,03 | EUR 7.800.000 | Bank of America Corp RegS FRN 27/4/2033 | 7.716.526 | 0,18 |
| GBP 435.000 | Twin Bridges '2021-2 C' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 488.473 | 0,01 | EUR 2.556.000 | Becton Dickinson and Co 1,401% 24/5/2023 | 2.567.553 | 0,06 |
| GBP 187.000 | Twin Bridges '2021-2 D' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 204.793 | 0,00 | EUR 23.768.000 | Booking Holdings Inc 0,10% 8/3/2025 | 22.721.970 | 0,52 |
| GBP 244.563 | Twin Bridges '2021-2 X1' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 286.876 | 0,01 | USD 5.000.000 | Cargo Aircraft Management Inc 4,75% 1/2/2028 | 4.538.974 | 0,11 |
| GBP 8.725.000 | Twin Bridges '2022-1 A' Plc RegS FRN 1/12/2055 | 10.020.479 | 0,23 | USD 5.857.000 | Citigroup Inc FRN 25/1/2033 | 4.834.970 | 0,11 |
| GBP 2.097.000 | Twin Bridges '2022-1 B' Plc RegS FRN 1/12/2055 | 2.354.668 | 0,05 | USD 14.600.000 | Citigroup Inc FRN 17/3/2033 | 12.780.350 | 0,29 |
| GBP 830.000 | Twin Bridges '2022-1 C' Plc RegS FRN 1/12/2055 | 922.281 | 0,02 | EUR 2.172.000 | Coca-Cola Co 0,375% 15/3/2033 | 1.727.609 | 0,04 |
| GBP 365.000 | Twin Bridges '2022-1 D' Plc RegS FRN 1/12/2055 | 402.150 | 0,01 | EUR 3.879.000 | Coca-Cola Co 0,95% 6/5/2036 | 3.114.531 | 0,07 |
| GBP 187.789 | Unique Pub Finance Co Plc RegS 7,395% 28/3/2024 | 228.569 | 0,01 | EUR 6.812.000 | Coca-Cola Co 1,10% 2/9/2036 | 5.542.924 | 0,13 |
| GBP 897.173 | Unique Pub Finance Co Plc RegS 5,659% 30/6/2027 | 1.121.386 | 0,03 | EUR 951.000 | Comcast Corp 14/9/2026 (Zero Coupon) | 877.326 | 0,02 |
| GBP 371.000 | Unique Pub Finance Co Plc RegS 6,464% 30/3/2032 | 493.702 | 0,01 | USD 6.500.000 | Commercial Metals Co 4,875% 15/5/2023 | 6.159.209 | 0,14 |
| GBP 1.784.000 | Very Group Funding Plc RegS 6,50% 1/8/2026^ | 1.767.310 | 0,04 | USD 4.414.000 | Delta Air Lines '2019-1 AA' Pass Through Trust 3,204% 25/4/2024 | 4.050.414 | 0,09 |
| GBP 1.813.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc RegS 4,00% 31/1/2029^ | 1.833.878 | 0,04 | EUR 17.846.000 | Eli Lilly & Co 1,375% 14/9/2061 | 11.156.605 | 0,26 |
| EUR 1.300.000 | Vodafone Group Plc RegS FRN 27/8/2080 | 1.109.953 | 0,03 | GBP 528.000 | Encore Capital Group Inc RegS 4,25% 1/6/2028 | 546.496 | 0,01 |
| GBP 3.425.000 | Yorkshire Building Society RegS FRN 11/10/2030 | 3.857.921 | 0,09 | EUR 3.235.000 | Fidelity National Information Services Inc 0,75% 21/5/2023 | 3.232.412 | 0,07 |
| | | 645.839.978 | 14,89 | USD 5.500.000 | FirstEnergy Transmission LLC 4,35% 15/1/2025 | 5.135.049 | 0,12 |
| | | | | USD 6.500.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3,35% 1/11/2022 | 6.098.260 | 0,14 |
| | | | | USD 6.500.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3,087% 9/1/2023 | 6.045.853 | 0,14 |
| | | | | GBP 9.746.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4,535% 6/3/2025 | 11.182.221 | 0,26 |
| | | | | USD 4.000.000 | GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,25% 1/6/2025 | 3.731.085 | 0,09 |
| | | | | USD 9.000.000 | GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,375% 15/4/2026 | 8.432.609 | 0,19 |
| | | | | USD 1.000.000 | GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,30% 15/1/2029 | 925.003 | 0,02 |
| | | | | USD 5.312.000 | Goldman Sachs Group Inc FRN 24/2/2033 | 4.405.010 | 0,10 |
| | | | | EUR 9.425.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 30/4/2024 | 9.330.467 | 0,22 |
| | | | | EUR 12.500.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 0,875% 9/5/2029 | 10.993.500 | 0,25 |
| | | | | GBP 8.250.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 29/10/2029 | 9.684.485 | 0,22 |
| | | | | USD 1.015.000 | Gray Oak Pipeline LLC 2,00% 15/9/2023 | 929.462 | 0,02 |
| | | | | USD 7.010.000 | Gray Oak Pipeline LLC 2,60% 15/10/2025 | 6.193.384 | 0,14 |
| | | | | USD 5.970.000 | Intercontinental Exchange Inc 4,60% 15/3/2033 | 5.687.537 | 0,13 |
| | | | | EUR 9.606.000 | International Flavors & Fragrances Inc 1,80% 25/9/2026 | 9.397.550 | 0,22 |
| | | | | USD 15.379.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 26/4/2026 | 14.422.768 | 0,33 |
| | | | | USD 10.136.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 25/1/2033 | 8.448.563 | 0,20 |
| | | | | USD 3.315.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 26/4/2033 | 3.155.277 | 0,07 |
| | | | | GBP 5.330.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 28/4/2026 | 5.860.839 | 0,14 |
| | | | | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | | |
| EUR 11.050.000 | Air Products and Chemicals Inc 0,80% 5/5/2032 | 9.344.985 | 0,22 | | | | |
| USD 2.776.000 | Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC 3,50% 15/2/2023 | 2.592.661 | 0,06 | | | | |
| USD 6.404.778 | American Airlines '2013-2 A' Pass Through Trust 4,95% 15/1/2023 | 5.971.974 | 0,14 | | | | |
| USD 2.612.255 | American Airlines '2015-2 B' Pass Through Trust 4,40% 22/9/2023 | 2.352.017 | 0,05 | | | | |
| USD 3.733.938 | American Airlines '2016-3 AA' Pass Through Trust 3,00% 15/10/2028 | 3.180.078 | 0,07 | | | | |
| USD 5.214.261 | American Airlines '2017-2 B' Pass Through Trust 3,70% 15/10/2025 | 4.468.518 | 0,10 | | | | |
| EUR 876.000 | American Tower Corp 0,95% 5/10/2030 | 721.263 | 0,02 | | | | |
| EUR 520.000 | American Tower Corp 1,00% 15/1/2032 | 412.428 | 0,01 | | | | |
| USD 3.300.000 | American Tower Corp 4,05% 15/3/2032 | 2.902.349 | 0,07 | | | | |
| EUR 1.562.000 | American Tower Corp 1,25% 21/5/2033 | 1.234.324 | 0,03 | | | | |
| USD 2.000.000 | Amkor Technology Inc 6,625% 15/9/2027 | 1.857.289 | 0,04 | | | | |
| USD 9.497.000 | Bank of America Corp FRN 27/4/2028 | 8.935.117 | 0,21 | | | | |
| USD 4.841.000 | Bank of America Corp FRN 27/4/2033 | 4.566.957 | 0,11 | | | | |
| USD 14.438.000 | Bank of America Corp FRN 31/12/2099 | 11.892.292 | 0,27 | | | | |
| EUR 5.751.000 | Bank of America Corp RegS FRN 24/8/2028 | 5.219.970 | 0,12 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---|---|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| EUR 5.950.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 11/3/2027 | 5.710.810 | 0,13 | USD 4.666.222 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/2/2052 | 3.716.844 | 0,09 |
| EUR 10.925.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 23/3/2030 | 10.502.869 | 0,24 | USD 1.887.000 | VICI Properties LP 4,375% 15/5/2025 | 1.758.068 | 0,04 |
| USD 11.750.000 | Kraft Heinz Foods Co 5,00% 4/6/2042 | 10.499.013 | 0,24 | USD 5.357.000 | VICI Properties LP 4,75% 15/2/2028 | 4.966.396 | 0,11 |
| USD 1.345.000 | Level 3 Financing Inc 3,75% 15/7/2029 | 1.063.476 | 0,02 | USD 3.812.000 | VICI Properties LP 4,95% 15/2/2030 | 3.491.365 | 0,08 |
| EUR 3.639.000 | Levi Strauss & Co 3,375% 15/3/2027 | 3.495.587 | 0,08 | EUR 703.000 | WMG Acquisition Corp RegS 2,25% 15/8/2031 | 583.202 | 0,01 |
| USD 7.438.000 | Lowe's Cos Inc 1,70% 15/10/2030 | 5.730.860 | 0,13 | | | 483.072.018 | 11,13 |
| USD 2.895.000 | Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC 4,10% 15/5/2028 | 2.668.955 | 0,06 | Gesamt Anleihen | | 3.897.384.011 | 89,83 |
| EUR 14.700.000 | Morgan Stanley FRN 26/7/2024 | 14.620.473 | 0,34 | BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | |
| USD 17.332.000 | Morgan Stanley FRN 17/4/2025 | 16.170.279 | 0,37 | Irland | | | |
| USD 4.107.000 | Morgan Stanley FRN 20/4/2028 | 3.843.387 | 0,09 | EUR 17.247 | iShares Core EUR Corp Bond UCITS ETF [^] | 2.095.166 | 0,05 |
| EUR 8.290.000 | Morgan Stanley FRN 7/5/2032 | 8.358.931 | 0,19 | EUR 338.413 | iShares EUR Corp Bond 1-5yr UCITS ETF [^] | 35.709.340 | 0,82 |
| USD 1.329.000 | Morgan Stanley FRN 21/1/2033 | 1.104.890 | 0,03 | EUR 22.992 | iShares EUR High Yield Corp Bond UCITS ETF [^] | 2.124.001 | 0,05 |
| EUR 5.550.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 0,993% 15/10/2026 | 4.768.782 | 0,11 | USD 300.744 | iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF [^] | 12.784.955 | 0,30 |
| EUR 8.800.000 | National Grid North America Inc RegS 0,75% 8/8/2023 [^] | 8.770.168 | 0,20 | USD 5.174 | iShares JP Morgan USD EM Bond UCITS ETF 'D' [^] | 436.620 | 0,01 |
| EUR 3.000.000 | Netflix Inc 4,625% 15/5/2029 | 3.037.581 | 0,07 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | 53.150.082 | 1,23 |
| EUR 7.300.000 | Netflix Inc RegS 3,625% 15/6/2030 | 6.921.422 | 0,16 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 3.950.534.093 | 91,06 |
| USD 21.500.000 | NextEra Energy Operating Partners LP 4,25% 15/7/2024 | 20.101.122 | 0,46 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| USD 12.800.000 | Oracle Corp 2,875% 25/3/2031 | 10.126.571 | 0,23 | Irland | | | |
| USD 18.550.000 | Oracle Corp 3,60% 1/4/2050 | 12.507.309 | 0,29 | 601.792 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc) ⁻ | 59.123.152 | 1,36 |
| USD 2.030.000 | T-Mobile USA Inc 2,70% 15/3/2032 | 1.631.375 | 0,04 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 59.123.152 | 1,36 |
| USD 5.000.000 | Trans-Allegheny Interstate Line Co 3,85% 1/6/2025 | 4.652.500 | 0,11 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 4.009.657.245 | 92,42 |
| USD 1.846.624 | United Airlines '2014-1 A' Pass Through Trust 4,00% 11/4/2026 | 1.663.246 | 0,04 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 328.950.527 | 7,58 |
| USD 1.720.145 | United Airlines '2014-2 B' Pass Through Trust 4,625% 3/9/2022 | 1.608.306 | 0,04 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 4.338.607.772 | 100,00 |
| USD 7.688.475 | United Airlines '2020-1 A' Pass Through Trust 5,875% 15/10/2027 | 7.265.099 | 0,17 | [^] Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |
| USD 1.834.300 | United Airlines '2020-1 B' Pass Through Trust 4,875% 15/1/2026 | 1.662.402 | 0,04 | ⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9. | | | |

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|----------------------------------|--------------------|---|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | USD 1.100.000 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.38 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 32.550 | (13.917) |
| CCCDs | USD 58.414.079 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.37 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/12/2026 | 492.464 | (587.144) |
| CCCDs | USD 21.020.000 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.38 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 118.719 | (179.217) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | EUR 2.916.890 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Subordinated Financials Series 37 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 9.978 | 108.222 |
| CCCDs | EUR 117.660.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (94.063) | 688.931 |
| CCCDs | EUR 107.211.006 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 284.767 | 2.649.293 |
| CCILs | EUR 17.102.106 | Fund receives Fixed 2,452% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2038 | (361.977) | (361.382) |
| CCILs | EUR 14.207.000 | Fund receives Fixed 2,481% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2037 | (249.775) | (249.409) |
| CCILs | GBP 33.942.000 | Fund receives Fixed 3,456% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2030 | (7.573.832) | (7.572.982) |
| CCILs | GBP 48.635.000 | Fund receives Fixed 3,500% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2030 | (10.225.561) | (10.224.342) |
| CCILs | GBP 8.573.000 | Fund receives Fixed 3,640% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2030 | (1.748.621) | (1.748.407) |
| CCILs | GBP 11.000.000 | Fund receives Fixed 3,650% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2031 | (2.284.418) | (2.284.129) |
| CCILs | GBP 14.340.000 | Fund receives Fixed 3,700% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2031 | (2.835.031) | (2.880.219) |
| CCILs | GBP 17.030.000 | Fund receives Fixed 3,718% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (3.190.776) | (3.190.325) |
| CCILs | GBP 9.000.000 | Fund receives Fixed 3,721% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (1.682.018) | (1.681.780) |
| CCILs | GBP 6.680.000 | Fund receives Fixed 3,730% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2031 | (1.311.159) | (1.314.649) |
| CCILs | GBP 42.847.000 | Fund receives Fixed 3,776% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2028 | (5.585.823) | (5.585.823) |
| CCILs | GBP 16.850.000 | Fund receives Fixed 3,805% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (2.957.831) | (2.957.382) |
| CCILs | GBP 5.500.000 | Fund receives Fixed 3,810% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (961.733) | (961.587) |
| CCILs | GBP 17.440.400 | Fund receives Fixed 3,850% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (2.954.813) | (2.954.346) |
| CCILs | GBP 9.100.000 | Fund receives Fixed 3,880% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2031 | (1.434.494) | (1.434.249) |
| CCILs | GBP 55.000.000 | Fund receives Fixed 4,185% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2026 | (5.947.732) | (5.946.760) |
| CCILs | GBP 12.109.000 | Fund receives Fixed 4,193% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2032 | (966.982) | (966.680) |
| CCILs | GBP 8.813.000 | Fund receives Fixed 4,245% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (710.821) | (710.605) |
| CCILs | GBP 4.970.000 | Fund receives Fixed 4,262% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (405.328) | (388.580) |
| CCILs | GBP 1.340.000 | Fund receives Fixed 4,285% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2032 | (78.607) | (78.574) |
| CCILs | GBP 12.480.000 | Fund receives Fixed 4,328% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2032 | (761.529) | (761.217) |
| CCILs | GBP 9.422.000 | Fund receives Fixed 4,348% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2031 | (764.549) | (764.299) |
| CCILs | GBP 1.470.000 | Fund receives Fixed 4,388% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (89.018) | (88.982) |
| CCILs | GBP 9.700.000 | Fund receives Fixed 4,435% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (522.787) | (522.550) |
| CCILs | GBP 27.594.000 | Fund receives Fixed 4,810% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2026 | (1.820.299) | (1.819.804) |
| CCILs | EUR 39.750.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,005% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 523.697 | 524.167 |
| CCILs | EUR 39.000.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,018% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 488.033 | 488.494 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCILS | EUR 7.885.900 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,080% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 77.331 | 72.670 |
| CCILS | EUR 3.884.100 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,115% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 30.572 | 28.579 |
| CCILS | GBP 1.300.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,728% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2052 | (122.705) | (122.634) |
| CCILS | GBP 1.312.859 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,750% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2052 | (140.764) | (140.694) |
| CCILS | GBP 55.000.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 4,492% | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2023 | 5.315.386 | 5.315.991 |
| CCILS | GBP 1.340.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 4,585% | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2027 | 72.785 | 72.804 |
| CCILS | GBP 27.594.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,070% | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2024 | 1.926.182 | 1.926.490 |
| CCILS | GBP 16.250.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,100% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2027 | 244.317 | 245.363 |
| CCILS | GBP 6.809.600 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,472% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 107.635 | 107.683 |
| CCILS | GBP 17.024.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,560% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 233.382 | 233.503 |
| CCILS | GBP 13.619.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,620% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 167.053 | 167.148 |
| CCILS | GBP 13.619.400 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,625% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 165.434 | 165.529 |
| CCILS | GBP 27.238.400 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,632% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 325.988 | 326.178 |
| CCILS | USD 2.430.000 | Fund receives Floating USD 12 Month CPURNSA and pays Fixed 2,693% | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | 138.299 | 138.344 |
| CCIRS | USD 5.000.000 | Fund receives Fixed 0,056% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 20/10/2022 | (28.257) | (28.257) |
| CCIRS | EUR 75.000.000 | Fund receives Fixed 0,088% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (10.774.147) | (10.772.857) |
| CCIRS | EUR 104.120.000 | Fund receives Fixed -0,103% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2026 | (6.573.062) | (6.571.704) |
| CCIRS | EUR 106.040.232 | Fund receives Fixed -0,134% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/10/2026 | (7.092.548) | (7.091.509) |
| CCIRS | USD 2.500.000 | Fund receives Fixed 0,176% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 20/10/2025 | (185.582) | (185.582) |
| CCIRS | EUR 51.040.000 | Fund receives Fixed 0,180% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (6.937.047) | (6.936.067) |
| CCIRS | EUR 17.538.900 | Fund receives Fixed 0,222% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 19/10/2031 | (2.434.469) | (2.437.674) |
| CCIRS | EUR 98.180.000 | Fund receives Fixed 0,424% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2027 | (4.797.266) | (4.796.304) |
| CCIRS | EUR 50.942.500 | Fund receives Fixed 0,462% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/10/2026 | (2.121.738) | (2.121.239) |
| CCIRS | EUR 5.170.000 | Fund receives Fixed 0,655% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (474.246) | (474.166) |
| CCIRS | EUR 56.000.000 | Fund receives Fixed 0,674% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (5.023.859) | (5.022.994) |
| CCIRS | EUR 8.180.000 | Fund receives Fixed 0,690% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (726.093) | (726.750) |
| CCIRS | EUR 56.650.000 | Fund receives Fixed 0,730% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (5.097.774) | (5.095.065) |
| CCIRS | EUR 49.195.803 | Fund receives Fixed 0,745% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 11/3/2052 | (9.326.221) | (11.163.685) |
| CCIRS | EUR 20.804.000 | Fund receives Fixed 0,749% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2046 | (3.809.200) | (4.493.963) |
| CCIRS | EUR 9.038.300 | Fund receives Fixed 0,768% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (741.652) | (741.512) |
| CCIRS | EUR 56.193.500 | Fund receives Fixed 0,784% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (4.538.888) | (4.538.020) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | EUR 53.680.000 | Fund receives Fixed 0,813% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (4.204.690) | (4.203.767) |
| CCIRS | EUR 54.100.000 | Fund receives Fixed 0,817% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (4.220.503) | (4.219.667) |
| CCIRS | EUR 83.352.000 | Fund receives Fixed 0,825% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (6.452.502) | (6.451.214) |
| CCIRS | EUR 48.672.000 | Fund receives Fixed 0,828% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (3.754.335) | (3.753.583) |
| CCIRS | EUR 24.050.000 | Fund receives Fixed 0,840% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (1.832.231) | (1.831.860) |
| CCIRS | EUR 0 | Fund receives Fixed 0,870% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 25/3/2027 | 642.213 | 1.067.800 |
| CCIRS | EUR 99.695.000 | Fund receives Fixed 0,906% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2037 | (14.246.621) | (14.244.503) |
| CCIRS | EUR 228.620.000 | Fund receives Fixed 0,928% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 7/4/2027 | (1.155.801) | (1.447.947) |
| CCIRS | EUR 228.630.000 | Fund receives Fixed 0,940% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 7/4/2027 | (1.399.998) | (1.421.828) |
| CCIRS | EUR 30.643.109 | Fund receives Fixed 0,983% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 16/3/2032 | (2.251.702) | (2.367.742) |
| CCIRS | EUR 360.190.000 | Fund receives Fixed 1,005% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 30/3/2027 | (2.014.811) | (2.012.451) |
| CCIRS | EUR 51.991.806 | Fund receives Fixed 1,122% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (2.044.563) | (2.967.012) |
| CCIRS | EUR 15.320.000 | Fund receives Fixed 1,240% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (674.926) | (674.690) |
| CCIRS | EUR 52.691.000 | Fund receives Fixed 1,331% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (1.554.036) | (2.081.532) |
| CCIRS | EUR 36.576.000 | Fund receives Fixed 1,365% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 5/5/2027 | (183.755) | (183.396) |
| CCIRS | EUR 99.890.000 | Fund receives Fixed 1,370% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 23/4/2027 | (219.064) | (214.232) |
| CCIRS | EUR 44.000.000 | Fund receives Fixed 1,439% and pays Floating EUR 3 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2052 | (3.510.037) | (3.525.798) |
| CCIRS | EUR 16.770.000 | Fund receives Fixed 1,465% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (427.658) | (430.202) |
| CCIRS | EUR 22.250.000 | Fund receives Fixed 1,532% and pays Floating EUR 3 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 5/5/2052 | (1.271.106) | (1.298.196) |
| CCIRS | EUR 10.076.500 | Fund receives Fixed 1,536% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (200.257) | (200.101) |
| CCIRS | GBP 15.353.991 | Fund receives Fixed 1,541% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 8/4/2052 | (1.841.210) | (1.840.979) |
| CCIRS | EUR 10.076.500 | Fund receives Fixed 1,546% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (192.262) | (192.107) |
| CCIRS | EUR 8.637.000 | Fund receives Fixed 1,593% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (131.619) | (131.486) |
| CCIRS | EUR 33.270.000 | Fund receives Fixed 1,613% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (452.232) | (451.718) |
| CCIRS | EUR 37.509.750 | Fund receives Fixed 1,642% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (503.433) | (502.853) |
| CCIRS | EUR 148.900.000 | Fund receives Fixed 1,673% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 12/5/2027 | 123.354 | 105.647 |
| CCIRS | EUR 50.000.000 | Fund receives Fixed 1,699% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (330.250) | (329.477) |
| CCIRS | EUR 122.585.000 | Fund receives Fixed 1,762% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (182.968) | (181.074) |
| CCIRS | EUR 11.920.000 | Fund receives Fixed 1,904% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | 121.194 | 121.378 |
| CCIRS | EUR 200.000.000 | Fund receives Fixed 2,026% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 26/5/2032 | (1.642.840) | (1.640.250) |
| CCIRS | GBP 51.840.000 | Fund receives Fixed 2,138% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 3/5/2027 | (372.329) | (374.163) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | GBP 75.750.000 | Fund receives Fixed 2,804% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 21/4/2024 | 120.350 | 120.779 |
| CCIRS | EUR 114.607.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,474% | Bank of America Merrill Lynch | 8/2/2023 | 19.290 | 19.450 |
| CCIRS | EUR 114.607.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,482% | Bank of America Merrill Lynch | 8/2/2023 | 18.042 | 18.203 |
| CCIRS | EUR 47.110.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,520% | Bank of America Merrill Lynch | 20/2/2025 | 441.286 | 438.188 |
| CCIRS | EUR 94.210.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,604% | Bank of America Merrill Lynch | 20/2/2025 | 826.584 | 798.291 |
| CCIRS | EUR 131.690.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,642% | Bank of America Merrill Lynch | 20/2/2025 | 1.055.786 | 1.065.455 |
| CCIRS | EUR 214.150.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,732% | Bank of America Merrill Lynch | 27/3/2025 | 2.853.762 | 2.854.779 |
| CCIRS | EUR 111.550.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,981% | Bank of America Merrill Lynch | 4/4/2025 | 575.703 | 948.230 |
| CCIRS | EUR 111.550.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,050% | Bank of America Merrill Lynch | 4/4/2025 | 798.164 | 796.049 |
| CCIRS | EUR 60.310.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,148% | Bank of America Merrill Lynch | 5/5/2027 | 307.058 | 307.649 |
| CCIRS | EUR 171.120.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,157% | Bank of America Merrill Lynch | 3/5/2024 | 371.900 | 419.705 |
| CCIRS | EUR 178.470.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,190% | Bank of America Merrill Lynch | 25/4/2024 | 336.069 | 361.611 |
| CCIRS | EUR 22.740.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,277% | Bank of America Merrill Lynch | 14/4/2024 | 15.083 | 23.311 |
| CCIRS | EUR 45.750.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,310% | Bank of America Merrill Lynch | 25/4/2025 | 97.349 | 102.131 |
| CCIRS | EUR 59.620.704 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,320% | Bank of America Merrill Lynch | 14/4/2024 | 51.376 | 35.265 |
| CCIRS | EUR 59.629.296 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,325% | Bank of America Merrill Lynch | 14/4/2024 | 38.175 | 32.278 |
| CCIRS | EUR 143.100.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,345% | Bank of America Merrill Lynch | 5/5/2024 | 84.556 | 85.236 |
| CCIRS | EUR 89.430.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,347% | Bank of America Merrill Lynch | 14/4/2024 | 70.764 | 28.666 |
| CCIRS | EUR 120.980.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,447% | Bank of America Merrill Lynch | 11/5/2024 | (48.271) | (43.770) |
| CCIRS | EUR 4.730.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed -0,004% | Bank of America Merrill Lynch | 25/9/2050 | 1.850.869 | 1.851.049 |
| CCIRS | EUR 6.944.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed -0,025% | Bank of America Merrill Lynch | 21/1/2061 | 3.160.455 | 3.160.719 |
| CCIRS | EUR 9.900.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,358% | Bank of America Merrill Lynch | 2/2/2072 | 3.680.282 | 3.680.708 |
| CCIRS | EUR 32.884.419 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,450% | Bank of America Merrill Lynch | 11/3/2072 | 8.651.832 | 11.208.752 |
| CCIRS | EUR 13.769.797 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,533% | Bank of America Merrill Lynch | 4/12/2049 | 3.726.402 | 3.726.402 |
| CCIRS | EUR 143.275.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,538% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2027 | 6.218.479 | 6.219.883 |
| CCIRS | EUR 16.270.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,581% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2072 | 4.826.217 | 4.826.917 |
| CCIRS | EUR 30.755.803 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,713% | Bank of America Merrill Lynch | 16/3/2027 | 1.042.972 | 1.105.631 |
| CCIRS | EUR 5.628.750 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,742% | Bank of America Merrill Lynch | 23/4/2052 | 146.516 | 146.674 |
| CCIRS | EUR 5.628.750 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,749% | Bank of America Merrill Lynch | 23/4/2052 | 144.142 | 144.299 |
| CCIRS | EUR 7.865.800 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,760% | Bank of America Merrill Lynch | 22/4/2052 | 195.991 | 196.211 |
| CCIRS | EUR 7.748.400 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,775% | Bank of America Merrill Lynch | 22/4/2052 | 187.208 | 185.796 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | EUR 4.374.281 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,817% | Bank of America Merrill Lynch | 16/3/2052 | 851.779 | 919.751 |
| CCIRS | EUR 44.000.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,400% | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2052 | 3.285.870 | 3.304.777 |
| CCIRS | EUR 22.250.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,463% | Bank of America Merrill Lynch | 5/5/2052 | 1.321.084 | 1.349.765 |
| CCIRS | EUR 22.428.909 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,818% | Bank of America Merrill Lynch | 25/7/2038 | 458.947 | 585.158 |
| CCIRS | GBP 995.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,280% | Bank of America Merrill Lynch | 1/4/2072 | 205.593 | 205.663 |
| CCIRS | GBP 10.050.348 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,360% | Bank of America Merrill Lynch | 8/4/2072 | 1.775.326 | 1.776.064 |
| CCIRS | GBP 2.390.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,542% | Bank of America Merrill Lynch | 21/4/2072 | 260.111 | 260.301 |
| CCIRS | GBP 78.150.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 2,388% | Bank of America Merrill Lynch | 22/4/2025 | (2.878) | (2.436) |
| CCIRS | USD 5.000.000 | Fund receives Floating USD 12 Month FEDL and pays Fixed 0,051% | Bank of America Merrill Lynch | 20/10/2022 | 29.165 | 29.165 |
| CCIRS | USD 2.500.000 | Fund receives Floating USD 12 Month FEDL and pays Fixed 0,182% | Bank of America Merrill Lynch | 20/10/2025 | 186.996 | 186.996 |
| CCIRS | USD 12.000.000 | Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,860% | Bank of America Merrill Lynch | 3/4/2028 | (999) | (999) |
| CCIRS | USD 28.000.000 | Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,972% | Bank of America Merrill Lynch | 10/5/2027 | (139.938) | (139.938) |
| CCIRS | USD 5.340.000 | Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,974% | Bank of America Merrill Lynch | 3/5/2028 | (31.260) | (31.260) |
| CCIRS | USD 1.903.567 | Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,018% | Bank of America Merrill Lynch | 10/5/2028 | (15.158) | (15.158) |
| CDS | EUR 70.000 | Fund receives default protection on BASF SE and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 192 | (1.153) |
| CDS | USD 2.000.000 | Fund receives default protection on Republic of Italy Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2025 | (129.986) | (9.583) |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on STMicroelectronics NV and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (1.061) | (17.478) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives default protection on STMicroelectronics NV and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (537) | (8.739) |
| CDS | EUR 1.200.000 | Fund receives default protection on Telenor ASA and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (5.070) | (34.765) |
| CDS | EUR 308.333 | Fund receives default protection on Telia Co AB and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (3.577) | (8.601) |
| CDS | EUR 308.334 | Fund receives default protection on Telia Co AB and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (2.279) | (8.601) |
| CDS | EUR 900.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BP Capital Markets Plc | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 1.527 | 8.071 |
| CDS | EUR 1.500.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BP Capital Markets Plc | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 2.545 | 13.451 |
| CDS | USD 2.000.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Republic of Italy Government International Bond | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2025 | 100.465 | 31.559 |
| CDS | EUR 144.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2026 | (666) | 6.655 |
| CDS | EUR 120.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc | Bank of America Merrill Lynch | 20/12/2026 | (3.662) | (8.260) |
| CDS | JPY 29.468.456 | Fund receives default protection on Rakuten Group Inc and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | (4.626) | 8.300 |
| CDS | JPY 17.681.073 | Fund receives default protection on Rakuten Group Inc and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | (2.776) | 4.980 |
| CDS | EUR 695.000 | Fund receives default protection on Renault SA and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | 558 | 84.476 |
| CDS | JPY 60.019.919 | Fund receives default protection on SoftBank Group Corp and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | (195) | 57.651 |
| CDS | EUR 1.300.000 | Fund receives default protection on Telenor ASA and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | 1.032 | (37.662) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|---|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | EUR 308.333 | Fund receives default protection on Telia Co AB and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | (2.848) | (8.601) |
| CDS | EUR 308.333 | Fund receives default protection on Telia Co AB and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | (3.172) | (8.601) |
| CDS | EUR 150.000 | Fund receives default protection on Wendel SE and pays Fixed 5,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | 1.593 | (27.583) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives default protection on Wendel SE and pays Fixed 5,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | (983) | (55.166) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives default protection on Wendel SE and pays Fixed 5,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | (1.547) | (55.166) |
| CDS | EUR 420.000 | Fund receives default protection on WPP Finance SA and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | (239) | 2.177 |
| CDS | EUR 40.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | Barclays Bank | 20/6/2026 | (211) | 1.848 |
| CDS | EUR 16.010 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | Barclays Bank | 20/6/2027 | 36 | 516 |
| CDS | EUR 192.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum AB | Barclays Bank | 20/12/2026 | (14.865) | 884 |
| CDS | EUR 120.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Saipem Finance International BV | Barclays Bank | 20/6/2027 | (3.163) | (5.563) |
| CDS | EUR 120.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Saipem Finance International BV | Barclays Bank | 20/6/2027 | 1.037 | (5.563) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on United Group BV | Barclays Bank | 20/6/2027 | 1.436 | (15.954) |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on Barclays Plc and pays Fixed 1,000% | BNP Paribas | 20/6/2027 | (3.974) | 21.055 |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on NatWest Group Plc and pays Fixed 1,000% | BNP Paribas | 20/6/2027 | (5.730) | 19.023 |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Loxam SAS | BNP Paribas | 20/6/2027 | (7.503) | (17.664) |
| CDS | EUR 190.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Loxam SAS | BNP Paribas | 20/6/2027 | (7.862) | (11.187) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on United Group BV | BNP Paribas | 20/6/2027 | (213) | (15.954) |
| CDS | EUR 350.000 | Fund receives default protection on Deutsche Lufthansa AG and pays Fixed 1,000% | Citibank | 20/6/2027 | 4.603 | 40.168 |
| CDS | EUR 350.000 | Fund receives default protection on Deutsche Lufthansa AG and pays Fixed 1,000% | Citibank | 20/6/2027 | 5.321 | 40.168 |
| CDS | EUR 590.000 | Fund receives default protection on Eni SpA and pays Fixed 1,000% | Citibank | 20/6/2027 | 359 | (5.016) |
| CDS | EUR 1.900.000 | Fund receives default protection on HSBC Holdings Plc and pays Fixed 1,000% | Citibank | 20/12/2025 | (33.396) | 5.593 |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives default protection on UPC Holding BV and pays Fixed 5,000% | Citibank | 20/6/2027 | (3.768) | (21.541) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives default protection on UPC Holding BV and pays Fixed 5,000% | Citibank | 20/6/2027 | (2.945) | (21.541) |
| CDS | EUR 120.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | Citibank | 20/6/2027 | (5.851) | (26.251) |
| CDS | EUR 180.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | Citibank | 20/6/2027 | (6.526) | (39.376) |
| CDS | EUR 330.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Picard Bondco SA | Citibank | 20/12/2026 | (21.804) | (7.871) |
| CDS | EUR 310.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | Credit Suisse | 20/12/2025 | 6.344 | 16.018 |
| CDS | EUR 150.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | Credit Suisse | 20/6/2026 | (245) | 6.932 |
| CDS | EUR 400.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | Credit Suisse | 20/12/2026 | (16.481) | 15.591 |
| CDS | EUR 88.287 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | Credit Suisse | 20/6/2027 | (6) | 2.847 |
| CDS | EUR 120.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum AB | Credit Suisse | 20/12/2026 | (8.337) | 552 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | EUR 150.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc | Credit Suisse | 20/12/2026 | (15.853) | (10.325) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on K+S AG | Credit Suisse | 20/12/2026 | 6.698 | 35.567 |
| CDS | EUR 200.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Loxam SAS | Credit Suisse | 20/12/2026 | (18.290) | (8.234) |
| CDS | EUR 200.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Loxam SAS | Credit Suisse | 20/12/2026 | (18.037) | (8.234) |
| CDS | EUR 330.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Loxam SAS | Credit Suisse | 20/12/2026 | (27.482) | (13.587) |
| CDS | EUR 200.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Loxam SAS | Credit Suisse | 20/12/2026 | (14.194) | (8.234) |
| CDS | EUR 391.792 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Monitchem HoldCo 3 SA | Credit Suisse | 20/12/2025 | (7.443) | 29.418 |
| CDS | EUR 400.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Novafives SAS | Credit Suisse | 20/6/2026 | (36.346) | (76.346) |
| CDS | EUR 200.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Novafives SAS | Credit Suisse | 20/12/2026 | (21.806) | (40.056) |
| CDS | EUR 120.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Saipem Finance International BV | Credit Suisse | 20/6/2027 | (3.163) | (5.563) |
| CDS | EUR 120.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Saipem Finance International BV | Credit Suisse | 20/6/2027 | (763) | (5.563) |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on BASF SE and pays Fixed 1,000% | Deutsche Bank | 20/6/2027 | 1.331 | (9.885) |
| CDS | EUR 900.000 | Fund receives default protection on Bertelsmann SE & Co KGaA and pays Fixed 1,000% | Deutsche Bank | 20/6/2027 | (2.397) | (26.262) |
| CDS | EUR 620.000 | Fund receives default protection on Electricite de France SA and pays Fixed 1,000% | Deutsche Bank | 20/6/2024 | 3.358 | (3.145) |
| CDS | EUR 620.000 | Fund receives default protection on Electricite de France SA and pays Fixed 1,000% | Deutsche Bank | 20/6/2024 | 3.069 | (3.145) |
| CDS | EUR 140.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum AB | Deutsche Bank | 20/6/2026 | (11.473) | 2.044 |
| CDS | USD 3.900.000 | Fund receives default protection on ERP Operating LP and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2025 | (6.730) | (88.734) |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on Lloyds Banking Group Plc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2027 | (5.610) | 12.730 |
| CDS | JPY 58.000.000 | Fund receives default protection on Rakuten Group Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2027 | 4.698 | 16.336 |
| CDS | EUR 180.000 | Fund receives default protection on Renault SA and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2027 | (1.481) | 21.879 |
| CDS | EUR 120.000 | Fund receives default protection on Vue International Bidco Plc and pays Fixed 5,000% | Goldman Sachs | 20/12/2024 | 7.409 | 19.409 |
| CDS | EUR 100.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | Goldman Sachs | 20/12/2026 | (19.519) | (19.928) |
| CDS | EUR 200.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | Goldman Sachs | 20/12/2026 | (26.856) | (39.856) |
| CDS | EUR 290.323 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | Goldman Sachs | 20/12/2026 | (40.073) | (57.855) |
| CDS | EUR 120.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc | Goldman Sachs | 20/6/2027 | 643 | (6.748) |
| CDS | EUR 180.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum AB | Goldman Sachs | 20/12/2026 | (13.439) | 829 |
| CDS | EUR 480.904 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc | Goldman Sachs | 20/12/2026 | (49.109) | (33.104) |
| CDS | EUR 165.829 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc | Goldman Sachs | 20/12/2026 | (17.610) | (11.415) |
| CDS | EUR 76.433 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Novafives SAS | Goldman Sachs | 20/6/2023 | (636) | (5.987) |
| CDS | EUR 43.567 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Novafives SAS | Goldman Sachs | 20/6/2023 | (145) | (3.412) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | EUR 153.440 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on TK Elevator Holdco GmbH | Goldman Sachs | 20/12/2026 | (3.537) | (1.349) |
| CDS | EUR 142.857 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Vue International Bidco Plc | Goldman Sachs | 20/6/2026 | (20.796) | (27.225) |
| CDS | EUR 900.000 | Fund receives default protection on Bertelsmann SE & Co KGaA and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2027 | (2.967) | (26.262) |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on Enel SpA and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2027 | 1.076 | (101) |
| CDS | USD 2.500.000 | Fund receives default protection on Exelon Corp and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2025 | 28.679 | (52.976) |
| CDS | EUR 630.000 | Fund receives default protection on Galp Energia SGPS SA and pays Fixed 5,000% | JP Morgan | 20/6/2027 | 4.941 | (114.685) |
| CDS | EUR 5.533.000 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 146.715 | 85.110 |
| CDS | EUR 2.564.294 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 51.656 | 39.444 |
| CDS | EUR 535.000 | Fund receives default protection on Publicis Groupe SA and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2025 | 3.683 | (3.963) |
| CDS | EUR 535.000 | Fund receives default protection on Publicis Groupe SA and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2025 | 2.086 | (3.963) |
| CDS | JPY 79.000.000 | Fund receives default protection on Rakuten Group Inc and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2027 | 6.152 | 22.251 |
| CDS | EUR 120.000 | Fund receives default protection on Renault SA and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2027 | 2.275 | 14.586 |
| CDS | EUR 2.000.000 | Fund receives default protection on Stellantis NV and pays Fixed 5,000% | JP Morgan | 20/6/2027 | 24.128 | (302.530) |
| CDS | EUR 900.000 | Fund receives default protection on STMicroelectronics NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2027 | 159 | (26.217) |
| CDS | EUR 308.334 | Fund receives default protection on Telia Co AB and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2027 | (2.693) | (8.601) |
| CDS | USD 2.500.000 | Fund receives default protection on United Parcel Service of America Inc and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2025 | 25.979 | (53.570) |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on Volkswagen International Finance NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2027 | 3.273 | 10.525 |
| CDS | EUR 350.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | JP Morgan | 20/12/2025 | (118.454) | (68.859) |
| CDS | EUR 150.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | JP Morgan | 20/6/2026 | (48.081) | (29.662) |
| CDS | EUR 350.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | JP Morgan | 20/6/2026 | (106.674) | (69.212) |
| CDS | EUR 330.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Cirs Finance International Sarl | JP Morgan | 20/6/2026 | 4.199 | (50) |
| CDS | EUR 277.122 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Cirs Finance International Sarl | JP Morgan | 20/6/2026 | 1.742 | (42) |
| CDS | EUR 132.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Cirs Finance International Sarl | JP Morgan | 20/6/2026 | (20) | (20) |
| CDS | EUR 152.903 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Cirs Finance International Sarl | JP Morgan | 20/6/2027 | (896) | (3.439) |
| CDS | EUR 330.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | JP Morgan | 20/12/2025 | 3.273 | 17.052 |
| CDS | EUR 350.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | JP Morgan | 20/6/2026 | (9.204) | 16.175 |
| CDS | EUR 88.718 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | JP Morgan | 20/6/2027 | (243) | 2.861 |
| CDS | EUR 83.394 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | JP Morgan | 20/6/2027 | (229) | 2.689 |
| CDS | EUR 23.591 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | JP Morgan | 20/6/2027 | (51) | 761 |
| CDS | EUR 140.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum AB | JP Morgan | 20/6/2026 | (11.496) | 2.044 |
| CDS | EUR 155.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on K+S AG | JP Morgan | 20/12/2026 | 2.951 | 18.376 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|--------------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | EUR 120.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Loxam SAS | JP Morgan | 20/12/2026 | (12.485) | (4.941) |
| CDS | EUR 183.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Loxam SAS | JP Morgan | 20/6/2027 | (5.229) | (10.775) |
| CDS | EUR 427.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Loxam SAS | JP Morgan | 20/6/2027 | (12.200) | (25.142) |
| CDS | EUR 60.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Saipem Finance International BV | JP Morgan | 20/6/2027 | (1.539) | (2.782) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on United Group BV | JP Morgan | 20/6/2027 | 3.604 | (15.954) |
| CDS | USD 2.500.000 | Fund receives default protection on Cardinal Health Inc and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2025 | 12.677 | (45.997) |
| CDS | EUR 2.890.000 | Fund receives default protection on Cellnex Telecom SA and pays Fixed 5,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | 50.928 | (329.131) |
| CDS | USD 2.500.000 | Fund receives default protection on DR Horton Inc and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2025 | 62.367 | (9.837) |
| CDS | EUR 1.190.000 | Fund receives default protection on Eni SpA and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | (6.073) | (10.117) |
| CDS | USD 2.500.000 | Fund receives default protection on International Paper Co and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2025 | 29.501 | (43.750) |
| CDS | USD 3.900.000 | Fund receives default protection on Johnson & Johnson and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/12/2025 | 33.545 | (102.782) |
| CDS | EUR 1.090.000 | Fund receives default protection on LANXESS AG and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | 6.717 | 18.068 |
| CDS | USD 3.900.000 | Fund receives default protection on McDonald's Corp and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/12/2025 | 39.887 | (86.999) |
| CDS | USD 2.500.000 | Fund receives default protection on McKesson Corp and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2025 | 11.432 | (52.430) |
| CDS | USD 3.900.000 | Fund receives default protection on Pfizer Inc and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/12/2025 | 35.933 | (91.809) |
| CDS | EUR 180.000 | Fund receives default protection on Renault SA and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | 2.538 | 21.879 |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on Solvay SA and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | (2.799) | (1.779) |
| CDS | USD 2.500.000 | Fund receives default protection on Tyson Foods Inc and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2025 | 28.595 | (41.519) |
| CDS | USD 2.500.000 | Fund receives default protection on UnitedHealth Group Inc and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2025 | 29.156 | (49.341) |
| CDS | EUR 1.290.000 | Fund receives default protection on WPP Finance SA and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | 17.983 | 6.685 |
| CDS | EUR 60.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | Morgan Stanley | 20/12/2025 | (20.080) | (11.804) |
| CDS | EUR 150.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc | Morgan Stanley | 20/12/2026 | (16.904) | (10.325) |
| CDS | EUR 140.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Vue International Bidco Plc | Morgan Stanley | 20/6/2026 | (19.680) | (26.680) |
| ILS | EUR 42.995.000 | Fund receives Fixed 1,412% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Barclays Bank | 15/3/2027 | (5.896.051) | (5.896.052) |
| IRS | KRW 95.711.775.000 | Fund receives Fixed 1,590% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2023 | (1.062.775) | (1.062.775) |
| IRS | KRW 38.763.286.800 | Fund receives Fixed 1,630% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2023 | (418.893) | (418.893) |
| IRS | KRW 79.759.775.000 | Fund receives Fixed 1,632% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | BNP Paribas | 21/9/2023 | (860.732) | (860.732) |
| IRS | KRW 40.996.563.200 | Fund receives Fixed 1,642% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | HSBC | 21/9/2023 | (439.216) | (439.216) |
| TRS | EUR 500.000 | Fund receives 3 Month EURIBOR and pays Markit iBoxx Euro Corporate Index | BNP Paribas | 20/6/2022 | 25.144 | 25.144 |
| TRS | EUR 5.600.000 | Fund receives 3 Month EURIBOR and pays Markit iBoxx Euro Corporate Index | Goldman Sachs | 20/6/2022 | 499.919 | 499.919 |
| TRS | EUR 2.300.000 | Fund receives 3 Month EURIBOR and pays Markit iBoxx Euro Corporate Index | Goldman Sachs | 20/9/2022 | (22.888) | (24.778) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-------------|--|-------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| TRS | GBP 402.381 | Fund receives Fixed -0,350% and pays Anheuser-Busch InBev SA | JP Morgan | 10/3/2023 | 30.975 | 30.975 |
| TRS | GBP 405.489 | Fund receives Fixed -0,350% and pays Tesco Corporate Treasury Services Plc | JP Morgan | 8/3/2023 | 38.951 | 38.951 |
| TRS | EUR 708.738 | Fund receives Fixed -0,580% and pays easyJet Plc | JP Morgan | 8/7/2022 | 62.581 | 62.581 |
| TRS | EUR 381.670 | Fund receives Fixed -1,280% and pays Enel Finance International NV | JP Morgan | 10/3/2023 | 37.999 | 37.999 |
| TRS | EUR 389.795 | Fund receives Fixed -1,280% and pays Infrastrutture Wireless Italiane SpA | JP Morgan | 10/3/2023 | 29.779 | 29.779 |
| TRS | EUR 315.267 | Fund receives Fixed -1,280% and pays MMS USA Holdings Inc | JP Morgan | 27/12/2022 | 31.590 | 31.590 |
| TRS | EUR 761.906 | Fund receives Fixed -1,280% and pays Neinor Homes SLU | JP Morgan | 12/12/2022 | 83.138 | 83.138 |
| TRS | EUR 404.929 | Fund receives Fixed -1,280% and pays Ryanair DAC | JP Morgan | 21/11/2022 | 30.137 | 30.137 |
| TRS | EUR 326.396 | Fund receives Fixed -1,280% and pays Volkswagen International Finance NV | JP Morgan | 27/12/2022 | 44.385 | 44.385 |
| TRS | EUR 326.693 | Fund receives Fixed -1,280% and pays WPP Finance | JP Morgan | 27/12/2022 | 47.244 | 47.244 |
| TRS | EUR 362.571 | Fund receives Fixed -1,300% and pays Erste Group Bank AG | JP Morgan | 8/5/2023 | 15.534 | 15.534 |
| TRS | EUR 99.540 | Fund receives Fixed -1,350% and pays Danone SA | JP Morgan | 20/2/2023 | 10.326 | 10.326 |
| TRS | EUR 282.001 | Fund receives Fixed -1,350% and pays easyJet Plc | JP Morgan | 11/5/2023 | 5.076 | 5.076 |
| TRS | EUR 361.419 | Fund receives Fixed -1,350% and pays Erste Group Bank AG | JP Morgan | 12/5/2023 | 14.382 | 14.382 |
| TRS | EUR 495.942 | Fund receives Fixed -1,400% and pays Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | JP Morgan | 9/1/2023 | 31.151 | 31.151 |
| TRS | EUR 295.474 | Fund receives Fixed -1,500% and pays Engie SA | JP Morgan | 20/2/2023 | 43.675 | 43.675 |
| TRS | EUR 330.917 | Fund receives Fixed -1,500% and pays Infineon Technologies AG | JP Morgan | 27/12/2022 | 42.396 | 42.396 |
| TRS | EUR 294.884 | Fund receives Fixed -1,600% and pays OMV AG | JP Morgan | 8/4/2023 | 23.718 | 23.718 |
| TRS | EUR 293.930 | Fund receives Fixed -1,600% and pays OMV AG | JP Morgan | 9/4/2023 | 22.764 | 22.764 |
| TRS | EUR 198.947 | Fund receives Fixed -1,700% and pays Danone SA | JP Morgan | 21/2/2023 | 20.519 | 20.519 |
| TRS | EUR 190.068 | Fund receives Fixed -1,800% and pays Wendel SE | JP Morgan | 24/3/2023 | 26.815 | 26.815 |
| TRS | EUR 141.288 | Fund receives Fixed -1,950% and pays Infrastrutture Wireless Italiane SpA | JP Morgan | 14/4/2023 | 6.282 | 6.282 |
| TRS | EUR 493.744 | Fund receives Fixed -2,150% and pays PCF GmbH | JP Morgan | 11/4/2023 | 12.478 | 12.478 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 286.778.522) | | | | | (131.760.874) | (132.413.167) |

CCCDs: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps
 CCILs: Zentral abgewickelte inflationsgebundene Swaps
 CCIRs: Zentral abgewickelte Zinsswaps
 CDS: Credit Default Swaps
 ILS: Inflationsgebundene Swaps
 IRS: Zinsraten-Swaps
 TRS: Gesamtertrag-Swaps

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (1.350) | EUR | 3 Month EURIBOR Futures June 2023 | Juni 2023 | 332.386.875 | 510.018 |
| (130) | USD | 3 Month SOFR Futures December 2022 | März 2023 | 29.499.536 | (61.159) |
| 1.447 | GBP | 3 Month SONIA Futures December 2022 | März 2023 | 414.893.560 | (1.266.185) |
| 121 | GBP | 3 Month SONIA Futures June 2022 | September 2022 | 35.033.425 | 3.555 |
| 5.839 | AUD | 90 Day Bank Bill Futures December 2022 | Dezember 2022 | 3.883.536.360 | (12.085.428) |
| 67 | AUD | Australian 10 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 5.487.222 | (22.444) |
| (209) | AUD | Australian 3 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 15.231.434 | 18.928 |
| 40 | EUR | Euro BOBL Futures June 2022 | Juni 2022 | 5.056.000 | (31.260) |
| (8.500) | EUR | Euro BOBL Futures June 2022 | Juni 2022 | 1.074.400.000 | 9.490.771 |
| (2.187) | EUR | Euro BTP Futures June 2022 | Juni 2022 | 277.464.690 | 6.123.325 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (5.552) | EUR | Euro Bund Futures June 2022 | Juni 2022 | 841.072.480 | 13.592.809 |
| (1.614) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 262.500.960 | 16.965.393 |
| (17) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures September 2022 | September 2022 | 2.966.160 | 65.580 |
| (7.445) | EUR | Euro Schatz Futures June 2022 | Juni 2022 | 819.657.275 | 528.807 |
| (5.065) | EUR | Euro-OAT Futures June 2022 | Juni 2022 | 729.461.300 | 16.955.420 |
| (162) | JPY | Japan 10 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 175.753.146 | (109.758) |
| (524) | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2022 | September 2022 | 71.566.989 | 1.035.301 |
| (116) | USD | US Long Bond Futures September 2022 | September 2022 | 15.061.728 | 162.123 |
| (649) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 77.773.986 | 772.332 |
| 32 | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 3.565.928 | (21.914) |
| (35) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 3.900.234 | 28.014 |
| (2.991) | USD | US Treasury 2 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 589.104.030 | 295.637 |
| (5.747) | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 605.589.345 | 161.607 |
| (153) | USD | US Ultra Bond Futures September 2022 | September 2022 | 22.168.934 | 104.665 |
| Gesamt | | | | | 53.216.137 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Netto(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|---|-----------|-----------------------|-------------------------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 193.250.000 | Call | OTC EUR/USD | Bank of America Merrill Lynch | EUR 1,19 | 05/08/2022 | (1.462.516) | 15.846 |
| 1.940.000 | Put | OTC USD/JPY | Bank of America Merrill Lynch | USD 105,00 | 28/03/2023 | (69.331) | 36.801 |
| 1.940.000 | Put | OTC USD/JPY | Bank of America Merrill Lynch | USD 105,00 | 28/03/2023 | (69.331) | 36.801 |
| 2.760.000 | Put | OTC USD/JPY | Bank of America Merrill Lynch | USD 110,00 | 19/04/2023 | (58.722) | 128.249 |
| 61.080.000 | Put | OTC USD/JPY | Barclays Bank | USD 115,00 | 21/09/2022 | (370.443) | 76.232 |
| 113.630.000 | Call | OTC EUR/USD | Credit Suisse | EUR 1,21 | 10/08/2022 | (443.044) | 4.091 |
| 54.780.000 | Call | OTC USD/CNH | HSBC | USD 6,90 | 18/08/2022 | (97.685) | 196.773 |
| 113.630.000 | Call | OTC EUR/USD | JP Morgan | EUR 1,21 | 10/08/2022 | (450.429) | 4.091 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 16.334.624) | | | | | | (3.021.501) | 498.884 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|-----------------------|---------------|---------------|---------------|------------------------------------|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (61.080.000) | Put | OTC USD/JPY | Barclays Bank | USD 112,00 | 21/09/2022 | 212.376 | (45.728) |
| (54.780.000) | Call | OTC USD/CNH | HSBC | USD 7,10 | 18/08/2022 | 36.668 | (75.733) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 5.498.925) | | | | | | 249.044 | (121.461) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|---|--------------|--|----------------------------------|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| 5.200.000 | Call | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 20/7/2022 | Bank of America Merrill Lynch | EUR 4,00 | 20/07/2022 | 5.732 | 18.420 |
| 4.900.000 | Put | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 15/6/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Bank of America Merrill Lynch | EUR 4,25 | 15/06/2022 | 3.144 | 58.538 |
| 2.350.000 | Put | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 21/9/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Bank of America Merrill Lynch | EUR 6,50 | 21/09/2022 | (25.811) | 21.307 |
| 2.350.000 | Put | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 21/9/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Bank of America Merrill Lynch | EUR 6,50 | 21/09/2022 | (3.885) | 21.307 |
| 52.000.000 | Call | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 from 15/6/2022 | Barclays Bank | EUR 0,90 | 15/06/2022 | 23.471 | 109.271 |
| 4.800.000 | Put | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 15/6/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Barclays Bank | EUR 4,50 | 15/06/2022 | (28.396) | 31.844 |
| 4.730.000 | Put | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 20/7/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Barclays Bank | EUR 4,75 | 20/07/2022 | (33.991) | 55.879 |
| 31.060.000 | Put | Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 20/3/2023; and pays 1,36% Fixed annually from 16/9/2022 | Goldman Sachs | EUR 1,36 | 16/09/2022 | 1.345.905 | 1.774.318 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 60.444.603) | | | | | | 1.286.169 | 2.090.884 |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|--------------|--|---------------|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (31.060.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,66% Fixed annually from 16/9/2022; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 20/3/2023 | Goldman Sachs | EUR 1,66 | 16/09/2022 | (859.253) | (1.081.739) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|--------------|---|----------------------------------|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (4.730.000) | Put | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 20/7/2022 | Barclays Bank | EUR 5,50 | 20/07/2022 | 32.254 | (26.161) |
| (5.200.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 17/8/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Goldman Sachs | EUR 4,75 | 17/08/2022 | (13.380) | (111.920) |
| (4.900.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 20/7/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Barclays Bank | EUR 4,50 | 20/07/2022 | (6.668) | (64.733) |
| (52.000.000) | Put | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 from 15/6/2022 | Barclays Bank | EUR 1,10 | 15/06/2022 | 103.069 | (10.083) |
| (2.500.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 17/8/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Goldman Sachs | EUR 4,62 | 17/08/2022 | (987) | (45.987) |
| (2.350.000) | Put | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 21/9/2022 | Barclays Bank | EUR 6,00 | 21/09/2022 | 23.398 | (27.397) |
| (2.500.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 15/6/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Goldman Sachs | EUR 4,50 | 15/06/2022 | 4.723 | (21.777) |
| (4.800.000) | Put | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 15/6/2022 | Barclays Bank | EUR 5,50 | 15/06/2022 | 13.373 | (4.051) |
| (4.800.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 17/8/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Barclays Bank | EUR 4,13 | 17/08/2022 | 13.307 | (35.653) |
| (2.400.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 20/7/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Goldman Sachs | EUR 4,37 | 20/07/2022 | 8.554 | (24.890) |
| (2.350.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 21/9/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Bank of America Merrill Lynch | EUR 4,37 | 21/09/2022 | (8.756) | (34.841) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|---|--------------|---|----------------------------------|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (2.500.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 17/8/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Barclays Bank | EUR 4,38 | 17/08/2022 | (4.020) | (31.707) |
| (5.200.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 20/7/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Bank of America Merrill Lynch | EUR 4,75 | 20/07/2022 | (29.605) | (102.145) |
| (4.700.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 21/9/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Barclays Bank | EUR 4,38 | 21/09/2022 | (3.318) | (69.682) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 40.792.986) | | | | | | (727.309) | (1.692.766) |

| Currency | Purchases | Currency | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-------------|----------|-------------|----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 16.660.000 | EUR | 11.276.283 | JP Morgan | 14/7/2022 | (129.787) |
| CHF | 44.596.380 | EUR | 43.820.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (430.398) |
| CHF | 46.145.281 | EUR | 44.680.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 216.588 |
| CNH | 150.832.910 | USD | 22.314.772 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 255.262 |
| CNH | 45.000.000 | USD | 6.864.716 | Citibank | 15/6/2022 | (117.195) |
| CNH | 27.817.090 | USD | 4.114.924 | HSBC | 15/6/2022 | 47.485 |
| DKK | 35.580.000 | EUR | 4.782.244 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 371 |
| EUR | 2.723.233 | AUD | 4.030.000 | Bank of America Merrill Lynch | 14/7/2022 | 26.931 |
| EUR | 322.940 | AUD | 480.000 | HSBC | 14/7/2022 | 1.792 |
| EUR | 10.188.425 | AUD | 15.200.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 18.753 |
| EUR | 1.918.678 | AUD | 2.840.000 | Royal Bank of Canada | 14/7/2022 | 18.554 |
| EUR | 320.719 | AUD | 480.000 | UBS | 14/7/2022 | (429) |
| EUR | 95.420 | CHF | 100.000 | Bank of America Merrill Lynch | 14/6/2022 | (1.874) |
| EUR | 33.710.353 | CHF | 34.580.486 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 65.616 |
| EUR | 17.769.647 | CHF | 18.257.957 | HSBC | 15/6/2022 | 5.751 |
| EUR | 14.680.000 | CHF | 15.080.896 | JP Morgan | 15/6/2022 | 7.193 |
| EUR | 22.340.000 | CHF | 22.980.153 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (18.309) |
| EUR | 388.454 | DKK | 2.890.000 | Deutsche Bank | 14/7/2022 | (16) |
| EUR | 75.924.806 | DKK | 564.700.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 18.604 |
| EUR | 994.585 | GBP | 850.000 | Deutsche Bank | 14/6/2022 | (3.960) |
| EUR | 17.426.968 | GBP | 14.940.000 | UBS | 14/6/2022 | (123.930) |
| EUR | 50.157.605 | GBP | 42.073.445 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 734.086 |
| EUR | 5.368.750 | GBP | 4.580.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (11.359) |
| EUR | 10.920.000 | GBP | 9.236.464 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 69.961 |
| EUR | 98.694.555 | GBP | 82.938.666 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 1.266.812 |
| EUR | 55.440.000 | GBP | 46.161.953 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 1.213.727 |
| EUR | 5.355.422 | GBP | 4.580.000 | HSBC | 15/6/2022 | (24.687) |
| EUR | 2.137.042 | GBP | 1.810.000 | Citibank | 14/7/2022 | 13.886 |

| Currency | Purchases | Currency | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-------------|----------|-------------|----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 19.138.689 | GBP | 16.250.000 | HSBC | 14/7/2022 | 77.203 |
| EUR | 15.713.872 | GBP | 13.230.000 | JP Morgan | 14/7/2022 | 194.888 |
| EUR | 677.135.283 | GBP | 565.770.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 13.478.816 |
| EUR | 13.307.082 | GBP | 11.280.000 | Standard Chartered Bank | 14/7/2022 | 75.477 |
| EUR | 7.402.084 | GBP | 6.180.000 | UBS | 14/7/2022 | 152.854 |
| EUR | 110.714 | JPY | 15.210.000 | Deutsche Bank | 14/6/2022 | 465 |
| EUR | 13.479.151 | NOK | 130.400.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 565.573 |
| EUR | 63.919.716 | NZD | 101.400.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 2.498.634 |
| EUR | 6.243.622 | SEK | 66.140.000 | Barclays Bank | 14/7/2022 | (37.420) |
| EUR | 6.625.063 | SEK | 68.380.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | 131.298 |
| EUR | 6.358.371 | USD | 6.720.000 | Barclays Bank | 14/6/2022 | 88.778 |
| EUR | 18.916 | USD | 20.000 | Deutsche Bank | 14/6/2022 | 256 |
| EUR | 316.627 | USD | 340.000 | Morgan Stanley | 14/6/2022 | (585) |
| EUR | 19.197 | USD | 20.000 | UBS | 14/6/2022 | 538 |
| EUR | 49.680.000 | USD | 53.242.544 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 8.696 |
| EUR | 73.544.298 | USD | 80.140.023 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (1.220.339) |
| EUR | 39.620.000 | USD | 41.760.504 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 660.579 |
| EUR | 43.790.000 | USD | 47.119.400 | Citibank | 15/6/2022 | (168.870) |
| EUR | 111.560.000 | USD | 121.614.764 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (1.897.464) |
| EUR | 39.820.000 | USD | 44.253.093 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | (1.464.820) |
| EUR | 72.145.702 | USD | 78.093.099 | HSBC | 15/6/2022 | (709.308) |
| EUR | 85.070.000 | USD | 91.948.573 | JP Morgan | 15/6/2022 | (711.129) |
| EUR | 74.670.000 | USD | 80.399.856 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (337.042) |
| EUR | 22.830.000 | USD | 23.779.363 | Natwest Markets | 15/6/2022 | 645.636 |
| EUR | 28.220.000 | USD | 29.505.585 | Societe Generale | 15/6/2022 | 693.500 |
| EUR | 274.496.159 | USD | 299.780.000 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | (4.735.435) |
| EUR | 227.996 | USD | 240.000 | Royal Bank of Canada | 14/7/2022 | 4.446 |
| EUR | 43.397.792 | USD | 46.710.000 | Standard Chartered Bank | 14/7/2022 | (110.473) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Currency | Purchases | Currency | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-------------|----------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 429.720 | USD | 460.000 | State Street Bank & Trust Company | 14/7/2022 | 1.251 |
| EUR | 12.566.714 | USD | 13.610.000 | Toronto Dominion Bank | 14/7/2022 | (110.389) |
| EUR | 4.887.881 | USD | 5.180.000 | UBS | 14/7/2022 | 62.944 |
| GBP | 360.000 | EUR | 422.055 | Deutsche Bank | 14/6/2022 | 859 |
| GBP | 44.961.991 | EUR | 53.700.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (883.317) |
| GBP | 4.610.000 | EUR | 5.426.945 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (11.595) |
| GBP | 18.610.686 | EUR | 21.830.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 31.904 |
| GBP | 71.155.770 | EUR | 84.713.590 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (1.127.170) |
| GBP | 18.464.961 | EUR | 22.200.000 | HSBC | 15/6/2022 | (509.279) |
| GBP | 18.461.498 | EUR | 22.200.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | (513.347) |
| GBP | 4.410.000 | EUR | 5.256.261 | Deutsche Bank | 14/7/2022 | (83.267) |
| GBP | 36.490.000 | EUR | 43.389.352 | JP Morgan | 14/7/2022 | (586.050) |
| GBP | 4.800.000 | EUR | 5.679.111 | Morgan Stanley | 14/7/2022 | (48.641) |
| GBP | 4.600.000 | EUR | 5.393.105 | UBS | 14/7/2022 | 2.763 |
| GBP | 30.633.817 | USD | 38.155.547 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 389.164 |
| GBP | 32.160.000 | USD | 39.532.690 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 897.195 |
| GBP | 29.250.000 | USD | 36.211.646 | HSBC | 15/6/2022 | 577.113 |
| GBP | 12.830.000 | USD | 16.904.385 | JP Morgan | 15/6/2022 | (699.171) |
| GBP | 4.656.182 | USD | 6.149.048 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (267.001) |
| NOK | 130.400.000 | EUR | 13.257.011 | Natwest Markets | 15/6/2022 | (343.433) |
| NOK | 131.600.000 | USD | 14.521.700 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (515.244) |
| NZD | 28.220.000 | USD | 19.469.791 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (1.035.830) |
| NZD | 35.530.000 | USD | 23.009.956 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 98.240 |
| SEK | 69.250.000 | EUR | 6.519.538 | Deutsche Bank | 14/7/2022 | 56.848 |
| USD | 22.995.568 | AUD | 32.010.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 12.170 |
| USD | 26.170.456 | CNH | 178.650.000 | HSBC | 15/6/2022 | (544.599) |
| USD | 14.144.205 | CNH | 90.000.000 | Standard Chartered Bank | 15/6/2022 | 621.341 |
| USD | 310.000 | EUR | 287.986 | Morgan Stanley | 1/6/2022 | 1.395 |
| USD | 110.380.244 | EUR | 103.660.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (683.503) |
| USD | 45.614.714 | EUR | 41.320.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 1.235.111 |
| USD | 43.590.842 | EUR | 40.800.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | (133.011) |
| USD | 104.002.905 | EUR | 95.718.397 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 1.308.520 |
| USD | 35.446.888 | EUR | 32.900.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 169.290 |
| USD | 49.650.633 | EUR | 46.150.000 | HSBC | 15/6/2022 | 170.319 |
| USD | 218.099.147 | EUR | 203.330.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 140.164 |
| USD | 32.521.034 | EUR | 29.750.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 589.688 |
| USD | 31.425.740 | GBP | 24.920.000 | Citibank | 15/6/2022 | 44.430 |
| USD | 17.616.873 | GBP | 14.050.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (69.260) |
| USD | 48.989.369 | GBP | 39.880.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | (1.143.477) |
| USD | 18.367.300 | GBP | 14.640.000 | HSBC | 15/6/2022 | (62.239) |
| USD | 24.790.953 | GBP | 18.870.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 961.583 |
| USD | 62.174.227 | GBP | 50.510.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (1.330.013) |
| USD | 18.852.020 | GBP | 15.010.000 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (44.669) |
| USD | 14.362.685 | NOK | 127.295.613 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 793.161 |
| USD | 485.709 | NOK | 4.304.387 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 26.865 |
| USD | 9.729.762 | NZD | 14.040.000 | HSBC | 15/6/2022 | 555.612 |
| USD | 9.260.107 | NZD | 14.180.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 32.486 |
| | | | | | | 9.040.091 |

| Currency | Purchases | Currency | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|-------------|----------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 113.110.732 | EUR | 108.668.747 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 1.381.208 |
| EUR | 6.423.157 | CHF | 6.696.352 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (91.994) |
| | | | | | | 1.289.214 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 209.181 | GBP | 179.558 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (1.744) |
| GBP | 5.948.191 | EUR | 6.942.058 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 45.259 |
| | | | | | | 43.515 |
| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 107 | JPY | 14.741 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | — |
| JPY | 576.372 | EUR | 4.179 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (1) |
| | | | | | | (1) |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 4.388.362 | USD | 4.633.568 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 65.589 |
| USD | 161.477.482 | EUR | 152.296.151 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (1.649.758) |
| | | | | | | (1.584.169) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 4.507.823.010) | | | | | | 8.788.650 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|---------------------------------------|--------------|
| Finanzen | 38,32 |
| Staatsanleihen | 20,55 |
| Mit Hypotheken besicherte Wertpapiere | 10,03 |
| Versorger | 4,10 |
| Zyklische Konsumgüter | 3,63 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 3,50 |
| Asset Backed Securities (ABS) | 3,32 |
| Kommunikation | 2,62 |
| Industrie | 1,42 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 1,36 |
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 1,23 |
| Grundstoffe | 0,91 |
| Technologie | 0,76 |
| Energie | 0,67 |
| Diversifiziert | 0,00 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 92,42 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 7,58 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|---------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Britische Jungferninseln | | | |
| | | | | USD 200.000 | Fortune Star BVI Ltd RegS 5,95% 29/1/2023 | 184.780 | 0,12 |
| | | | | USD 200.000 | Peak RE Bvi Holding Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 181.777 | 0,11 |
| | | | | USD 200.000 | RKPF Overseas '2019 A' Ltd RegS 6,70% 30/9/2024 | 140.490 | 0,09 |
| | | | | USD 200.000 | Sino-Ocean Land Treasure Finance II Ltd RegS 5,95% 4/2/2027 | 139.002 | 0,09 |
| | | | | USD 164.540 | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd RegS 6,75% 24/4/2033 | 152.510 | 0,10 |
| | | | | | | 798.559 | 0,51 |
| | | | | Kanada | | | |
| | | | | USD 30.000 | Bausch Health Cos Inc 5,50% 1/11/2025 | 26.491 | 0,02 |
| | | | | USD 35.000 | Bausch Health Cos Inc 5,75% 15/8/2027 | 28.169 | 0,02 |
| | | | | USD 45.000 | Canadian Pacific Railway Co 1,35% 2/12/2024 | 39.999 | 0,02 |
| | | | | USD 40.000 | Enbridge Inc 2,50% 15/1/2025 | 36.172 | 0,02 |
| | | | | | | 130.831 | 0,08 |
| | | | | Kaimaninseln | | | |
| | | | | USD 250.000 | AGL CLO 3 LTD '2020-3A D' FRN 15/1/2033 | 224.794 | 0,15 |
| | | | | USD 250.000 | Apidos CLO XXVI '2017-26A BR' FRN 18/7/2029 | 224.473 | 0,14 |
| | | | | USD 133.000 | Avolon Holdings Funding Ltd 2,528% 18/11/2027 | 107.167 | 0,07 |
| | | | | USD 250.000 | Bain Capital Credit CLO '2021- 3A D' Ltd FRN 24/7/2034 | 219.716 | 0,14 |
| | | | | USD 250.000 | Carbone Clo Ltd '2017-1A A1' FRN 20/1/2031 | 229.865 | 0,15 |
| | | | | USD 200.000 | China SCE Group Holdings Ltd RegS 7,25% 19/4/2023 | 126.955 | 0,08 |
| | | | | USD 200.000 | CIFI Holdings Group Co Ltd RegS 6,45% 7/11/2024 | 147.958 | 0,10 |
| | | | | USD 500.000 | Deer Creek Clo Ltd '2017-1A A' FRN 20/10/2030 | 461.602 | 0,30 |
| | | | | USD 200.000 | Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 15,00% 18/12/2022 | 20.363 | 0,01 |
| | | | | USD 200.000 | Grupo Aval Ltd 4,375% 4/2/2030 | 153.522 | 0,10 |
| | | | | USD 200.000 | Kaisa Group Holdings Ltd RegS 11,95% 22/10/2022 | 30.581 | 0,02 |
| | | | | USD 250.000 | Madison Park Funding XIII Ltd '2014-13A BR2' FRN 19/4/2030 | 231.833 | 0,15 |
| | | | | USD 250.000 | Marble Point CLO XVII Ltd '2020-1A D' FRN 20/4/2033 | 226.547 | 0,15 |
| | | | | USD 200.000 | Modern Land China Co Ltd RegS 12,85% 25/10/2022 | 34.819 | 0,02 |
| | | | | USD 250.000 | MP CLO VII Ltd '2015-1A CRR' FRN 18/10/2028 | 224.741 | 0,15 |
| | | | | USD 250.000 | Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 Ltd '2017- 26A BR' FRN 18/10/2030 | 231.236 | 0,15 |
| | | | | USD 300.000 | Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd '2019- 33A AR' FRN 16/10/2033 | 274.016 | 0,18 |
| | | | | USD 300.000 | Peace Park CLO Ltd '2021-1A A' FRN 20/10/2034 | 271.004 | 0,17 |
| | | | | USD 200.000 | Powerlong Real Estate Holdings Ltd RegS 7,125% 8/11/2022 | 61.610 | 0,04 |
| | | | | USD 250.000 | Regatta VIII Funding Ltd '2017- 1A D' FRN 17/10/2030 | 219.510 | 0,14 |
| STAMMAKTIEN | | | | | | | |
| Belgien | | | | | | | |
| 221 | Telenet Group Holding NV | 5.512 | 0,00 | | | | |
| | | 5.512 | 0,00 | | | | |
| Frankreich | | | | | | | |
| 798 | Electricite de France SA | 6.595 | 0,00 | | | | |
| | | 6.595 | 0,00 | | | | |
| Großbritannien | | | | | | | |
| 363 | Liberty Global Plc 'A' | 8.444 | 0,01 | | | | |
| | | 8.444 | 0,01 | | | | |
| Gesamt Stammaktien | | 20.551 | 0,01 | | | | |
| ANLEIHEN | | | | | | | |
| Argentinien | | | | | | | |
| USD 108.000 | Argentine Republic Government International Bond 1,125% 9/7/2035 | 27.674 | 0,02 | | | | |
| USD 9.230 | Genneia SA 8,75% 2/9/2027 | 8.494 | 0,00 | | | | |
| USD 24.000 | YPF SA 7,00% 15/12/2047 | 12.854 | 0,01 | | | | |
| | | 49.022 | 0,03 | | | | |
| Australien | | | | | | | |
| GBP 100.000 | APA Infrastructure Ltd RegS 4,25% 26/11/2024 | 120.706 | 0,08 | | | | |
| GBP 280.000 | BHP Billiton Finance Ltd RegS FRN 22/10/2077 | 332.335 | 0,21 | | | | |
| USD 75.000 | Macquarie Bank Ltd 2,10% 17/10/2022 | 69.950 | 0,05 | | | | |
| | | 522.991 | 0,34 | | | | |
| Österreich | | | | | | | |
| EUR 100.000 | ams-OSRAM AG RegS 2,125% 3/11/2027 | 80.593 | 0,05 | | | | |
| EUR 400.000 | BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029 | 395.556 | 0,26 | | | | |
| EUR 300.000 | BAWAG Group AG RegS FRN 23/9/2030 | 282.807 | 0,18 | | | | |
| USD 200.000 | Klabn Austria GmbH 3,20% 12/1/2031 | 152.969 | 0,10 | | | | |
| EUR 100.000 | Lenzing AG RegS FRN 31/12/2099 | 101.045 | 0,07 | | | | |
| EUR 708.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 2,10% 20/9/2117 | 658.759 | 0,42 | | | | |
| USD 25.000 | Suzano Austria GmbH 3,125% 15/1/2032 | 19.632 | 0,01 | | | | |
| | | 1.691.361 | 1,09 | | | | |
| Belgien | | | | | | | |
| EUR 685.268 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 22/10/2031 (Zero Coupon) | 588.892 | 0,38 | | | | |
| EUR 100.000 | Solvay SA RegS FRN 31/12/2099 | 92.169 | 0,06 | | | | |
| EUR 100.000 | Solvay SA RegS FRN 31/12/2099 | 100.772 | 0,06 | | | | |
| | | 781.833 | 0,50 | | | | |
| Bermuda | | | | | | | |
| USD 120.000 | Enstar Group Ltd 3,10% 1/9/2031 | 93.941 | 0,06 | | | | |
| | | 93.941 | 0,06 | | | | |
| Brasilien | | | | | | | |
| USD 12.000 | Oi SA 10,00% 27/7/2025 | 8.477 | 0,01 | | | | |
| | | 8.477 | 0,01 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------------|---|------------------|--------------|-------------------------------|--|------------------|--------------|
| Kaimaninseln Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | | |
| USD 355.000 | Ronshine China Holdings Ltd RegS 8,75% 25/10/2022 | 125.928 | 0,08 | GBP 100.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 24/5/2031 | 107.165 | 0,07 |
| USD 250.000 | RR 19 Ltd '2021-19A A2' FRN 15/10/2035 | 224.741 | 0,14 | USD 200.000 | BPCE SA 5,70% 22/10/2023 | 191.095 | 0,12 |
| USD 130.000 | Seagate HDD Cayman 4,091% 1/6/2029 | 115.262 | 0,07 | USD 200.000 | BPCE SA 4,875% 1/4/2026 | 187.853 | 0,12 |
| USD 200.000 | Seazen Group Ltd RegS 6,45% 11/6/2022 | 182.096 | 0,12 | GBP 100.000 | BPCE SA RegS FRN 30/11/2032 | 106.119 | 0,07 |
| USD 200.000 | Shui On Development Holding Ltd RegS 5,75% 12/11/2023 | 176.896 | 0,11 | EUR 200.000 | BPCE SA RegS FRN 13/10/2046 | 157.036 | 0,10 |
| USD 200.000 | Sunac China Holdings Ltd RegS 7,25% 14/6/2022 | 38.273 | 0,02 | GBP 400.000 | Credit Agricole SA 7,375% 18/12/2023 ^a | 497.304 | 0,32 |
| USD 110.973 | Treman Park CLO Ltd '2015-1AARR' FRN 20/10/2028 | 103.449 | 0,07 | USD 200.000 | Credit Agricole SA FRN 31/12/2099 | 160.133 | 0,10 |
| USD 200.000 | Yuzhou Group Holdings Co Ltd RegS 8,50% 4/2/2023 | 24.271 | 0,02 | EUR 100.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS FRN 25/10/2029 | 97.300 | 0,06 |
| | | 4.713.228 | 3,04 | GBP 400.000 | Electricite de France SA RegS FRN 31/12/2099 | 454.156 | 0,29 |
| China | | | | EUR 100.000 | Engie SA RegS FRN 31/12/2099 | 77.077 | 0,05 |
| CNY 2.430.000 | China Government Bond 3,72% 12/4/2051 (traded in China) | 365.309 | 0,23 | EUR 100.000 | Engie SA RegS FRN 31/12/2099 | 99.456 | 0,06 |
| CNY 270.000 | China Government Bond 3,72% 12/4/2051 (traded in Hong Kong) | 40.590 | 0,03 | EUR 100.000 | Faurecia SE RegS 2,75% 15/2/2027 | 86.047 | 0,06 |
| USD 200.000 | Guoren Property & Casualty Insurance Co Ltd RegS 3,35% 1/6/2026 | 174.342 | 0,11 | EUR 189.853 | FCT Autonoria '2019-1 B' RegS FRN 25/9/2035 | 188.268 | 0,12 |
| USD 200.000 | ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd RegS 3,125% 16/7/2025 | 172.512 | 0,11 | EUR 35.961 | FCT Noria '2018-1 C' RegS FRN 25/6/2038 | 35.737 | 0,02 |
| | | 752.753 | 0,48 | EUR 1.000.000 | Harmony French Home Loans FCT '2020-2 B' RegS FRN 27/8/2061 | 1.003.711 | 0,65 |
| Kolumbien | | | | EUR 300.000 | Harmony French Home Loans FCT '2021-1 B' RegS FRN 27/5/2061 | 299.160 | 0,19 |
| USD 231.000 | Colombia Government International Bond 4,50% 15/3/2029 | 199.874 | 0,13 | EUR 100.000 | Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement RegS 0,625% 16/9/2028 | 84.349 | 0,06 |
| USD 31.000 | Ecopetrol SA 6,875% 29/4/2030 | 29.155 | 0,02 | EUR 100.000 | Iliad SA RegS 1,875% 11/2/2028 | 85.645 | 0,06 |
| | | 229.029 | 0,15 | GBP 100.000 | Korian SA RegS FRN 31/12/2099 | 107.798 | 0,07 |
| Dänemark | | | | EUR 100.000 | La Financiere Atalian SASU RegS 5,125% 15/5/2025 | 88.019 | 0,06 |
| EUR 150.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 12/2/2030 | 141.672 | 0,09 | EUR 100.000 | La Poste SA RegS FRN 31/12/2099 | 94.705 | 0,06 |
| EUR 300.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 2/9/2030 | 279.351 | 0,18 | EUR 100.000 | Loxam SAS RegS 5,75% 15/7/2027 | 90.038 | 0,06 |
| | | 421.023 | 0,27 | GBP 250.000 | Orange SA RegS FRN 29/10/2049 | 298.044 | 0,19 |
| Dominikanische Republik | | | | USD 600.000 | Societe Generale SA FRN 21/1/2026 | 527.420 | 0,34 |
| USD 150.000 | Dominican Republic International Bond 5,50% 22/2/2029 | 133.055 | 0,09 | EUR 200.000 | Societe Generale SA RegS FRN 30/6/2031 | 178.996 | 0,12 |
| | | 133.055 | 0,09 | EUR 300.000 | Teleperformance RegS 1,50% 3/4/2024 | 299.778 | 0,19 |
| Frankreich | | | | EUR 100.000 | Tereos Finance Groupe I SA RegS 7,50% 30/10/2025 | 101.041 | 0,07 |
| EUR 27.000 | Accor SA RegS 0,70% 7/12/2027 | 12.855 | 0,01 | EUR 100.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 29/12/2049 | 98.039 | 0,06 |
| EUR 100.000 | Air France-KLM RegS 3,875% 1/7/2026 | 90.847 | 0,06 | EUR 100.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 82.750 | 0,05 |
| EUR 100.000 | Altice France SA RegS 5,875% 1/2/2027 | 95.774 | 0,06 | EUR 24.000 | Vallourec SA RegS 8,50% 30/6/2026 | 24.181 | 0,02 |
| EUR 100.000 | Altice France SA RegS 4,25% 15/10/2029 | 84.098 | 0,05 | | | 7.462.809 | 4,81 |
| EUR 355.000 | AXA SA RegS FRN 10/3/2043 | 354.759 | 0,23 | Deutschland | | | |
| EUR 300.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 3,00% 21/5/2024 ^a | 307.461 | 0,20 | EUR 200.000 | Allianz SE RegS FRN 31/12/2099 | 161.294 | 0,10 |
| USD 400.000 | BNP Paribas SA 3,80% 10/1/2024 | 374.594 | 0,24 | EUR 200.000 | Allianz SE RegS FRN 31/12/2099 | 165.676 | 0,11 |
| USD 250.000 | BNP Paribas SA 4,375% 28/9/2025 | 234.001 | 0,15 | EUR 83.000 | Bayer AG RegS FRN 1/7/2074 | 83.425 | 0,05 |
| | | | | EUR 300.000 | Bayer AG RegS FRN 12/11/2079 | 283.983 | 0,18 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|-------------|--|------------------------|--------------------|
| | Deutschland Fortsetzung | | | | Griechenland Fortsetzung | | |
| EUR 100.000 | Bertelsmann SE & Co KGaA RegS FRN 23/4/2075 | 100.076 | 0,06 | EUR 212.000 | Hellenic Republic Government Bond RegS 1,50% 18/6/2030 | 184.540 | 0,12 |
| EUR 100.000 | Cheplapharm Arzneimittel GmbH RegS 4,375% 15/1/2028 | 93.669 | 0,06 | EUR 305.000 | Hellenic Republic Government Bond RegS 1,875% 24/1/2052 | 193.827 | 0,13 |
| EUR 200.000 | Commerzbank AG RegS FRN 31/3/2099 | 198.488 | 0,13 | | | 4.518.982 | 2,91 |
| EUR 100.000 | Deutsche Bahn Finance GMBH RegS 1,125% 29/5/2051 | 69.538 | 0,04 | | Hongkong | | |
| GBP 100.000 | Deutsche Bank AG RegS 3,875% 12/2/2024 | 117.464 | 0,08 | USD 250.000 | Bank of East Asia Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 234.831 | 0,15 |
| GBP 300.000 | Deutsche Bank AG RegS 2,625% 16/12/2024 | 341.728 | 0,22 | | | 234.831 | 0,15 |
| GBP 300.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/6/2026 | 349.967 | 0,23 | | Indien | | |
| EUR 200.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 30/4/2027 | 176.332 | 0,11 | USD 200.000 | Power Finance Corp Ltd RegS 4,50% 18/6/2029 | 177.486 | 0,12 |
| EUR 100.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/5/2028 | 99.655 | 0,06 | USD 200.000 | ReNew Power Pvt Ltd RegS 6,45% 27/9/2022 | 187.631 | 0,12 |
| EUR 100.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/6/2032 | 96.048 | 0,06 | | | 365.117 | 0,24 |
| EUR 100.000 | Deutsche Lufthansa AG RegS 3,50% 14/7/2029 | 86.649 | 0,06 | | Indonesien | | |
| EUR 200.000 | EnBW Energie Baden- Wuerttemberg AG RegS FRN 31/8/2081 | 150.728 | 0,10 | USD 200.000 | Sarana Multi Infrastruktur Persero PT RegS 2,05% 11/5/2026 | 168.278 | 0,11 |
| EUR 100.000 | Gruenthal GmbH RegS 4,125% 15/5/2028 | 92.638 | 0,06 | | | 168.278 | 0,11 |
| EUR 100.000 | HeidelbergCement AG RegS 2,25% 3/6/2024 | 101.033 | 0,07 | | International | | |
| EUR 344.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 1,375% 7/6/2032 | 335.293 | 0,22 | USD 85.000 | Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3,625% 15/1/2024 | 79.727 | 0,05 |
| EUR 100.000 | LANXESS AG RegS FRN 6/12/2076 | 101.623 | 0,07 | USD 59.000 | Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 6,25% 15/5/2026^ | 54.592 | 0,04 |
| EUR 100.000 | LEG Immobilien SE RegS 1,50% 17/1/2034 | 77.157 | 0,05 | USD 115.000 | NXP BV / NXP Funding LLC 4,875% 1/3/2024 | 109.218 | 0,07 |
| EUR 64.000 | MTU Aero Engines AG RegS 3,00% 1/7/2025 | 65.564 | 0,04 | | | 243.537 | 0,16 |
| EUR 200.000 | Nidda Healthcare Holding GmbH RegS 3,50% 30/9/2024 | 186.356 | 0,12 | | Irland | | |
| EUR 200.000 | Red & Black Auto Germany 8 UG 'B' RegS FRN 15/9/2030 | 197.386 | 0,13 | USD 150.000 | AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 1,15% 29/10/2023 | 134.414 | 0,09 |
| EUR 100.000 | RWE AG RegS 2,75% 24/5/2030 | 99.398 | 0,06 | EUR 300.000 | AIB Group Plc RegS FRN 19/11/2029 | 285.021 | 0,18 |
| EUR 90.000 | TK Elevator Holdco GmbH RegS 6,625% 15/7/2028 | 81.026 | 0,05 | EUR 100.000 | AIB Group Plc RegS FRN 30/5/2031 | 94.545 | 0,06 |
| EUR 161.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,625% 19/7/2029 | 137.911 | 0,09 | EUR 200.000 | AIB Group Plc RegS FRN 31/12/2099 | 199.520 | 0,13 |
| EUR 100.000 | Vonovia SE RegS 1,50% 14/6/2041 | 68.552 | 0,04 | EUR 300.000 | Aquarius & Investments Plc for Zurich Insurance Co Ltd RegS FRN 2/10/2043 | 309.465 | 0,20 |
| EUR 100.000 | Vonovia SE RegS 1,625% 1/9/2051 | 61.159 | 0,04 | EUR 100.000 | Aurium CLO II DAC 'ERR' RegS FRN 22/6/2034 | 83.803 | 0,05 |
| EUR 100.000 | ZF Finance GmbH RegS 3,75% 21/9/2028 | 88.281 | 0,06 | GBP 350.000 | Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 19/9/2027 | 408.628 | 0,26 |
| | | 4.268.097 | 2,75 | EUR 200.000 | Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 11/8/2031 | 178.154 | 0,12 |
| | Griechenland | | | EUR 100.000 | BBAM European CLO I DAC 'ER' RegS FRN 22/7/2034 | 84.821 | 0,05 |
| EUR 2.772.000 | Hellenic Republic Government Bond RegS 12/2/2026 (Zero Coupon) | 2.534.162 | 1,63 | EUR 100.000 | CVC Cordatus Loan Fund XX DAC 'E' RegS FRN 22/6/2034 | 83.109 | 0,05 |
| EUR 1.244.000 | Hellenic Republic Government Bond RegS 2,00% 22/4/2027 | 1.226.696 | 0,79 | EUR 556.839 | Haus European Loan Conduit No 39 DAC 'A1' RegS FRN 28/7/2051 | 539.090 | 0,35 |
| EUR 360.000 | Hellenic Republic Government Bond RegS 3,875% 12/3/2029 | 379.757 | 0,24 | EUR 100.000 | Kerry Group Financial Services Unltd Co RegS 2,375% 10/9/2025 | 101.673 | 0,07 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------|---|------------------------|--------------------|----------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Irland Fortsetzung | | | | Italien Fortsetzung | | | |
| EUR 537.889 | Last Mile Securities PE '2021-X1 A1' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 527.723 | 0,34 | EUR 100.000 | Rekeep SpA RegS 7,25% 1/2/2026 | 98.473 | 0,06 |
| EUR 100.000 | Linde Plc RegS 1,00% 30/9/2051 | 61.383 | 0,04 | GBP 300.000 | Telecom Italia SpA 5,875% 19/5/2023 | 358.766 | 0,23 |
| EUR 100.000 | Northwoods Capital 21 Euro DAC '2020-21X ER' RegS FRN 22/7/2034 | 83.655 | 0,05 | | | 2.712.769 | 1,75 |
| EUR 100.000 | Northwoods Capital 23 Euro DAC '2021-23X E' RegS FRN 15/3/2034 | 83.365 | 0,05 | Japan | | | |
| EUR 100.000 | OCP Euro CLO '2019-3X ER' DAC RegS FRN 20/4/2033 | 85.282 | 0,06 | GBP 300.000 | Development Bank of Japan Inc RegS 1,25% 31/1/2025 | 344.266 | 0,22 |
| EUR 736.362 | Pearl Finance '2020-1 A1' DAC RegS FRN 17/11/2032 | 737.669 | 0,48 | USD 125.000 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3,455% 2/3/2023 | 117.417 | 0,08 |
| EUR 250.000 | Penta CLO 6 DAC '2019-6A B1R' FRN 25/7/2034 | 239.611 | 0,15 | USD 200.000 | Mizuho Financial Group Inc FRN 8/9/2024 | 180.602 | 0,12 |
| EUR 250.000 | Permanent TSB Group Holdings Plc RegS FRN 26/9/2024 | 246.090 | 0,16 | USD 200.000 | Nissan Motor Co Ltd 4,81% 17/9/2030 | 175.050 | 0,11 |
| EUR 350.000 | Rockford Tower Europe CLO '2019-1X B1' DAC RegS FRN 20/1/2033 | 334.800 | 0,22 | EUR 200.000 | Rakuten Group Inc RegS FRN 31/12/2099 | 161.518 | 0,10 |
| EUR 700.000 | SCF Rahoituspalvelut IX DAC 'B' RegS FRN 25/10/2030 | 696.892 | 0,45 | USD 200.000 | SoftBank Group Corp RegS FRN 31/12/2099 | 176.065 | 0,11 |
| USD 70.000 | Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2,875% 23/9/2023 | 65.144 | 0,04 | USD 100.000 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3,748% 19/7/2023 | 94.293 | 0,06 |
| EUR 151.531 | Taurus '2019-1FR A' DAC RegS FRN 2/2/2031 | 149.789 | 0,10 | | | 1.249.211 | 0,80 |
| GBP 191.258 | Taurus '2019-UK2 C' DAC RegS FRN 17/11/2029 | 223.734 | 0,14 | Jersey | | | |
| GBP 124.089 | Taurus '2021-UK1X A' DAC RegS FRN 17/5/2031 | 142.289 | 0,09 | USD 40.000 | Aptiv Plc 2,396% 18/2/2025 | 36.034 | 0,02 |
| | | 6.179.669 | 3,98 | GBP 190.000 | Glencore Finance Europe Ltd RegS 3,125% 26/3/2026 | 219.344 | 0,14 |
| Italien | | | | GBP 100.000 | Kane Bidco Ltd RegS 6,50% 15/2/2027 | 107.918 | 0,07 |
| EUR 321.000 | Autoflorence 2 Srl 'B' RegS FRN 24/12/2044 | 318.895 | 0,21 | | | 363.296 | 0,23 |
| EUR 100.000 | Autostrade per l'Italia SpA RegS 1,625% 25/1/2028 | 87.895 | 0,06 | Kuwait | | | |
| EUR 100.000 | Autostrade per l'Italia SpA RegS 2,00% 4/12/2028 | 87.525 | 0,06 | USD 200.000 | Burgan Bank SAK RegS FRN 15/12/2031 | 158.903 | 0,10 |
| EUR 100.000 | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA RegS 2,625% 28/4/2025 | 92.102 | 0,06 | | | 158.903 | 0,10 |
| EUR 100.000 | Centurion Bidco SpA RegS 5,875% 30/9/2026 | 94.289 | 0,06 | Luxemburg | | | |
| EUR 100.000 | doValue SpA RegS 3,375% 31/7/2026 | 92.971 | 0,06 | USD 7.000 | Atento Luxco 1 SA 8,00% 10/2/2026 | 5.240 | 0,00 |
| USD 200.000 | Enel SpA FRN 24/9/2073 | 196.500 | 0,13 | EUR 100.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1,336% 13/8/2041 | 69.528 | 0,05 |
| EUR 100.000 | Enel SpA RegS FRN 31/12/2099 | 85.222 | 0,05 | GBP 100.000 | Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl RegS 2,625% 20/10/2028 | 104.481 | 0,07 |
| EUR 250.000 | Eni SpA RegS 0,625% 19/9/2024 | 245.085 | 0,16 | EUR 100.000 | Cidron Aida Finco Sarl RegS 5,00% 1/4/2028 | 90.583 | 0,06 |
| EUR 150.000 | Eni SpA RegS FRN 31/12/2099 | 142.841 | 0,09 | EUR 100.000 | European TopSoho Sarl RegS 4,00% 21/9/2022 | 89.471 | 0,06 |
| EUR 100.000 | Gamma Bidco SpA RegS 5,125% 15/7/2025 | 96.221 | 0,06 | EUR 100.000 | Garfunkelux Holdco 3 SA RegS 6,75% 1/11/2025 | 94.929 | 0,06 |
| EUR 100.000 | Hera SpA RegS 2,50% 25/5/2029 | 99.009 | 0,06 | USD 40.000 | Gol Finance SA 7,00% 31/1/2025 | 30.159 | 0,02 |
| USD 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA 3,25% 23/9/2024 | 183.098 | 0,12 | EUR 100.000 | Herens Midco Sarl RegS 5,25% 15/5/2029 | 76.606 | 0,05 |
| EUR 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS FRN 31/12/2099 | 198.700 | 0,13 | EUR 100.000 | Lune Holdings Sarl RegS 5,625% 15/11/2028 | 89.500 | 0,06 |
| EUR 236.847 | Progetto Quinto Srl 'A' RegS FRN 27/10/2036 | 235.177 | 0,15 | EUR 100.000 | Rossini Sarl RegS 6,75% 30/10/2025 | 101.628 | 0,07 |
| | | | | EUR 452.295 | SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 B' RegS FRN 14/11/2034 | 450.235 | 0,29 |
| | | | | EUR 300.000 | SES SA RegS FRN 31/12/2099 | 270.591 | 0,17 |
| | | | | EUR 100.000 | Silver Arrow SA Compartment 10 'B' RegS FRN 15/3/2027 | 99.343 | 0,06 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|------------------------------|--|------------------------|--------------------|--------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Luxemburg Fortsetzung | | | | Niederlande Fortsetzung | | | |
| EUR 200.000 | Traton Finance Luxembourg SA RegS 14/6/2024 (Zero Coupon) | 192.676 | 0,12 | EUR 100.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 100.359 | 0,06 |
| EUR 100.000 | Traton Finance Luxembourg SA RegS 0,125% 24/3/2025 | 94.679 | 0,06 | EUR 170.000 | IMCD NV RegS 2,125% 31/3/2027 | 161.471 | 0,10 |
| | | 1.859.649 | 1,20 | EUR 400.000 | ING Groep NV RegS FRN 23/5/2026 | 398.488 | 0,26 |
| Marshall-Inseln | | | | EUR 300.000 | ING Groep NV RegS FRN 16/2/2027 | 286.779 | 0,19 |
| USD 107.000 | Danaos Corp 8,50% 1/3/2028 | 104.108 | 0,07 | USD 300.000 | ING Groep NV RegS FRN 22/3/2028 | 280.559 | 0,18 |
| | | 104.108 | 0,07 | EUR 230.495 | Jubilee Place '2020-1 A' BV RegS FRN 17/10/2057 | 229.710 | 0,15 |
| Mauritius | | | | EUR 215.000 | Jubilee Place 'B' RegS FRN 17/1/2059 | 210.775 | 0,14 |
| USD 196.000 | Clean Renewable Power Mauritius Pte Ltd RegS 4,25% 25/3/2027 | 163.787 | 0,10 | USD 42.000 | LYB International Finance BV 4,00% 15/7/2023 | 39.661 | 0,03 |
| USD 200.000 | Network i2i Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 184.612 | 0,12 | EUR 42.411 | Magoi '2019-1 B' BV RegS FRN 27/7/2039 | 42.239 | 0,03 |
| | | 348.399 | 0,22 | EUR 300.000 | Naturgy Finance BV RegS FRN 29/11/2049 | 301.949 | 0,19 |
| Mexiko | | | | EUR 200.000 | NN Group NV RegS FRN 8/4/2044 | 206.708 | 0,13 |
| USD 8.000 | Grupo Televisa SAB 6,625% 15/1/2040 | 8.336 | 0,01 | EUR 160.000 | Novo Nordisk Finance Netherlands BV RegS 0,75% 31/3/2025 | 157.790 | 0,10 |
| MXN 1.000.000 | Mexican Bonos 7,75% 13/11/2042 | 42.952 | 0,03 | EUR 100.000 | Repsol International Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 90.104 | 0,06 |
| USD 200.000 | Mexico Government International Bond 4,40% 12/2/2052 | 155.246 | 0,10 | EUR 100.000 | Repsol International Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 94.269 | 0,06 |
| MXN 501.300 | Petroleos Mexicanos 7,19% 12/9/2024 | 22.166 | 0,01 | EUR 280.000 | Stellantis NV RegS 3,375% 7/7/2023 | 285.961 | 0,18 |
| USD 12.000 | Petroleos Mexicanos 6,875% 16/10/2025 | 11.256 | 0,01 | EUR 300.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 245.013 | 0,16 |
| USD 371.000 | Petroleos Mexicanos 6,70% 16/2/2032 | 301.378 | 0,19 | EUR 400.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 405.584 | 0,26 |
| USD 34.000 | Petroleos Mexicanos 6,75% 21/9/2047 | 22.883 | 0,02 | EUR 100.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4,50% 1/3/2025 | 99.941 | 0,06 |
| EUR 770.000 | Petroleos Mexicanos RegS 3,75% 21/2/2024 | 763.821 | 0,49 | EUR 100.000 | United Group BV RegS 4,875% 1/7/2024 | 97.002 | 0,06 |
| | | 1.328.038 | 0,86 | EUR 120.000 | Viterra Finance BV RegS 0,375% 24/9/2025 | 110.399 | 0,07 |
| Niederlande | | | | EUR 300.000 | Viterra Finance BV RegS 1,00% 24/9/2028 | 255.687 | 0,17 |
| EUR 140.000 | ABB Finance BV RegS 0,625% 31/3/2024 | 138.852 | 0,09 | GBP 200.000 | Volkswagen Financial Services NV RegS 1,625% 30/11/2022 | 234.030 | 0,15 |
| EUR 100.000 | ABN AMRO Bank NV RegS 2,375% 1/6/2027 | 99.368 | 0,06 | GBP 200.000 | Volkswagen Financial Services NV RegS 1,125% 18/9/2023 | 229.257 | 0,15 |
| USD 400.000 | ABN AMRO Bank NV RegS FRN 27/3/2028 | 373.489 | 0,24 | EUR 300.000 | Volkswagen International Finance NV RegS FRN 31/12/2099 | 301.215 | 0,19 |
| EUR 100.000 | Achmea BV RegS FRN 4/4/2043 | 103.000 | 0,07 | EUR 100.000 | Volkswagen International Finance NV RegS FRN 31/12/2099 | 94.519 | 0,06 |
| EUR 300.000 | Aegon NV RegS FRN 25/4/2044 | 307.785 | 0,20 | EUR 100.000 | Volkswagen International Finance NV RegS FRN 31/12/2099 | 95.806 | 0,06 |
| EUR 100.000 | Conti-Gummi Finance BV 2,125% 27/11/2023 | 101.138 | 0,07 | EUR 100.000 | VZ Secured Financing BV RegS 3,50% 15/1/2032 | 84.338 | 0,05 |
| EUR 200.000 | de Volksbank NV RegS FRN 4/5/2027 | 197.460 | 0,13 | EUR 200.000 | Wintershall Dea Finance BV RegS 0,452% 25/9/2023 | 196.330 | 0,13 |
| EUR 336.687 | Domi '2021-1 A' BV RegS FRN 15/6/2053 | 334.054 | 0,22 | EUR 100.000 | Wintershall Dea Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 83.000 | 0,05 |
| EUR 483.879 | Dutch Property Finance '2020-2 A' BV RegS FRN 28/1/2058 | 481.715 | 0,31 | EUR 100.000 | Wolters Kluwer NV RegS 0,75% 3/7/2030 | 87.042 | 0,06 |
| EUR 458.871 | Dutch Property Finance '2021-1 A' BV RegS FRN 28/7/2058 | 454.488 | 0,29 | | | 8.635.916 | 5,57 |
| EUR 100.000 | ELM BV for Firmenich International SA RegS FRN 31/12/2099 | 99.766 | 0,06 | | | | |
| USD 194.000 | Greenko Dutch BV RegS 3,85% 29/3/2026 | 166.593 | 0,11 | | | | |
| EUR 200.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 185.534 | 0,12 | | | | |
| EUR 100.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 86.689 | 0,06 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------|--|------------------------|--------------------|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Neuseeland | | | | Spanien Fortsetzung | | | |
| NZD 60.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 3,00% 20/9/2030 | 47.526 | 0,03 | EUR 100.000 | eDreams ODIGEO SA RegS 5,50% 15/7/2027 | 90.949 | 0,06 |
| | | 47.526 | 0,03 | EUR 100.000 | Food Service Project SA RegS 5,50% 21/1/2027 | 92.088 | 0,06 |
| Norwegen | | | | EUR 252.816 | FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 A' RegS FRN 20/3/2033 | 252.729 | 0,16 |
| EUR 100.000 | Aker BP ASA RegS 1,125% 12/5/2029 | 88.471 | 0,06 | EUR 100.000 | International Consolidated Airlines Group SA RegS 1,125% 18/5/2028 | 78.405 | 0,05 |
| | | 88.471 | 0,06 | EUR 100.000 | Kaixo Bondco Telecom SA RegS 5,125% 30/9/2029 | 84.501 | 0,06 |
| Philippinen | | | | EUR 100.000 | Lorca Telecom Bondco SA RegS 4,00% 18/9/2027 | 93.935 | 0,06 |
| USD 200.000 | Rizal Commercial Banking Corp RegS FRN 31/12/2099 | 181.374 | 0,12 | | | 4.299.460 | 2,77 |
| | | 181.374 | 0,12 | Supranationale Anleihen | | | |
| Portugal | | | | EUR 76.000 | International Bank for Reconstruction & Development 0,20% 21/1/2061 | 39.957 | 0,03 |
| EUR 75.813 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 1,00% 12/4/2052 | 47.094 | 0,03 | | | 39.957 | 0,03 |
| EUR 200.000 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Viriato Finance No 1 'B' RegS FRN 28/10/2040 | 197.397 | 0,13 | Schweden | | | |
| | | 244.491 | 0,16 | EUR 200.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS FRN 31/10/2028 | 198.486 | 0,13 |
| Russland | | | | EUR 150.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS FRN 5/3/2029 | 148.094 | 0,10 |
| RUB 7.502.000 | Russian Federal Bond - OFZ 6,10% 18/7/2035 | 7.527 | 0,00 | EUR 100.000 | Verisure Holding AB RegS 3,875% 15/7/2026 | 93.583 | 0,06 |
| | | 7.527 | 0,00 | EUR 300.000 | Volvo Treasury AB RegS FRN 15/11/2023 | 301.884 | 0,19 |
| Singapur | | | | EUR 160.000 | Volvo Treasury AB RegS 1,625% 18/9/2025 | 159.430 | 0,10 |
| USD 200.000 | GLP Pte Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 163.888 | 0,10 | | | 901.477 | 0,58 |
| USD 200.000 | LMIRT Capital Pte Ltd RegS 7,25% 19/6/2024 | 184.831 | 0,12 | Schweiz | | | |
| | | 348.719 | 0,22 | USD 250.000 | Credit Suisse AG 0,495% 2/2/2024 | 222.938 | 0,14 |
| Südkorea | | | | GBP 271.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 12/9/2025 | 305.828 | 0,20 |
| USD 200.000 | Tongyang Life Insurance Co Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 181.797 | 0,12 | EUR 350.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2026 | 351.981 | 0,23 |
| | | 181.797 | 0,12 | EUR 750.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 13/10/2026 | 726.060 | 0,47 |
| Spanien | | | | GBP 250.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 9/6/2028 | 266.978 | 0,17 |
| EUR 400.000 | Amadeus IT Group SA RegS FRN 25/1/2024 | 400.424 | 0,26 | GBP 165.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 15/11/2029 | 167.920 | 0,11 |
| EUR 400.000 | Autonoria Spain 2021 FT 'B' RegS FRN 31/1/2039 | 392.877 | 0,25 | USD 200.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 29/12/2049 | 181.463 | 0,12 |
| EUR 200.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argenteria SA RegS 1,125% 28/2/2024 | 199.784 | 0,13 | USD 350.000 | UBS AG RegS 5,125% 15/5/2024 | 332.138 | 0,21 |
| EUR 100.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argenteria SA RegS FRN 16/1/2030 | 93.702 | 0,06 | | | 2.555.306 | 1,65 |
| EUR 500.000 | Banco de Sabadell SA RegS 0,875% 22/7/2025 | 475.700 | 0,31 | Thailand | | | |
| EUR 100.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 24/3/2026 | 97.616 | 0,06 | USD 200.000 | Bangkok Bank PCL RegS FRN 25/9/2034 | 167.746 | 0,11 |
| GBP 400.000 | Banco Santander SA RegS 2,75% 12/9/2023 | 467.802 | 0,30 | | | 167.746 | 0,11 |
| EUR 249.412 | BBVA Consumer Auto '2020-1 A' FTA RegS FRN 20/1/2036 | 250.157 | 0,16 | Großbritannien | | | |
| EUR 400.000 | CaixaBank SA RegS 1,00% 25/6/2024 | 394.636 | 0,25 | GBP 300.000 | Annington Funding Plc RegS 2,308% 6/10/2032 | 300.335 | 0,19 |
| EUR 200.000 | CaixaBank SA RegS FRN 15/2/2029 | 201.966 | 0,13 | GBP 238.838 | Atlas Funding '2021-1 A' Plc RegS FRN 25/7/2058 | 280.110 | 0,18 |
| EUR 400.000 | Cellnex Finance Co SA RegS 2,25% 12/4/2026 | 387.140 | 0,25 | USD 27.532 | Avianca Midco 2 Ltd 9,00% 1/12/2028 | 23.427 | 0,02 |
| EUR 100.000 | Cellnex Finance Co SA RegS 0,75% 15/11/2026 | 88.669 | 0,06 | GBP 200.000 | Aviva Plc FRN 29/9/2049 | 236.771 | 0,15 |
| EUR 200.000 | Cellnex Telecom SA RegS 0,75% 20/11/2031 | 156.380 | 0,10 | GBP 73.016 | Azure Finance NO 2 Plc 'A' RegS FRN 20/7/2030 | 85.810 | 0,06 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-------------|--|------------------------|--------------------|-------------|--|------------------------|--------------------|
| | Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | |
| USD 300.000 | Barclays Bank Plc 7,625% 21/11/2022 | 284.935 | 0,18 | GBP 444.000 | Lloyds Bank Plc RegS 7,625% 22/4/2025 [^] | 576.880 | 0,37 |
| EUR 260.000 | Barclays Plc RegS FRN 31/1/2027 | 260.473 | 0,17 | USD 200.000 | Lloyds Banking Group Plc 4,582% 10/12/2025 | 187.636 | 0,12 |
| EUR 100.000 | Barclays Plc RegS FRN 9/8/2029 | 85.398 | 0,06 | GBP 218.000 | Lloyds Banking Group Plc FRN 15/12/2031 | 231.222 | 0,15 |
| GBP 100.000 | Bellis Acquisition Co Plc RegS 3,25% 16/2/2026 | 99.805 | 0,06 | GBP 300.000 | Lloyds Banking Group Plc RegS 2,25% 16/10/2024 | 343.875 | 0,22 |
| GBP 54.941 | Brass NO 8 Plc 'A2' RegS FRN 16/11/2066 | 64.598 | 0,04 | GBP 277.555 | London Wall Mortgage Capital Plc '2021-FL1 A' RegS FRN 15/5/2051 | 322.042 | 0,21 |
| EUR 170.000 | British American Tobacco Plc RegS FRN 31/12/2099 | 143.014 | 0,09 | GBP 250.000 | Market Bidco Finco Plc RegS 5,50% 4/11/2027 | 254.865 | 0,16 |
| EUR 200.000 | British Telecommunications Plc RegS 1,00% 21/11/2024 | 196.844 | 0,13 | GBP 283.000 | Mitchells & Butlers Finance Plc RegS FRN 15/9/2034 | 266.221 | 0,17 |
| EUR 100.000 | British Telecommunications Plc RegS FRN 18/8/2080 | 92.762 | 0,06 | GBP 412.173 | Mortimer BTL '2021-1 A' Plc RegS FRN 23/6/2053 | 472.047 | 0,30 |
| GBP 100.000 | BUPA Finance Plc RegS 5,00% 25/4/2023 | 119.480 | 0,08 | USD 200.000 | NatWest Group Plc 3,875% 12/9/2023 | 187.725 | 0,12 |
| GBP 133.173 | CMF '2020-1 A' Plc RegS FRN 16/1/2057 | 155.622 | 0,10 | USD 250.000 | NatWest Group Plc FRN 25/6/2024 | 235.625 | 0,15 |
| USD 300.000 | Coca-Cola Europacific Partners Plc 0,80% 3/5/2024 | 266.203 | 0,17 | GBP 110.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 29/3/2029 | 127.107 | 0,08 |
| GBP 100.000 | Constellation Automotive Financing Plc RegS 4,875% 15/7/2027 | 95.500 | 0,06 | GBP 873.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 14/8/2030 | 995.997 | 0,64 |
| GBP 400.000 | Dowson '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/10/2028 | 463.950 | 0,30 | GBP 215.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 28/11/2031 | 228.229 | 0,15 |
| EUR 100.000 | eG Global Finance Plc RegS 6,25% 30/10/2025 | 96.498 | 0,06 | GBP 312.000 | Newday Funding Master Issuer Plc '2021-1X A1' RegS FRN 15/3/2029 | 364.277 | 0,23 |
| GBP 720.538 | Elvet Mortgages '2020-1 A' Plc FRN 22/3/2065 | 844.538 | 0,54 | GBP 350.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 18/6/2073 | 413.851 | 0,27 |
| GBP 102.723 | Finsbury Square '2020-2X A' Plc RegS FRN 16/6/2070 | 120.812 | 0,08 | EUR 100.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 5/12/2079 | 95.678 | 0,06 |
| GBP 0 | Friary No 4 Plc 'A' RegS FRN 21/1/2050 | — | 0,00 | GBP 765.811 | Oat Hill NO 2 Plc 'A' RegS FRN 27/5/2046 | 899.132 | 0,58 |
| GBP 565.594 | Gemgarto '2018-1 A' Plc RegS FRN 16/9/2065 | 665.067 | 0,43 | GBP 100.000 | Ocado Group Plc RegS 3,875% 8/10/2026 | 96.684 | 0,06 |
| GBP 432.250 | Gemgarto '2021-1X A' Plc RegS FRN 16/12/2067 | 505.430 | 0,33 | GBP 85.105 | Orbita Funding '2020-1 A' Plc RegS FRN 17/3/2027 | 99.945 | 0,06 |
| GBP 314.240 | Gosforth Funding '2018-1X A2' Plc RegS FRN 25/8/2060 | 369.980 | 0,24 | GBP 260.000 | PCL Funding IV Plc '2020-1 B' RegS FRN 15/9/2024 | 305.399 | 0,20 |
| GBP 100.000 | GSK Consumer Healthcare Capital UK Plc RegS 2,875% 29/10/2028 | 115.834 | 0,07 | GBP 370.000 | PCL Funding V Plc '2021-1 A' RegS FRN 15/10/2025 | 433.326 | 0,28 |
| GBP 274.323 | Hops Hill No 1 Plc 'A' RegS FRN 27/5/2054 | 320.716 | 0,21 | GBP 100.000 | Phoenix Group Holdings Plc RegS 4,125% 20/7/2022 | 117.705 | 0,08 |
| GBP 99.994 | Hops Hill No 1 Plc 'B' RegS FRN 27/5/2054 | 116.729 | 0,08 | GBP 577.166 | Pierpont BTL '2021-1 A' Plc RegS FRN 22/12/2053 | 666.296 | 0,43 |
| USD 30.000 | HSBC Bank Plc FRN 29/6/2049 | 22.296 | 0,01 | GBP 802.000 | Pierpont BTL '2021-1 B' Plc RegS FRN 22/12/2053 | 916.238 | 0,59 |
| USD 200.000 | HSBC Holdings Plc 4,25% 14/3/2024 | 189.227 | 0,12 | GBP 370.000 | Precise Mortgage Funding '2019-1B A2' Plc RegS FRN 12/12/2055 | 434.604 | 0,28 |
| GBP 150.000 | HSBC Holdings Plc RegS 5,75% 20/12/2027 | 187.081 | 0,12 | GBP 402.058 | Prs Finance Plc RegS 1,75% 24/11/2026 | 461.751 | 0,30 |
| EUR 100.000 | Informa Plc RegS 1,50% 5/7/2023 | 100.167 | 0,06 | GBP 300.000 | Prs Finance Plc RegS 2,00% 23/1/2029 | 342.764 | 0,22 |
| EUR 100.000 | Informa Plc RegS 2,125% 6/10/2025 | 99.100 | 0,06 | GBP 348.502 | Residential Mortgage Securities 32 Plc 'A' RegS FRN 20/6/2070 | 409.672 | 0,26 |
| EUR 100.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc RegS 4,50% 15/7/2028 | 81.626 | 0,05 | GBP 135.000 | RMAC NO 2 Plc '2018-2 B' RegS FRN 12/6/2046 | 158.746 | 0,10 |
| GBP 100.000 | Jerrold Finco Plc RegS 5,25% 15/1/2027 | 110.205 | 0,07 | GBP 385.000 | Sage AR Funding No 1 Plc 'B' RegS FRN 17/11/2030 | 445.767 | 0,29 |
| GBP 94.500 | Lanark Master Issuer Plc '2020- 1X 2A' RegS FRN 22/12/2069 | 111.086 | 0,07 | GBP 395.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 17/1/2029 | 428.658 | 0,28 |
| GBP 345.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2020-1 B' Plc RegS FRN 12/6/2057 | 406.747 | 0,26 | USD 193.082 | SCC Power Plc 8,00% 31/12/2028 | 86.515 | 0,06 |
| GBP 173.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2021-1 B' Plc Regs FRN 20/7/2058 | 196.778 | 0,13 | GBP 100.000 | Sherwood Financing Plc RegS 6,00% 15/11/2026 | 102.938 | 0,07 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| GBP 237.722 | Silk Road Finance Number Six Plc '2019-2 A' RegS FRN 21/9/2067 | 279.750 | 0,18 | USD 288.786 | American Airlines '2017-1 B' Pass Through Trust 4,95% 15/2/2025 | 249.306 | 0,16 |
| GBP 431.100 | Silverstone Master Issuer Plc '2020-1X 1A' RegS FRN 21/1/2070 | 506.211 | 0,33 | USD 60.000 | American Express Co 3,375% 3/5/2024 | 56.215 | 0,04 |
| GBP 300.000 | SSE Plc RegS FRN 16/9/2077 | 352.304 | 0,23 | USD 85.000 | American Honda Finance Corp 3,55% 12/1/2024 | 80.063 | 0,05 |
| USD 350.000 | Standard Chartered Plc FRN 30/3/2026 | 323.964 | 0,21 | USD 50.000 | American International Group Inc 2,50% 30/6/2025 | 45.096 | 0,03 |
| USD 450.000 | Standard Chartered Plc RegS FRN 12/2/2030 | 405.342 | 0,26 | USD 75.000 | American Tower Corp 3,00% 15/6/2023 | 70.325 | 0,05 |
| EUR 200.000 | Standard Chartered Plc RegS FRN 23/9/2031 | 179.524 | 0,12 | USD 40.000 | American Tower Corp 0,60% 15/1/2024 | 35.861 | 0,02 |
| GBP 100.000 | Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc RegS 8,25% 31/7/2025 | 115.133 | 0,07 | USD 160.000 | Amkor Technology Inc 6,625% 15/9/2027 | 148.583 | 0,10 |
| GBP 83.749 | Tesco Property Finance 3 Plc RegS 5,744% 13/4/2040 | 109.455 | 0,07 | USD 15.000 | Analog Devices Inc FRN 1/10/2024 | 13.896 | 0,01 |
| GBP 150.000 | Thames Water Utilities Finance Plc FRN 13/9/2030 | 177.587 | 0,11 | EUR 100.000 | Apple Inc 0,50% 15/11/2031 | 87.054 | 0,06 |
| GBP 157.000 | Together Asset Backed Securitisation '2021-1ST1 B' Plc RegS FRN 12/7/2063 | 178.109 | 0,12 | USD 250.000 | Ares Capital Corp 4,25% 1/3/2025 | 229.455 | 0,15 |
| GBP 171.000 | Tower Bridge Funding '2022-1X B' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 194.252 | 0,13 | USD 150.000 | Ares Capital Corp 3,20% 15/11/2031 | 109.171 | 0,07 |
| GBP 100.000 | Travis Perkins Plc RegS 4,50% 7/9/2023 | 117.069 | 0,08 | USD 205.000 | AT&T Inc 0,90% 25/3/2024 | 184.490 | 0,12 |
| GBP 376.635 | Turbo Finance 9 Plc 'A' RegS FRN 20/8/2028 | 442.592 | 0,29 | USD 65.000 | Atmos Energy Corp 0,625% 9/3/2023 | 59.886 | 0,04 |
| GBP 183.593 | Twin Bridges '2018-1 A' Plc RegS FRN 12/9/2050 | 215.338 | 0,14 | USD 200.000 | BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2015-200P B' 3,49% 14/4/2033 | 183.919 | 0,12 |
| GBP 146.672 | Twin Bridges '2019-1 A' Plc RegS FRN 12/12/2052 | 172.451 | 0,11 | USD 74.000 | BANK '2017-BNK5 C' FRN 15/6/2060 | 65.287 | 0,04 |
| GBP 274.000 | Twin Bridges '2021-2 B' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 305.440 | 0,20 | USD 65.000 | BANK '2017-BNK8 B' FRN 15/11/2050 | 57.956 | 0,04 |
| GBP 100.000 | Very Group Funding Plc RegS 6,50% 1/8/2026 | 99.065 | 0,06 | USD 315.000 | Bank of America Corp FRN 23/7/2024 | 295.671 | 0,19 |
| EUR 100.000 | Virgin Money UK Plc RegS FRN 27/5/2024 | 98.811 | 0,06 | USD 55.000 | Bank of America Corp FRN 22/4/2025 | 50.973 | 0,03 |
| EUR 150.000 | Virgin Money UK Plc RegS FRN 24/6/2025 | 150.656 | 0,10 | USD 70.000 | Bank of America Corp FRN 2/4/2026 | 64.272 | 0,04 |
| EUR 100.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc RegS 3,25% 31/1/2031 | 85.332 | 0,06 | USD 341.000 | Bank of America Corp FRN 27/4/2028 | 320.825 | 0,21 |
| EUR 100.000 | Vodafone Group Plc RegS FRN 3/1/2079 | 100.161 | 0,06 | USD 165.000 | Bank of America Corp FRN 27/4/2033 | 155.660 | 0,10 |
| GBP 115.000 | Yorkshire Building Society RegS FRN 11/10/2030 | 129.536 | 0,08 | USD 460.000 | Bank of America Corp FRN 31/12/2099 | 378.893 | 0,24 |
| | | 24.362.453 | 15,70 | EUR 500.000 | Bank of America Corp RegS FRN 22/9/2026 | 501.375 | 0,32 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | GBP 225.000 | Bank of America Corp RegS FRN 27/4/2031 | 262.608 | 0,17 |
| USD 55.000 | 7-Eleven Inc 0,80% 10/2/2024 | 49.187 | 0,03 | EUR 100.000 | Bank of America Corp RegS FRN 27/4/2033 | 98.930 | 0,06 |
| USD 125.000 | AbbVie Inc 3,25% 1/10/2022 | 116.906 | 0,08 | USD 55.000 | BAT Capital Corp 3,222% 15/8/2024 | 51.015 | 0,03 |
| EUR 200.000 | AbbVie Inc 1,375% 17/5/2024 | 200.196 | 0,13 | USD 30.000 | BAT Capital Corp 2,789% 6/9/2024 | 27.514 | 0,02 |
| USD 95.000 | AbbVie Inc 2,60% 21/11/2024 | 87.344 | 0,06 | USD 60.000 | BAT Capital Corp 2,259% 25/3/2028 | 48.362 | 0,03 |
| USD 100.000 | Air Lease Corp FRN 15/12/2022 | 93.306 | 0,06 | USD 70.000 | BAT Capital Corp 4,906% 2/4/2030 | 63.414 | 0,04 |
| USD 35.000 | Air Lease Corp 0,80% 18/8/2024 | 30.494 | 0,02 | USD 35.000 | Baxter International Inc 1,322% 29/11/2024 | 31.021 | 0,02 |
| USD 82.136 | Ajax Mortgage Loan Trust '2021-G A' FRN 25/6/2061 | 71.247 | 0,05 | USD 76.000 | Baylor Scott & White Holdings 2,839% 15/11/2050 | 53.029 | 0,03 |
| USD 85.000 | Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC 3,50% 15/2/2023 | 79.386 | 0,05 | USD 100.000 | BBCMS '2017-DELIC E' Mortgage Trust FRN 15/8/2036 | 89.618 | 0,06 |
| USD 330.000 | Altria Group Inc 2,45% 4/2/2032 | 248.484 | 0,16 | USD 100.000 | BBCMS '2017-DELIC F' Mortgage Trust FRN 15/8/2036 | 89.390 | 0,06 |
| USD 14.262 | American Airlines '2013-2 A' Pass Through Trust 4,95% 15/1/2023 | 13.298 | 0,01 | USD 14.000 | Becton Dickinson and Co 3,734% 15/12/2024 | 13.204 | 0,01 |
| USD 147.625 | American Airlines '2016-1 AA' Pass Through Trust 3,575% 15/1/2028 | 129.898 | 0,08 | USD 160.000 | BHMS '2018-ATLS A' FRN 15/7/2035 | 146.285 | 0,09 |
| | | | | USD 224.000 | BHMS '2018-ATLS B' FRN 15/7/2035 | 204.450 | 0,13 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|---|------------------------|--------------------|-------------|--|------------------------|--------------------|
| | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | |
| USD 166.000 | BHMS '2018-ATLS C' FRN 15/7/2035 | 150.760 | 0,10 | USD 168.122 | COMM '2015-CR27 B' Mortgage Trust FRN 10/10/2048 | 152.388 | 0,10 |
| USD 35.000 | BMW US Capital LLC 0,75% 12/8/2024 | 31.006 | 0,02 | USD 200.000 | Commercial Metals Co 4,875% 15/5/2023 | 189.514 | 0,12 |
| EUR 100.000 | Boxer Parent Co Inc RegS 6,50% 2/10/2025 | 97.965 | 0,06 | USD 5.000 | Commonwealth Financing Authority 4,144% 1/6/2038 | 4.470 | 0,00 |
| USD 15.000 | BP Capital Markets America Inc 3,79% 6/2/2024 | 14.204 | 0,01 | USD 75.000 | Commonwealth of Massachusetts 2,90% 1/9/2049 | 54.098 | 0,04 |
| USD 145.000 | Broadcom Inc 4,11% 15/9/2028 | 131.651 | 0,09 | USD 10.000 | County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3,454% 1/10/2030 | 9.039 | 0,01 |
| USD 100.000 | BX Trust '2018-BILT D' FRN 15/5/2030 | 89.889 | 0,06 | USD 120.000 | County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 4,062% 1/10/2031 | 112.896 | 0,07 |
| USD 100.000 | Capital One Financial Corp FRN 6/12/2024 | 90.113 | 0,06 | USD 472.741 | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp '2005-12 2A1' 6,50% 25/1/2036 | 322.988 | 0,21 |
| USD 20.000 | Capital One Financial Corp FRN 3/3/2026 | 17.980 | 0,01 | USD 100.000 | Crown Castle International Corp 3,15% 15/7/2023 | 93.492 | 0,06 |
| USD 357.000 | Cargo Aircraft Management Inc 4,75% 1/2/2028 | 324.083 | 0,21 | USD 50.000 | Crown Castle International Corp 3,20% 1/9/2024 | 46.395 | 0,03 |
| USD 25.000 | Caterpillar Financial Services Corp 3,40% 13/5/2025 | 23.488 | 0,02 | USD 50.000 | Crown Castle International Corp 3,30% 1/7/2030 | 42.465 | 0,03 |
| USD 100.000 | Central Puget Sound Regional Transit Authority 'S1' 5,00% 1/11/2041 | 102.073 | 0,07 | USD 40.000 | CSAIL '2015-C4 C' Commercial Mortgage Trust FRN 15/11/2048 | 35.404 | 0,02 |
| USD 5.326.403 | CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C4 XA' FRN 10/5/2058 | 245.617 | 0,16 | USD 29.000 | CSAIL '2015-C4 D' Commercial Mortgage Trust FRN 15/11/2048 | 24.164 | 0,02 |
| USD 100.000 | CFCRE Commercial Mortgage Trust '2018-TAN E' FRN 15/2/2033 | 92.433 | 0,06 | USD 160.000 | CSAIL '2018-CX12 C' Commercial Mortgage Trust FRN 15/8/2051 | 144.244 | 0,09 |
| USD 40.000 | Charles Schwab Corp FRN 13/5/2026 | 36.744 | 0,02 | USD 150.000 | Daimler Finance North America LLC 0,75% 1/3/2024 | 134.338 | 0,09 |
| USD 82.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4,464% 23/7/2022 | 76.557 | 0,05 | USD 70.000 | Dell International LLC / EMC Corp 5,85% 15/7/2025 | 68.555 | 0,04 |
| USD 160.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4,50% 1/2/2024 | 151.682 | 0,10 | USD 280.000 | Dell International LLC / EMC Corp 6,02% 15/6/2026 | 275.828 | 0,18 |
| USD 65.430 | Chase Mortgage Finance Corp '2016-SH1 M3' FRN 25/4/2045 | 60.668 | 0,04 | USD 87.631 | Delta Air Lines '2015-1 B' Pass Through Trust 4,25% 30/7/2023 | 80.969 | 0,05 |
| USD 90.000 | Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5,875% 31/3/2025 | 87.467 | 0,06 | USD 142.000 | Delta Air Lines '2019-1 AA' Pass Through Trust 3,204% 25/4/2024 | 130.303 | 0,08 |
| USD 120.000 | Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 3,70% 15/11/2029 | 105.751 | 0,07 | GBP 100.000 | Discovery Communications LLC 2,50% 20/9/2024 | 116.389 | 0,08 |
| USD 40.000 | Cigna Corp 4,125% 15/11/2025 | 38.059 | 0,02 | USD 190.000 | District of Columbia 5,591% 1/12/2034 | 198.294 | 0,13 |
| USD 43.000 | Citgo Holding Inc 9,25% 1/8/2024 | 40.115 | 0,03 | USD 25.000 | Dominion Energy Inc FRN 15/9/2023 | 23.345 | 0,02 |
| USD 100.000 | Citigroup Commercial Mortgage Trust '2016-P6 B' FRN 10/12/2049 | 89.656 | 0,06 | USD 10.000 | DuPont de Nemours Inc 4,205% 15/11/2023 | 9.498 | 0,01 |
| USD 100.000 | Citigroup Commercial Mortgage Trust '2018-B2 A4' 4,009% 10/3/2051 | 93.439 | 0,06 | EUR 200.000 | Eli Lilly & Co 1,375% 14/9/2061 | 125.032 | 0,08 |
| USD 450.000 | Citigroup Inc 3,50% 15/5/2023 | 423.424 | 0,27 | GBP 100.000 | Encore Capital Group Inc RegS 4,25% 1/6/2028 | 103.503 | 0,07 |
| USD 90.000 | Citigroup Inc FRN 24/7/2023 | 84.035 | 0,05 | USD 120.000 | Energy Transfer LP 3,60% 1/2/2023 | 112.209 | 0,07 |
| USD 175.000 | Citigroup Inc FRN 30/10/2024 | 157.093 | 0,10 | USD 100.000 | Energy Transfer LP 4,25% 15/3/2023 | 93.950 | 0,06 |
| USD 40.000 | Citigroup Inc FRN 25/1/2026 | 35.536 | 0,02 | USD 230.000 | Energy Transfer LP 5,875% 15/1/2024 | 221.068 | 0,14 |
| USD 50.000 | Citigroup Inc FRN 25/1/2033 | 41.275 | 0,03 | USD 80.000 | Energy Transfer LP 7,60% 1/2/2024 | 78.241 | 0,05 |
| USD 10.000 | City of Riverside CA Electric Revenue 7,605% 1/10/2040 | 12.767 | 0,01 | USD 105.000 | Energy Transfer LP / Regency Energy Finance Corp 4,50% 1/11/2023 | 99.138 | 0,06 |
| USD 1.000.000 | CityLine Commercial Mortgage Trust '2016-CLNE A' FRN 10/11/2031 | 921.300 | 0,59 | USD 40.000 | Equinix Inc 1,45% 15/5/2026 | 33.805 | 0,02 |
| USD 160.000 | COMM '2014-UBS5 B' Mortgage Trust FRN 10/9/2047 | 148.188 | 0,10 | USD 150.000 | Extra Space Storage LP 2,35% 15/3/2032 | 114.827 | 0,07 |
| USD 100.000 | COMM '2015-CR23 B' Mortgage Trust FRN 10/5/2048 | 90.761 | 0,06 | | | | |
| USD 92.000 | COMM '2015-CR25 C' Mortgage Trust FRN 10/8/2048 | 81.827 | 0,05 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---|---|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| USD 1.036 | Fannie Mae Pool 4,00% 1/5/2026 | 990 | 0,00 | USD 150.000 | FS KKR Capital Corp 3,40% 15/1/2026 | 130.839 | 0,08 |
| USD 2.717 | Fannie Mae Pool 4,00% 1/9/2026 | 2.638 | 0,00 | USD 10.000 | General Motors Co 5,40% 2/10/2023 | 9.586 | 0,01 |
| USD 282 | Fannie Mae Pool 4,00% 1/1/2027 | 271 | 0,00 | USD 140.000 | General Motors Financial Co Inc 3,25% 5/1/2023 | 131.064 | 0,08 |
| USD 18.545 | Fannie Mae Pool 4,00% 1/3/2027 | 18.006 | 0,01 | USD 50.000 | General Motors Financial Co Inc 3,70% 9/5/2023 | 46.949 | 0,03 |
| USD 19.829 | Fannie Mae Pool 4,00% 1/5/2027 | 18.647 | 0,01 | USD 100.000 | General Motors Financial Co Inc 4,15% 19/6/2023 | 94.343 | 0,06 |
| USD 51.088 | Fannie Mae Pool 4,00% 1/8/2027 | 48.785 | 0,03 | USD 40.000 | Georgia-Pacific LLC 3,734% 15/7/2023 | 37.687 | 0,02 |
| USD 5.198 | Fannie Mae Pool 4,00% 1/3/2031 | 4.964 | 0,00 | USD 150.000 | Gilead Sciences Inc 0,75% 29/9/2023 | 136.302 | 0,09 |
| USD 15.939 | Fannie Mae Pool 4,00% 1/4/2033 | 15.176 | 0,01 | USD 5.000 | Global Payments Inc 3,75% 1/6/2023 | 4.695 | 0,00 |
| USD 12.692 | Fannie Mae Pool 4,00% 1/6/2033 | 12.084 | 0,01 | USD 20.000 | Global Payments Inc 4,00% 1/6/2023 | 18.828 | 0,01 |
| USD 5.248 | Fannie Mae Pool 4,00% 1/9/2033 | 4.996 | 0,00 | USD 60.000 | Global Payments Inc 1,50% 15/11/2024 | 53.208 | 0,03 |
| USD 6.589 | Fannie Mae Pool 4,00% 1/2/2034 | 6.389 | 0,00 | USD 75.000 | GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,375% 1/11/2023 | 70.779 | 0,05 |
| USD 3.444 | Fannie Mae Pool 4,00% 1/3/2034 | 3.297 | 0,00 | USD 355.000 | GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,25% 1/6/2025 | 331.134 | 0,21 |
| USD 3.300 | Fannie Mae Pool 4,00% 1/3/2034 | 3.142 | 0,00 | USD 50.000 | GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,375% 15/4/2026 | 46.848 | 0,03 |
| USD 25.000 | Fidelity National Information Services Inc 0,60% 1/3/2024 | 22.264 | 0,01 | USD 35.000 | Golden State Tobacco Securitization Corp 'B' 2,746% 1/6/2034 | 28.458 | 0,02 |
| EUR 150.000 | Fidelity National Information Services Inc 1,10% 15/7/2024 | 148.086 | 0,10 | USD 45.000 | Goldman Sachs Group Inc 3,20% 23/2/2023 | 42.202 | 0,03 |
| USD 40.000 | Fiserv Inc 3,80% 1/10/2023 | 37.735 | 0,02 | USD 350.000 | Goldman Sachs Group Inc FRN 5/6/2023 | 326.750 | 0,21 |
| USD 105.000 | Fiserv Inc 2,75% 1/7/2024 | 96.702 | 0,06 | USD 75.000 | Goldman Sachs Group Inc FRN 17/11/2023 | 69.187 | 0,04 |
| USD 85.000 | Flex Intermediate Holdco LLC 4,317% 30/12/2039 | 65.943 | 0,04 | USD 90.000 | Goldman Sachs Group Inc 1,217% 6/12/2023 | 82.181 | 0,05 |
| USD 200.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3,35% 1/11/2022 | 187.639 | 0,12 | USD 30.000 | Goldman Sachs Group Inc 3,625% 20/2/2024 | 28.214 | 0,02 |
| USD 200.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3,087% 9/1/2023 | 186.026 | 0,12 | USD 70.000 | Goldman Sachs Group Inc FRN 8/3/2024 | 64.033 | 0,04 |
| GBP 340.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4,535% 6/3/2025 | 390.104 | 0,25 | USD 70.000 | Goldman Sachs Group Inc FRN 10/9/2024 | 63.066 | 0,04 |
| USD 100.000 | Fortinet Inc 2,20% 15/3/2031 | 77.571 | 0,05 | USD 335.000 | Goldman Sachs Group Inc FRN 5/6/2028 | 305.095 | 0,20 |
| USD 132.610 | Freddie Mac Gold Pool 3,00% 1/8/2030 | 123.838 | 0,08 | USD 51.000 | Goldman Sachs Group Inc FRN 24/2/2033 | 42.292 | 0,03 |
| USD 17.235 | Freddie Mac Gold Pool 4,00% 1/2/2034 | 16.475 | 0,01 | GBP 500.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 16/12/2025 | 553.134 | 0,36 |
| USD 20.946 | Freddie Mac Gold Pool 4,00% 1/2/2034 | 20.342 | 0,01 | EUR 300.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 0,875% 9/5/2029 | 263.844 | 0,17 |
| USD 19.533 | Freddie Mac Gold Pool 4,00% 1/3/2034 | 18.808 | 0,01 | GBP 280.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 29/10/2029 | 328.686 | 0,21 |
| USD 35.781 | Freddie Mac REMICS '4390 CA' 3,50% 15/6/2050 | 33.614 | 0,02 | USD 1.845.976 | Government National Mortgage Association '2017-64 IO' FRN 16/11/2057 | 77.498 | 0,05 |
| USD 32.007 | Freddie Mac REMICS '4459 BN' 3,00% 15/8/2043 | 29.521 | 0,02 | USD 300.000 | Grant County Public Utility District No 2 4,584% 1/1/2040 | 277.458 | 0,18 |
| USD 7.744 | Freddie Mac REMICS '4482 DH' 3,00% 15/6/2042 | 7.259 | 0,00 | USD 135.000 | Graphic Packaging International LLC 4,125% 15/8/2024 | 124.955 | 0,08 |
| USD 70.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust '2022-DNA1 M1B' FRN 25/1/2042 | 60.333 | 0,04 | USD 70.000 | Gray Oak Pipeline LLC 2,00% 15/9/2023 | 64.101 | 0,04 |
| USD 170.000 | Freeport-McMoRan Inc 5,00% 1/9/2027 | 160.363 | 0,10 | USD 155.000 | Gray Oak Pipeline LLC 2,60% 15/10/2025 | 136.944 | 0,09 |
| USD 54.551.943 | FREMF '2015-K151 X2A' Mortgage Trust 0,10% 25/4/2030 | 297.521 | 0,19 | USD 60.000 | GS Mortgage Securities Trust '2015-GC32 C' FRN 10/7/2048 | 54.268 | 0,04 |
| USD 5.261.000 | FREMF '2016-KC01 X2B' Mortgage Trust 0,10% 25/1/2023 | 1.691 | 0,00 | | | | |
| USD 100.000 | FREMF '2018-W5FX CFX' Trust FRN 25/4/2028 | 87.790 | 0,06 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| USD 125.000 | GS Mortgage Securities Trust '2015-GS1 A3' 3,734% 10/11/2048 | 117.011 | 0,08 | USD 340.000 | Marsh & McLennan Cos Inc 2,25% 15/11/2030 | 275.664 | 0,18 |
| USD 17.387 | GS Mortgage-Backed Securities Trust '2014-EB1A 2A1' FRN 25/7/2044 | 16.112 | 0,01 | USD 35.000 | Martin Marietta Materials Inc 0,65% 15/7/2023 | 31.914 | 0,02 |
| USD 160.000 | HCA Inc 4,125% 15/6/2029 | 144.751 | 0,09 | USD 26.811 | Mastr Asset Backed Securities Trust '2005-WF1 M7' FRN 25/6/2035 | 25.119 | 0,02 |
| USD 100.000 | Houston Galleria Mall Trust '2015-HGLR D' 3,982% 5/3/2037 | 85.635 | 0,06 | USD 98.137 | Mastr Asset Backed Securities Trust '2005-WF1 M8' FRN 25/6/2035 | 92.658 | 0,06 |
| USD 125.809 | HSI Asset Securitization Corp Trust '2007-NC1 A2' FRN 25/4/2037 | 82.670 | 0,05 | USD 123.983 | Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust '2007-H1 1A2' FRN 25/10/2037 | 102.870 | 0,07 |
| USD 150.000 | Hyundai Capital America 1,65% 17/9/2026 | 125.273 | 0,08 | USD 20.000 | Michigan Finance Authority 5,00% 15/11/2028 | 20.220 | 0,01 |
| EUR 100.000 | Illinois Tool Works Inc 0,25% 5/12/2024 | 97.292 | 0,06 | USD 90.000 | Michigan Finance Authority 5,00% 15/11/2041 | 88.295 | 0,06 |
| USD 30.000 | Intercontinental Exchange Inc 3,45% 21/9/2023 | 28.428 | 0,02 | USD 150.000 | Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC 4,10% 15/5/2028 | 138.288 | 0,09 |
| USD 10.000 | Intercontinental Exchange Inc 4,00% 15/9/2027 | 9.368 | 0,01 | USD 100.000 | Morgan Stanley FRN 10/11/2023 | 92.373 | 0,06 |
| USD 220.000 | Intercontinental Exchange Inc 4,60% 15/3/2033 | 209.591 | 0,14 | USD 25.000 | Morgan Stanley FRN 5/4/2024 | 22.860 | 0,01 |
| USD 25.000 | International Flavors & Fragrances Inc 0,697% 15/9/2022 | 23.184 | 0,02 | EUR 450.000 | Morgan Stanley FRN 26/7/2024 | 447.565 | 0,29 |
| USD 25.000 | International Flavors & Fragrances Inc 1,23% 1/10/2025 | 21.388 | 0,01 | USD 633.000 | Morgan Stanley FRN 17/4/2025 | 590.572 | 0,38 |
| USD 220.487 | JP Morgan Mortgage Trust '2017-2 B3' FRN 25/5/2047 | 200.903 | 0,13 | USD 140.000 | Morgan Stanley FRN 30/5/2025 | 123.422 | 0,08 |
| USD 10.362 | JP Morgan Mortgage Trust '2018-4 A1' FRN 25/10/2048 | 9.657 | 0,01 | USD 40.000 | Morgan Stanley FRN 28/4/2026 | 35.672 | 0,02 |
| USD 136.837 | JP Morgan Mortgage Trust '2018-4 B4' FRN 25/10/2048 | 125.304 | 0,08 | USD 148.000 | Morgan Stanley FRN 20/4/2028 | 138.500 | 0,09 |
| USD 35.000 | JPMorgan Chase & Co 3,625% 13/5/2024 | 33.085 | 0,02 | USD 140.000 | Morgan Stanley FRN 23/1/2030 | 131.402 | 0,08 |
| USD 125.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 1/6/2024 | 115.113 | 0,07 | EUR 100.000 | Morgan Stanley FRN 7/2/2031 | 84.524 | 0,05 |
| USD 50.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 23/7/2024 | 46.952 | 0,03 | EUR 405.000 | Morgan Stanley FRN 7/5/2032 | 408.368 | 0,26 |
| USD 170.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 1/6/2025 | 150.313 | 0,10 | USD 13.000 | Morgan Stanley FRN 21/1/2033 | 10.808 | 0,01 |
| USD 533.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 26/4/2026 | 499.859 | 0,32 | USD 500.000 | Morgan Stanley Capital I Trust '2014-150E A' 3,912% 9/9/2032 | 468.186 | 0,30 |
| USD 100.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 25/1/2033 | 83.352 | 0,05 | USD 170.000 | Morgan Stanley Capital I Trust 2017-CLS 'E' FRN 15/11/2034 | 157.334 | 0,10 |
| USD 43.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 26/4/2033 | 40.928 | 0,03 | USD 32.782 | Morgan Stanley Capital I Trust '2017-H1 C' FRN 15/6/2050 | 29.398 | 0,02 |
| GBP 175.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 28/4/2026 | 192.429 | 0,12 | USD 365.000 | Morgan Stanley Capital I Trust '2018-H3 A5' 4,177% 15/7/2051 | 342.419 | 0,22 |
| USD 208.000 | Kaiser Foundation Hospitals 2,81% 1/6/2041 | 152.372 | 0,10 | USD 144.931 | Morgan Stanley Capital I Trust '2018-H3 B' FRN 15/7/2051 | 131.647 | 0,09 |
| USD 35.000 | Keurig Dr Pepper Inc 0,75% 15/3/2024 | 31.333 | 0,02 | USD 160.000 | Morgan Stanley Capital I Trust '2018-H3 C' FRN 15/7/2051 | 143.383 | 0,09 |
| USD 30.000 | Kinder Morgan Energy Partners LP 4,15% 1/2/2024 | 28.284 | 0,02 | USD 250.000 | Morgan Stanley Capital I Trust '2018-H4 A4' 4,31% 15/12/2051 | 234.973 | 0,15 |
| USD 380.000 | Kraft Heinz Foods Co 5,00% 4/6/2042 | 339.543 | 0,22 | USD 100.000 | Morgan Stanley Capital I Trust '2018-L1 A4' FRN 15/10/2051 | 94.704 | 0,06 |
| USD 45.000 | Level 3 Financing Inc 3,75% 15/7/2029 | 35.581 | 0,02 | USD 63.825 | Mosaic Solar Loan Trust '2020-2A A' 1,44% 20/8/2046 | 53.832 | 0,03 |
| USD 103.021 | Loanpal Solar Loan Ltd '2020-3GS A' 2,47% 20/12/2047 | 88.083 | 0,06 | USD 35.302 | Mosaic Solar Loans '2017-2A A' LLC 3,82% 22/6/2043 | 32.097 | 0,02 |
| USD 70.000 | Los Angeles Department of Water & Power System Revenue 5,716% 1/7/2039 | 77.064 | 0,05 | USD 275.000 | Motorola Solutions Inc 2,30% 15/11/2030 | 208.725 | 0,13 |
| USD 15.000 | Lowe's Cos Inc 2,50% 15/4/2026 | 13.435 | 0,01 | USD 30.000 | MPLX LP 3,50% 1/12/2022 | 28.115 | 0,02 |
| USD 256.000 | Lowe's Cos Inc 1,70% 15/10/2030 | 197.244 | 0,13 | USD 20.000 | MPLX LP 3,375% 15/3/2023 | 18.755 | 0,01 |
| | | | | USD 35.000 | MPLX LP 4,875% 1/12/2024 | 33.414 | 0,02 |
| | | | | USD 300.000 | MPLX LP 2,65% 15/8/2030 | 242.334 | 0,16 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| EUR 170.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 0,993% 15/10/2026 | 146.071 | 0,09 | USD 10.000 | Oregon School Boards Association 'B' 5,68% 30/6/2028 | 10.107 | 0,01 |
| USD 150.000 | MSCG Trust '2018-SELF E' FRN 15/10/2037 | 136.542 | 0,09 | USD 80.000 | Pacific Gas and Electric Co 1,367% 10/3/2023 | 72.973 | 0,05 |
| USD 50.000 | Navient Corp 6,125% 25/3/2024 | 46.678 | 0,03 | USD 50.000 | Par Pharmaceutical Inc 7,50% 1/4/2027 | 36.604 | 0,02 |
| USD 306.664 | Navient Private Education Refi Loan Trust '2020-CA A2A' 2,15% 15/11/2068 | 279.507 | 0,18 | USD 75.000 | Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp 2,70% 14/3/2023 | 69.852 | 0,05 |
| USD 120.000 | New Jersey Economic Development Authority 3,72% 15/6/2030 | 107.359 | 0,07 | USD 172.000 | Piedmont Healthcare Inc 2,719% 1/1/2042 | 121.035 | 0,08 |
| USD 38.154 | New Residential Mortgage Loan Trust '2018-1A A1A' FRN 25/12/2057 | 34.743 | 0,02 | USD 35.000 | Pioneer Natural Resources Co 0,55% 15/5/2023 | 31.996 | 0,02 |
| USD 55.000 | New York City Municipal Water Finance Authority 5,724% 15/6/2042 | 62.151 | 0,04 | USD 55.000 | Port Authority of New York & New Jersey 5,647% 1/11/2040 | 58.005 | 0,04 |
| USD 45.000 | New York City Municipal Water Finance Authority 5,44% 15/6/2043 | 49.401 | 0,03 | USD 120.000 | Reliance Steel & Aluminum Co 2,15% 15/8/2030 | 94.909 | 0,06 |
| USD 95.000 | New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 2,90% 1/11/2032 | 78.943 | 0,05 | USD 30.000 | Reynolds American Inc 4,45% 12/6/2025 | 28.376 | 0,02 |
| USD 15.000 | New York State Dormitory Authority 3,19% 15/2/2043 | 11.627 | 0,01 | USD 20.000 | Rockwell Automation Inc 0,35% 15/8/2023 | 18.197 | 0,01 |
| USD 525.000 | New York State Dormitory Authority 'C' 2,252% 15/3/2032 | 413.941 | 0,27 | USD 10.000 | Roper Technologies Inc 0,45% 15/8/2022 | 9.307 | 0,01 |
| USD 420.000 | New York State Thruway Authority 'M' 2,90% 1/1/2035 | 344.918 | 0,22 | USD 60.000 | Rutgers The State University of New Jersey 3,27% 1/5/2043 | 46.464 | 0,03 |
| USD 170.000 | New York Transportation Development Corp 'A' 5,00% 1/7/2046 | 160.944 | 0,10 | USD 100.000 | Ryder System Inc 3,65% 18/3/2024 | 93.370 | 0,06 |
| USD 10.000 | New York Transportation Development Corp 'A' 5,25% 1/1/2050 | 9.539 | 0,01 | USD 40.000 | Salt River Project Agricultural Improvement & Power District 4,839% 1/1/2041 | 40.639 | 0,03 |
| USD 62.504 | Newcastle Mortgage Securities Trust '2007-1 2A3' FRN 25/4/2037 | 57.396 | 0,04 | USD 3.000 | Sherwin-Williams Co 2,75% 1/6/2022 | 2.800 | 0,00 |
| USD 195.000 | NextEra Energy Capital Holdings Inc 0,65% 1/3/2023 | 179.038 | 0,12 | USD 50.000 | Simon Property Group LP 3,375% 1/10/2024 | 46.825 | 0,03 |
| USD 595.000 | NextEra Energy Operating Partners LP 4,25% 15/7/2024 | 556.287 | 0,36 | USD 105.000 | Sirius XM Radio Inc 5,00% 1/8/2027 | 96.426 | 0,06 |
| USD 213.000 | Nissan Motor Acceptance Co LLC 3,875% 21/9/2023 | 199.329 | 0,13 | USD 110.000 | SMB Private Education Loan Trust '2020-PTB B' 2,50% 15/9/2054 | 94.174 | 0,06 |
| USD 20.000 | Nissan Motor Acceptance Co LLC 1,05% 8/3/2024 | 17.707 | 0,01 | USD 7.000 | South Carolina Public Service Authority 'D' 2,388% 1/12/2023 | 6.455 | 0,00 |
| USD 205.000 | Nissan Motor Acceptance Co LLC 2,00% 9/3/2026 | 171.540 | 0,11 | USD 35.000 | Southern California Edison Co 1,10% 1/4/2024 | 31.431 | 0,02 |
| USD 15.000 | Nucor Corp 4,30% 23/5/2027 | 14.211 | 0,01 | USD 45.000 | Stanley Black & Decker Inc 2,30% 24/2/2025 | 41.114 | 0,03 |
| USD 125.000 | NVIDIA Corp 0,584% 14/6/2024 | 111.564 | 0,07 | USD 160.000 | Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust '2007-BC3 2A4' FRN 25/5/2047 | 135.110 | 0,09 |
| USD 100.000 | ONE Gas Inc 1,10% 11/3/2024 | 89.446 | 0,06 | USD 15.000 | Synchrony Financial 3,70% 4/8/2026 | 13.501 | 0,01 |
| USD 148.760 | OneMain Financial Issuance Trust '2020-1A A' 3,84% 14/5/2032 | 139.058 | 0,09 | USD 115.000 | Teleflex Inc 4,625% 15/11/2027 | 106.345 | 0,07 |
| USD 370.000 | ONEOK Inc 4,35% 15/3/2029 | 336.886 | 0,22 | USD 105.000 | Texas Municipal Gas Acquisition & Supply Corp I 'D' 6,25% 15/12/2026 | 105.518 | 0,07 |
| USD 150.000 | ONEOK Partners LP 4,90% 15/3/2025 | 143.160 | 0,09 | USD 40.000 | Thermo Fisher Scientific Inc 1,215% 18/10/2024 | 35.765 | 0,02 |
| USD 130.000 | Oracle Corp 2,625% 15/2/2023 | 121.251 | 0,08 | USD 25.000 | T-Mobile USA Inc 1,50% 15/2/2026 | 21.379 | 0,01 |
| USD 105.000 | Oracle Corp 2,95% 15/11/2024 | 96.284 | 0,06 | USD 160.000 | UBS Commercial Mortgage Trust '2018-C12 B' FRN 15/8/2051 | 146.063 | 0,09 |
| USD 260.000 | Oracle Corp 3,60% 1/4/2050 | 175.305 | 0,11 | USD 149.240 | United Airlines '2019-2 A' Pass Through Trust 2,90% 1/5/2028 | 125.424 | 0,08 |
| USD 10.000 | Oregon School Boards Association 'B' 5,55% 30/6/2028 | 9.954 | 0,01 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---|---|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| USD 169.810 | United Airlines '2019-2 B' Pass Through Trust 3,50% 1/5/2028 | 143.555 | 0,09 | EUR 8.163 | iShares EUR High Yield Corp Bond UCITS ETF [^] | 754.098 | 0,48 |
| USD 237.116 | United Airlines '2020-1 A' Pass Through Trust 5,875% 15/10/2027 | 224.059 | 0,14 | GBP 63.389 | iShares GBP Corp Bond 0-5yr UCITS ETF ⁻ | 7.525.266 | 4,85 |
| USD 20.750 | United Airlines '2020-1 B' Pass Through Trust 4,875% 15/1/2026 | 18.805 | 0,01 | | | 10.167.285 | 6,55 |
| USD 260.000 | UnitedHealth Group Inc 2,30% 15/5/2031 | 215.679 | 0,14 | | Gesamt börsengehandelte Fonds | 10.167.285 | 6,55 |
| USD 5.000 | University of California 5,77% 15/5/2043 | 5.398 | 0,00 | | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | 130.983.721 | 84,42 |
| USD 94.000 | University of Minnesota 4,048% 1/4/2052 | 85.264 | 0,06 | Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| USD 30.000 | Verizon Communications Inc FRN 22/3/2024 | 27.879 | 0,02 | ANLEIHEN | | | |
| USD 25.000 | Verizon Communications Inc 1,45% 20/3/2026 | 21.663 | 0,01 | Großbritannien | | | |
| USD 66.000 | VICI Properties LP 4,375% 15/5/2025 | 61.490 | 0,04 | USD 104.586 | SCC Power Plc 4,00% 17/5/2032 | 16.597 | 0,01 |
| USD 180.000 | VICI Properties LP 4,75% 15/2/2028 | 166.875 | 0,11 | | | 16.597 | 0,01 |
| USD 126.000 | VICI Properties LP 4,95% 15/2/2030 | 115.402 | 0,07 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| USD 55.000 | VMware Inc 1,00% 15/8/2024 | 48.457 | 0,03 | USD 65.000 | Broadcom Inc 4,926% 15/5/2037 | 57.390 | 0,04 |
| USD 10.000 | VMware Inc 1,40% 15/8/2026 | 8.361 | 0,01 | USD 350.000 | California Pollution Control Financing Authority 5,00% 21/11/2045 | 327.877 | 0,21 |
| USD 115.000 | Wells Fargo & Co 3,75% 24/1/2024 | 108.809 | 0,07 | USD 260.000 | Colorado Health Facilities Authority 5,00% 1/8/2044 | 253.325 | 0,16 |
| USD 55.000 | Wells Fargo & Co 3,30% 9/9/2024 | 51.521 | 0,03 | USD 170.000 | Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 'L' 5,00% 1/7/2045 | 163.933 | 0,11 |
| USD 499.000 | Wells Fargo & Co FRN 2/3/2033 | 430.307 | 0,28 | USD 145.000 | East Bay Municipal Utility District Water System Revenue 5,874% 1/6/2040 | 162.319 | 0,10 |
| USD 98.000 | Wells Fargo & Co FRN 25/4/2053 | 89.600 | 0,06 | | | 964.844 | 0,62 |
| GBP 200.000 | Wells Fargo Bank NA RegS 5,25% 1/8/2023 | 240.585 | 0,16 | | Gesamt Anleihen | 981.441 | 0,63 |
| USD 9.001.211 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2017-C41 XA' FRN 15/11/2050 | 439.784 | 0,28 | | Gesamt sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 981.441 | 0,63 |
| USD 30.000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2018-C45 C' 4,727% 15/6/2051 | 26.535 | 0,02 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| USD 200.000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2018-C48 C' FRN 15/1/2052 | 178.897 | 0,12 | Irland | | | |
| GBP 100.000 | Welltower Inc 4,80% 20/11/2028 | 125.818 | 0,08 | 5.665 | Blackrock Funds I ICAV - BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund 'U'~ | 547.076 | 0,36 |
| USD 6.352 | WinWater Mortgage Loan Trust '2015-3 A3' FRN 20/3/2045 | 5.928 | 0,00 | | | 547.076 | 0,36 |
| USD 25.000 | WRKCo Inc 3,75% 15/3/2025 | 23.396 | 0,02 | | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen Wertpapiervermögen zum Marktwert | 132.512.238 | 85,41 |
| | | 36.841.869 | 23,75 | | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 22.641.375 | 14,59 |
| Gesamt Anleihen | | 120.795.885 | 77,86 | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | 155.153.613 | 100,00 |
| BÖRSENGEHADELTE FONDS (ETF) | | | | [^] Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |
| Irland | | | | ⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9. | | | |
| EUR 15.541 | iShares Core EUR Corp Bond UCITS ETF [^] | 1.887.921 | 1,22 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | USD 506.500 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.37 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/12/2026 | 4.287 | (5.091) |
| CCCDs | USD 700.000 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.38 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 3.954 | (5.968) |
| CCCDs | EUR 6.705.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 16.028 | (165.688) |
| CCILS | EUR 261.000 | Fund receives Fixed 2,481% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2037 | (4.589) | (4.582) |
| CCILS | USD 690.000 | Fund receives Fixed 3,030% and pays Floating USD 12 Month CPURNSA | Bank of America Merrill Lynch | 17/3/2032 | (7.363) | (7.350) |
| CCILS | USD 2.330.000 | Fund receives Fixed 3,086% and pays Floating USD 12 Month CPURNSA | Bank of America Merrill Lynch | 23/3/2032 | (10.462) | (10.418) |
| CCILS | USD 2.450.000 | Fund receives Fixed 3,134% and pays Floating USD 12 Month CPURNSA | Bank of America Merrill Lynch | 25/3/2032 | 680 | 727 |
| CCILS | GBP 200.000 | Fund receives Fixed 3,510% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2030 | (44.022) | (44.017) |
| CCILS | GBP 150.000 | Fund receives Fixed 3,535% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2030 | (32.717) | (32.713) |
| CCILS | GBP 526.000 | Fund receives Fixed 3,618% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (111.802) | (111.788) |
| CCILS | GBP 667.000 | Fund receives Fixed 3,640% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2030 | (145.237) | (136.030) |
| CCILS | GBP 460.000 | Fund receives Fixed 3,650% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2031 | (95.530) | (95.518) |
| CCILS | GBP 266.000 | Fund receives Fixed 3,700% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2031 | (52.588) | (53.427) |
| CCILS | GBP 330.000 | Fund receives Fixed 3,718% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (61.830) | (61.821) |
| CCILS | GBP 48.000 | Fund receives Fixed 3,735% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2031 | (9.415) | (9.414) |
| CCILS | GBP 1.418.000 | Fund receives Fixed 3,776% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2028 | (185.336) | (184.860) |
| CCILS | GBP 125.000 | Fund receives Fixed 3,810% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (21.858) | (21.854) |
| CCILS | GBP 230.000 | Fund receives Fixed 3,810% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (40.218) | (40.212) |
| CCILS | GBP 160.000 | Fund receives Fixed 3,850% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (27.108) | (27.103) |
| CCILS | GBP 105.000 | Fund receives Fixed 3,850% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/7/2031 | (17.789) | (17.787) |
| CCILS | GBP 105.000 | Fund receives Fixed 4,110% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2031 | (12.508) | (12.505) |
| CCILS | GBP 704.000 | Fund receives Fixed 4,193% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2032 | (56.219) | (56.201) |
| CCILS | GBP 294.000 | Fund receives Fixed 4,245% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (23.713) | (23.706) |
| CCILS | GBP 2.030.000 | Fund receives Fixed 4,248% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2032 | (146.725) | (146.675) |
| CCILS | GBP 300.000 | Fund receives Fixed 4,261% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (23.526) | (23.518) |
| CCILS | GBP 190.000 | Fund receives Fixed 4,262% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2031 | (15.495) | (14.855) |
| CCILS | GBP 40.000 | Fund receives Fixed 4,285% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2032 | (2.347) | (2.345) |
| CCILS | GBP 290.000 | Fund receives Fixed 4,324% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2032 | (15.409) | (15.402) |
| CCILS | GBP 230.000 | Fund receives Fixed 4,328% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2032 | (14.035) | (14.029) |
| CCILS | GBP 311.000 | Fund receives Fixed 4,348% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2031 | (25.236) | (25.228) |
| CCILS | GBP 240.000 | Fund receives Fixed 4,371% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2032 | (11.184) | (11.178) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCILS | GBP 470.000 | Fund receives Fixed 4,810% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2026 | (31.005) | (30.996) |
| CCILS | EUR 490.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,067% | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2032 | 43.856 | 43.866 |
| CCILS | EUR 570.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,018% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 7.133 | 7.140 |
| CCILS | EUR 710.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,018% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2027 | 8.885 | 8.893 |
| CCILS | GBP 200.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,428% | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2025 | 32.966 | 32.969 |
| CCILS | GBP 44.299 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,750% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2052 | (4.750) | (4.747) |
| CCILS | GBP 560.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 4,485% | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2032 | 17.037 | 17.051 |
| CCILS | GBP 40.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 4,585% | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2027 | 2.173 | 2.173 |
| CCILS | GBP 165.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 4,620% | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2027 | 9.659 | 9.661 |
| CCILS | GBP 168.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 4,824% | Bank of America Merrill Lynch | 15/10/2026 | 11.408 | 11.411 |
| CCILS | GBP 470.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,070% | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2024 | 32.808 | 32.813 |
| CCILS | GBP 270.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,100% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2027 | 4.059 | 4.077 |
| CCILS | GBP 820.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,405% | Bank of America Merrill Lynch | 17/5/2027 | (11.273) | (11.262) |
| CCILS | GBP 590.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 6,496% | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2024 | 8.807 | 8.982 |
| CCILS | USD 1.485.000 | Fund receives Floating USD 12 Month CPURNSA and pays Fixed 2,682% | Bank of America Merrill Lynch | 24/2/2032 | 67.516 | 67.543 |
| CCILS | USD 3.727.000 | Fund receives Floating USD 12 Month CPURNSA and pays Fixed 3,310% | Bank of America Merrill Lynch | 5/8/2022 | 175.631 | 175.654 |
| CCIRS | EUR 770.000 | Fund receives Fixed 0,088% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (110.615) | (110.601) |
| CCIRS | EUR 3.320.000 | Fund receives Fixed -0,103% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2026 | (209.591) | (209.547) |
| CCIRS | EUR 13.567.500 | Fund receives Fixed 0,143% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2024 | (262.921) | (260.489) |
| CCIRS | EUR 830.000 | Fund receives Fixed 0,180% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (112.809) | (112.793) |
| CCIRS | EUR 4.690.000 | Fund receives Fixed 0,258% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2025 | (142.421) | (148.311) |
| CCIRS | EUR 1.620.000 | Fund receives Fixed 0,424% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2027 | (79.156) | (79.140) |
| CCIRS | EUR 1.610.000 | Fund receives Fixed 0,614% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2025 | (27.416) | (34.032) |
| CCIRS | EUR 520.000 | Fund receives Fixed 0,652% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (25.353) | (25.131) |
| CCIRS | EUR 90.000 | Fund receives Fixed 0,655% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (8.256) | (8.254) |
| CCIRS | EUR 140.000 | Fund receives Fixed 0,690% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (12.427) | (12.438) |
| CCIRS | EUR 1.050.000 | Fund receives Fixed 0,730% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2031 | (94.487) | (94.436) |
| CCIRS | EUR 13.900.000 | Fund receives Fixed 0,757% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2032 | (1.432.917) | (1.423.634) |
| CCIRS | EUR 818.500 | Fund receives Fixed 0,767% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (67.217) | (67.204) |
| CCIRS | EUR 840.000 | Fund receives Fixed 0,790% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (67.437) | (67.424) |
| CCIRS | EUR 880.000 | Fund receives Fixed 0,813% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (68.929) | (68.914) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | EUR 303.175 | Fund receives Fixed 0,816% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (23.677) | (23.673) |
| CCIRS | EUR 450.000 | Fund receives Fixed 0,817% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (35.106) | (35.099) |
| CCIRS | EUR 0 | Fund receives Fixed 0,870% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 25/3/2027 | 13.548 | 22.526 |
| CCIRS | EUR 230.000 | Fund receives Fixed 0,880% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (8.598) | (8.595) |
| CCIRS | EUR 100.000 | Fund receives Fixed 0,906% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (3.611) | (3.609) |
| CCIRS | EUR 1.100.000 | Fund receives Fixed 0,906% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2037 | (157.192) | (157.169) |
| CCIRS | EUR 3.930.000 | Fund receives Fixed 0,928% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 7/4/2027 | (19.867) | (24.890) |
| CCIRS | EUR 3.920.000 | Fund receives Fixed 0,940% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 7/4/2027 | (24.004) | (24.378) |
| CCIRS | EUR 2.700.000 | Fund receives Fixed 0,970% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2025 | (28.674) | (28.724) |
| CCIRS | EUR 60.000 | Fund receives Fixed 0,980% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (1.781) | (1.952) |
| CCIRS | GBP 1.420.000 | Fund receives Fixed 0,998% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 4/1/2032 | (163.216) | (163.224) |
| CCIRS | EUR 6.580.000 | Fund receives Fixed 1,005% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 30/3/2027 | (36.807) | (36.764) |
| CCIRS | EUR 200.000 | Fund receives Fixed 1,015% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (6.479) | (6.169) |
| CCIRS | EUR 220.000 | Fund receives Fixed 1,047% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (5.965) | (6.449) |
| CCIRS | EUR 390.000 | Fund receives Fixed 1,237% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (17.264) | (17.258) |
| CCIRS | EUR 270.000 | Fund receives Fixed 1,240% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (11.895) | (11.891) |
| CCIRS | EUR 110.000 | Fund receives Fixed 1,264% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (1.792) | (2.072) |
| CCIRS | EUR 110.000 | Fund receives Fixed 1,305% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (1.858) | (1.856) |
| CCIRS | SEK 7.610.000 | Fund receives Fixed 1,330% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (40.821) | (41.236) |
| CCIRS | GBP 3.800.000 | Fund receives Fixed 1,350% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2032 | (178.818) | (313.509) |
| CCIRS | EUR 40.180.000 | Fund receives Fixed 1,358% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 24/4/2027 | (89.932) | (91.560) |
| CCIRS | EUR 1.285.000 | Fund receives Fixed 1,365% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 5/5/2027 | (6.456) | (6.443) |
| CCIRS | EUR 1.730.000 | Fund receives Fixed 1,370% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 23/4/2027 | (3.794) | (3.710) |
| CCIRS | EUR 780.000 | Fund receives Fixed 1,465% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (19.891) | (20.009) |
| CCIRS | EUR 70.000 | Fund receives Fixed 1,506% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (672) | (503) |
| CCIRS | EUR 190.000 | Fund receives Fixed 1,519% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (1.250) | (1.248) |
| CCIRS | EUR 100.000 | Fund receives Fixed 1,522% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (646) | (645) |
| CCIRS | EUR 110.000 | Fund receives Fixed 1,539% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (618) | (617) |
| CCIRS | EUR 110.000 | Fund receives Fixed 1,606% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (263) | (262) |
| CCIRS | EUR 1.150.000 | Fund receives Fixed 1,613% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (15.632) | (15.614) |
| CCIRS | EUR 1.880.000 | Fund receives Fixed 1,631% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (22.810) | (22.781) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | SEK 590.000 | Fund receives Fixed 1,640% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (2.384) | (2.384) |
| CCIRS | EUR 2.970.000 | Fund receives Fixed 1,673% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 12/5/2027 | 2.460 | 2.107 |
| CCIRS | EUR 1.960.000 | Fund receives Fixed 1,685% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (15.122) | (15.092) |
| CCIRS | EUR 1.285.000 | Fund receives Fixed 1,699% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (8.487) | (8.468) |
| CCIRS | EUR 1.870.000 | Fund receives Fixed 1,699% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (12.351) | (12.322) |
| CCIRS | EUR 140.000 | Fund receives Fixed 1,762% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 191 | 722 |
| CCIRS | EUR 940.000 | Fund receives Fixed 1,762% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (1.403) | (1.388) |
| CCIRS | EUR 110.000 | Fund receives Fixed 1,780% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 662 | 663 |
| CCIRS | GBP 12.215.000 | Fund receives Fixed 1,783% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2024 | (163.032) | (161.560) |
| CCIRS | GBP 1.550.000 | Fund receives Fixed 1,786% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2032 | (39.540) | (57.314) |
| CCIRS | SEK 1.820.000 | Fund receives Fixed 1,799% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (5.993) | (6.060) |
| CCIRS | USD 240.000 | Fund receives Fixed 1,850% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2032 | (8.169) | (15.819) |
| CCIRS | EUR 260.000 | Fund receives Fixed 1,904% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | 2.644 | 2.648 |
| CCIRS | SEK 710.000 | Fund receives Fixed 1,910% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (2.014) | (2.014) |
| CCIRS | AUD 1.670.000 | Fund receives Fixed 2,010% and pays Floating AUD 3 Month BBSW | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2025 | (39.446) | (39.435) |
| CCIRS | GBP 1.800.000 | Fund receives Fixed 2,138% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 3/5/2027 | (12.928) | (12.992) |
| CCIRS | GBP 120.000 | Fund receives Fixed 2,143% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (1.060) | (1.097) |
| CCIRS | GBP 7.400.000 | Fund receives Fixed 2,214% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2024 | (7.504) | (25.072) |
| CCIRS | HKD 540.000 | Fund receives Fixed 2,297% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (1.879) | (1.878) |
| CCIRS | HKD 780.000 | Fund receives Fixed 2,300% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (2.701) | (2.700) |
| CCIRS | HKD 810.000 | Fund receives Fixed 2,308% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (2.771) | (2.770) |
| CCIRS | HKD 1.380.000 | Fund receives Fixed 2,480% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (3.401) | (3.399) |
| CCIRS | HKD 970.000 | Fund receives Fixed 2,544% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (2.049) | (2.048) |
| CCIRS | USD 3.500.000 | Fund receives Fixed 2,768% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2032 | 42.400 | 33.328 |
| CCIRS | GBP 2.630.000 | Fund receives Fixed 2,804% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 21/4/2024 | 4.178 | 4.193 |
| CCIRS | HKD 480.000 | Fund receives Fixed 2,845% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (211) | (211) |
| CCIRS | HKD 480.000 | Fund receives Fixed 2,855% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (185) | (184) |
| CCIRS | HKD 870.000 | Fund receives Fixed 2,892% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (156) | (155) |
| CCIRS | HKD 750.000 | Fund receives Fixed 3,094% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 705 | 706 |
| CCIRS | HKD 750.000 | Fund receives Fixed 3,100% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 730 | 731 |
| CCIRS | MXN 1.344.000 | Fund receives Fixed 7,530% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 23/1/2032 | (3.773) | (3.772) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | ZAR 980.000 | Fund receives Fixed 7,538% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (330) | (329) |
| CCIRS | MXN 2.270.000 | Fund receives Fixed 7,565% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 12/1/2032 | (6.110) | (6.108) |
| CCIRS | MXN 1.979.000 | Fund receives Fixed 7,600% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 1/1/2032 | (5.096) | (5.094) |
| CCIRS | ZAR 1.540.000 | Fund receives Fixed 7,660% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (56) | (55) |
| CCIRS | ZAR 2.390.000 | Fund receives Fixed 7,810% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 792 | 794 |
| CCIRS | ZAR 1.630.000 | Fund receives Fixed 7,840% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 660 | 661 |
| CCIRS | ZAR 2.210.000 | Fund receives Fixed 8,000% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 1.761 | 1.763 |
| CCIRS | ZAR 2.030.000 | Fund receives Fixed 8,080% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 2.016 | 2.017 |
| CCIRS | MXN 1.156.000 | Fund receives Fixed 8,290% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 17/3/2032 | (500) | (499) |
| CCIRS | MXN 868.000 | Fund receives Fixed 8,955% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 21/4/2032 | 1.459 | 1.460 |
| CCIRS | AUD 150.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,537% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 497 | 498 |
| CCIRS | AUD 150.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,614% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 144 | 145 |
| CCIRS | AUD 110.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,646% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (3) | (2) |
| CCIRS | CAD 8.290.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,095% | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2025 | 182.275 | 182.385 |
| CCIRS | CAD 450.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,220% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 14.631 | 15.125 |
| CCIRS | CAD 170.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,824% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 2.228 | 2.229 |
| CCIRS | CAD 360.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,849% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 4.405 | 4.408 |
| CCIRS | CAD 100.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,888% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 1.091 | 1.092 |
| CCIRS | CAD 4.960.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 3,040% | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2025 | 9.478 | 9.939 |
| CCIRS | CAD 50.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 3,187% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 37 | 38 |
| CCIRS | CAD 170.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 3,270% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (350) | (348) |
| CCIRS | CAD 250.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 3,367% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (1.343) | (1.341) |
| CCIRS | EUR 780.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,520% | Bank of America Merrill Lynch | 20/2/2025 | 7.306 | 7.255 |
| CCIRS | EUR 10.130.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,542% | Bank of America Merrill Lynch | 20/2/2025 | 92.408 | 91.970 |
| CCIRS | EUR 1.560.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,604% | Bank of America Merrill Lynch | 20/2/2025 | 13.687 | 13.219 |
| CCIRS | EUR 2.350.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,642% | Bank of America Merrill Lynch | 20/2/2025 | 18.840 | 19.013 |
| CCIRS | EUR 15.180.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,676% | Bank of America Merrill Lynch | 19/3/2025 | 114.803 | 116.814 |
| CCIRS | EUR 110.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,703% | Bank of America Merrill Lynch | 24/3/2025 | 1.526 | 1.526 |
| CCIRS | EUR 21.630.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,709% | Bank of America Merrill Lynch | 19/3/2025 | 173.434 | 159.319 |
| CCIRS | EUR 3.820.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,732% | Bank of America Merrill Lynch | 27/3/2025 | 50.905 | 50.923 |
| CCIRS | EUR 1.910.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 0,981% | Bank of America Merrill Lynch | 4/4/2025 | 9.852 | 16.236 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | EUR 1.920.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,050% | Bank of America Merrill Lynch | 4/4/2025 | 13.738 | 13.702 |
| CCIRS | EUR 0 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,100% | Bank of America Merrill Lynch | 12/4/2024 | (2.409) | (3.369) |
| CCIRS | EUR 2.130.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,148% | Bank of America Merrill Lynch | 5/5/2027 | 10.845 | 10.865 |
| CCIRS | EUR 3.050.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,157% | Bank of America Merrill Lynch | 3/5/2024 | 6.629 | 7.481 |
| CCIRS | EUR 3.080.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,190% | Bank of America Merrill Lynch | 25/4/2024 | 5.800 | 6.241 |
| CCIRS | EUR 400.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,277% | Bank of America Merrill Lynch | 14/4/2024 | 265 | 410 |
| CCIRS | EUR 790.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,310% | Bank of America Merrill Lynch | 25/4/2025 | 1.681 | 1.764 |
| CCIRS | EUR 1.029.897 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,320% | Bank of America Merrill Lynch | 14/4/2024 | 888 | 609 |
| CCIRS | EUR 1.030.103 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,325% | Bank of America Merrill Lynch | 14/4/2024 | 659 | 558 |
| CCIRS | EUR 38.450.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,325% | Bank of America Merrill Lynch | 27/4/2024 | 20.663 | 27.282 |
| CCIRS | EUR 38.700.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,340% | Bank of America Merrill Lynch | 25/4/2024 | 15.623 | 20.342 |
| CCIRS | EUR 5.029.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,345% | Bank of America Merrill Lynch | 5/5/2024 | 2.972 | 2.995 |
| CCIRS | EUR 1.540.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,347% | Bank of America Merrill Lynch | 14/4/2024 | 1.219 | 494 |
| CCIRS | EUR 2.470.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 1,447% | Bank of America Merrill Lynch | 11/5/2024 | (986) | (894) |
| CCIRS | EUR 75.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed -0,025% | Bank of America Merrill Lynch | 21/1/2061 | 34.135 | 34.138 |
| CCIRS | EUR 19.602.500 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,471% | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2027 | 1.020.964 | 1.011.159 |
| CCIRS | EUR 1.575.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,538% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2027 | 68.359 | 68.374 |
| CCIRS | EUR 175.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,581% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2072 | 51.911 | 51.918 |
| CCIRS | EUR 2.330.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,672% | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2052 | 577.513 | 572.121 |
| CCIRS | EUR 152.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,459% | Bank of America Merrill Lynch | 20/5/2027 | 428 | 430 |
| CCIRS | GBP 416.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,168% | Bank of America Merrill Lynch | 24/11/2026 | 43.785 | 43.722 |
| CCIRS | GBP 542.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,884% | Bank of America Merrill Lynch | 4/1/2052 | 155.170 | 156.879 |
| CCIRS | GBP 35.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,260% | Bank of America Merrill Lynch | 1/4/2072 | 7.493 | 7.495 |
| CCIRS | GBP 35.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,280% | Bank of America Merrill Lynch | 1/4/2072 | 7.232 | 7.234 |
| CCIRS | GBP 12.305.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,554% | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2027 | 493.138 | 485.895 |
| CCIRS | GBP 920.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,689% | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2025 | 16.418 | 20.994 |
| CCIRS | GBP 6.105.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 2,011% | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2027 | 44.108 | 87.763 |
| CCIRS | GBP 2.720.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 2,388% | Bank of America Merrill Lynch | 22/4/2025 | (100) | (85) |
| CCIRS | MXN 2.370.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,450% | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | 546 | 547 |
| CCIRS | MXN 5.447.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,810% | Bank of America Merrill Lynch | 8/4/2024 | 648 | 649 |
| CCIRS | MXN 5.140.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,895% | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | (3.148) | (3.146) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | MXN 2.570.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,992% | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | (2.049) | (2.047) |
| CCIRS | MXN 2.660.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 9,035% | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | (2.335) | (2.333) |
| CCIRS | PLN 1.066.000 | Fund receives Floating PLN 3 Month WIBOR and pays Fixed 6,150% | Bank of America Merrill Lynch | 11/4/2024 | 2.641 | 2.642 |
| CCIRS | PLN 2.680.000 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 4,853% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 42.546 | 42.553 |
| CCIRS | PLN 460.000 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 5,130% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 6.173 | 6.175 |
| CCIRS | PLN 190.000 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 5,205% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 2.424 | 2.424 |
| CCIRS | PLN 360.000 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 5,830% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 2.598 | 2.599 |
| CCIRS | PLN 310.000 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 5,995% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 1.784 | 1.785 |
| CCIRS | PLN 410.000 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 6,230% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 1.506 | 1.507 |
| CCIRS | PLN 480.000 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 6,295% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 1.486 | 1.487 |
| CCIRS | PLN 520.000 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 6,320% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 1.495 | 1.496 |
| CCIRS | PLN 132.000 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 6,785% | Bank of America Merrill Lynch | 10/5/2027 | (113) | (113) |
| CCIRS | SGD 97.683 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,359% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 434 | 434 |
| CCIRS | SGD 106.294 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,374% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 421 | 422 |
| CCIRS | SGD 65.123 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,376% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 253 | 253 |
| CCIRS | SGD 120.900 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,378% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 464 | 465 |
| CCIRS | SGD 148.500 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,395% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 489 | 490 |
| CCIRS | SGD 121.500 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,411% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 339 | 339 |
| CCIRS | SGD 110.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,440% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 205 | 206 |
| CCIRS | SGD 180.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,455% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 250 | 251 |
| CCIRS | SGD 130.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,488% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 46 | 47 |
| CCIRS | SGD 80.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,550% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (130) | (130) |
| CCIRS | SGD 170.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,575% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (412) | (411) |
| CCIRS | USD 165.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 1,825% | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2027 | 2.515 | 5.628 |
| CCIRS | USD 840.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 1,932% | Bank of America Merrill Lynch | 17/3/2032 | 48.184 | 48.197 |
| CCIRS | USD 2.800.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 2,032% | Bank of America Merrill Lynch | 23/3/2032 | 138.274 | 138.317 |
| CCIRS | USD 2.940.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 2,170% | Bank of America Merrill Lynch | 25/3/2032 | 112.684 | 112.730 |
| CCIRS | USD 180.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 2,454% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 1.653 | 1.655 |
| CCIRS | USD 80.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 2,537% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 446 | 447 |
| CCIRS | USD 90.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 2,682% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (67) | (66) |
| CCIRS | USD 8.570.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 2,716% | Bank of America Merrill Lynch | 9/4/2025 | (3.297) | (3.260) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | USD 44.530.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 2,736% | Bank of America Merrill Lynch | 10/4/2025 | (25.457) | (25.263) |
| CCIRS | USD 250.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 2,798% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (1.442) | (1.440) |
| CCIRS | USD 6.830.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 2,841% | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2027 | (83.645) | (71.034) |
| CDS | USD 25.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (246) | 1.297 |
| CDS | USD 26.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (272) | 1.349 |
| CDS | USD 15.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (172) | 778 |
| CDS | USD 28.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (309) | 1.453 |
| CDS | USD 26.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/12/2024 | (187) | 165 |
| CDS | USD 25.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/12/2024 | (180) | 158 |
| CDS | USD 30.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/12/2024 | (216) | 190 |
| CDS | USD 24.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/12/2024 | (166) | 152 |
| CDS | USD 30.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/12/2024 | (208) | 190 |
| CDS | USD 16.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/12/2024 | (111) | 101 |
| CDS | USD 433.003 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | (1.663) | 22.472 |
| CDS | USD 50.000 | Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | (3) | 566 |
| CDS | USD 38.000 | Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | (2) | 431 |
| CDS | EUR 3.000.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Intesa Sanpaolo SpA | Barclays Bank | 20/12/2022 | 36 | 9.941 |
| CDS | EUR 534 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | Barclays Bank | 20/6/2027 | 1 | 17 |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on Credit Suisse Group Finance Guernsey Ltd and pays Fixed 1,000% | BNP Paribas | 20/6/2027 | 3.219 | 9.587 |
| CDS | USD 200.000 | Fund receives default protection on Hess Corp and pays Fixed 1,000% | BNP Paribas | 20/6/2025 | (41.080) | (675) |
| CDS | USD 290.000 | Fund receives default protection on Tyson Foods Inc and pays Fixed 1,000% | BNP Paribas | 20/12/2023 | (591) | (3.172) |
| CDS | EUR 10.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Louis Dreyfus Co Finance BV | BNP Paribas | 20/6/2027 | 245 | 1.212 |
| CDS | EUR 30.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Saipem Finance International BV | BNP Paribas | 20/6/2027 | (341) | (1.391) |
| CDS | EUR 15.723 | Fund receives default protection on BMW Finance NV and pays Fixed 1,000% | Citibank | 20/6/2027 | 2 | (141) |
| CDS | EUR 7.861 | Fund receives default protection on BMW Finance NV and pays Fixed 1,000% | Citibank | 20/6/2027 | 1 | (70) |
| CDS | EUR 16.416 | Fund receives default protection on BMW Finance NV and pays Fixed 1,000% | Citibank | 20/6/2027 | (99) | (147) |
| CDS | EUR 56.000 | Fund receives default protection on BMW Finance NV and pays Fixed 1,000% | Citibank | 20/6/2027 | (228) | (501) |
| CDS | EUR 56.000 | Fund receives default protection on Daimler AG and pays Fixed 1,000% | Citibank | 20/6/2027 | (230) | (203) |
| CDS | USD 83.243 | Fund receives default protection on Occidental Petroleum Corp and pays Fixed 1,000% | Citibank | 20/12/2025 | (7.059) | 155 |
| CDS | EUR 250.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CNH Industrial Finance Europe SA | Citibank | 20/6/2027 | (2.588) | 45.912 |
| CDS | EUR 20.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Louis Dreyfus Co Finance BV | Citibank | 20/6/2027 | 334 | 2.424 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-------------|--|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | EUR 20.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Louis Dreyfus Co Finance BV | Citibank | 20/6/2027 | 389 | 2.424 |
| CDS | USD 280.000 | Fund receives default protection on Arrow Electronics Inc and pays Fixed 1,000% | Credit Suisse | 20/12/2023 | (1.505) | (2.739) |
| CDS | EUR 70.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | Credit Suisse | 20/6/2027 | (804) | 2.257 |
| CDS | EUR 2.943 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | Credit Suisse | 20/6/2027 | — | 95 |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on Allstate Corp and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 2.028 | (3.503) |
| CDS | USD 300.000 | Fund receives default protection on AutoZone Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2024 | 2.895 | (5.049) |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on Barrick Gold Corp and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 1.887 | (2.673) |
| CDS | EUR 84.000 | Fund receives default protection on BMW Finance NV and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2027 | (465) | (751) |
| CDS | USD 300.000 | Fund receives default protection on Bristol-Myers Squibb Co and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2024 | 3.995 | (5.864) |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on Campbell Soup Co and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 3.070 | (2.360) |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on Cardinal Health Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 1.656 | (2.760) |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on Caterpillar Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 1.126 | (3.146) |
| CDS | USD 215.000 | Fund receives default protection on Colombia Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2027 | (811) | 10.162 |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on CSX Corp and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 2.657 | (3.284) |
| CDS | USD 300.000 | Fund receives default protection on Dominion Energy Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2024 | 4.464 | (5.258) |
| CDS | USD 300.000 | Fund receives default protection on ERP Operating LP and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2025 | (518) | (6.826) |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on Exelon Corp and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 1.488 | (3.179) |
| CDS | USD 300.000 | Fund receives default protection on Home Depot Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2024 | 5.221 | (5.328) |
| CDS | USD 225.000 | Fund receives default protection on Indonesia Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2027 | (2.521) | 7 |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on International Paper Co and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 2.659 | (2.625) |
| CDS | EUR 110.000 | Fund receives default protection on Lloyds Banking Group Plc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2027 | 404 | (1.430) |
| CDS | USD 300.000 | Fund receives default protection on Lowe's Cos Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2024 | 5.080 | (4.505) |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on McKesson Corp and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 1.631 | (3.146) |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on Mondelez International Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 2.563 | (2.649) |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on Motorola Solutions Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 2.336 | (1.864) |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on Newmont Corp and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 1.575 | (2.769) |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on Norfolk Southern Corp and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 2.361 | (3.361) |
| CDS | USD 56.757 | Fund receives default protection on Occidental Petroleum Corp and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2025 | (5.027) | 105 |
| CDS | USD 156.981 | Fund receives default protection on Philippine Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2027 | (1.152) | (376) |
| CDS | USD 300.000 | Fund receives default protection on Quest Diagnostics Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2024 | 4.097 | (4.938) |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on Southern Co and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 1.935 | (3.018) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-------------|--|----------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on United Parcel Service of America Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 1.058 | (3.214) |
| CDS | USD 300.000 | Fund receives default protection on UnitedHealth Group Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2024 | 3.656 | (5.243) |
| CDS | USD 300.000 | Fund receives default protection on WestRock MWV LLC and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2024 | 5.785 | (5.041) |
| CDS | USD 150.000 | Fund receives default protection on XLIT Ltd and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2025 | 2.653 | (3.604) |
| CDS | USD 125.000 | Fund receives Fixed 3,000% and provides default protection on Markit CMBX.NA.9.BBB- | Goldman Sachs | 17/9/2058 | (3.888) | (15.588) |
| CDS | EUR 20.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | Goldman Sachs | 20/6/2022 | (257) | (746) |
| CDS | USD 200.000 | Fund receives default protection on Canadian Natural Resources Ltd and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2025 | (27.833) | (2.546) |
| CDS | EUR 84.000 | Fund receives default protection on Daimler AG and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2027 | (446) | (304) |
| CDS | USD 300.000 | Fund receives default protection on DR Horton Inc and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2025 | (11.165) | (1.180) |
| CDS | EUR 250.000 | Fund receives default protection on Lloyds Banking Group Plc and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2027 | 1.088 | (3.250) |
| CDS | EUR 10.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Ladbrokes Group Finance Plc | JP Morgan | 20/6/2027 | 111 | (958) |
| CDS | EUR 80.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | JP Morgan | 20/6/2022 | 205 | (228) |
| CDS | EUR 20.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | JP Morgan | 20/6/2023 | 184 | (1.716) |
| CDS | EUR 2.957 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | JP Morgan | 20/6/2027 | (8) | 95 |
| CDS | EUR 2.780 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | JP Morgan | 20/6/2027 | (8) | 90 |
| CDS | EUR 786 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | JP Morgan | 20/6/2027 | (2) | 25 |
| CDS | EUR 70.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on EDP - Energias de Portugal SA | JP Morgan | 20/6/2022 | (752) | 182 |
| CDS | EUR 10.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Virgin Media Finance Plc | JP Morgan | 20/12/2025 | (380) | 693 |
| CDS | USD 300.000 | Fund receives default protection on Altria Group Inc and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/12/2025 | 3.861 | (4.261) |
| CDS | USD 24.081 | Fund receives default protection on Colombia Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | 169 | 1.138 |
| CDS | USD 24.081 | Fund receives default protection on Colombia Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | 149 | 1.138 |
| CDS | USD 24.081 | Fund receives default protection on Colombia Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | 157 | 1.138 |
| CDS | USD 24.082 | Fund receives default protection on Colombia Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | 149 | 1.138 |
| CDS | USD 15.948 | Fund receives default protection on Colombia Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | 99 | 754 |
| CDS | USD 300.000 | Fund receives default protection on Johnson & Johnson and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/12/2025 | 2.580 | (7.906) |
| CDS | USD 300.000 | Fund receives default protection on McDonald's Corp and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/12/2025 | 3.068 | (6.692) |
| CDS | USD 181.000 | Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | 1.008 | 2.051 |
| CDS | USD 300.000 | Fund receives default protection on Pfizer Inc and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/12/2025 | 2.764 | (7.062) |
| CDS | USD 51.510 | Fund receives default protection on Republic of South Africa Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | (36) | 2.895 |
| CDS | USD 20.282 | Fund receives default protection on Republic of South Africa Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | (14) | 1.140 |
| CDS | USD 46.243 | Fund receives default protection on Republic of South Africa Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | (32) | 2.599 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|--------------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | USD 125.000 | Fund receives Fixed 3,000% and provides default protection on Markit CMBX.NA.9.BBB- | Morgan Stanley | 17/9/2058 | 5.755 | (15.588) |
| CDS | USD 77.000 | Fund receives Fixed 3,000% and provides default protection on Markit CMBX.NA.9.BBB- | Morgan Stanley | 17/9/2058 | 7.798 | (9.602) |
| CDS | EUR 10.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | Morgan Stanley | 20/12/2025 | (3.347) | (1.967) |
| CDS | EUR 70.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | Morgan Stanley | 20/12/2026 | (15.315) | (13.949) |
| IRS | KRW 21.857.920.000 | Fund receives Fixed 1,682% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2023 | (227.672) | (227.672) |
| IRS | CNY 8.060.403 | Fund receives Fixed 2,312% and pays Floating CNY 3 Month CNRR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2024 | 2.111 | 2.111 |
| IRS | CNY 5.140.000 | Fund receives Fixed 2,340% and pays Floating CNY 3 Month CNRR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2024 | 1.727 | 1.727 |
| IRS | KRW 93.395.000 | Fund receives Fixed 2,969% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (806) | (806) |
| IRS | KRW 140.265.000 | Fund receives Fixed 3,020% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (957) | (957) |
| IRS | KRW 198.880.000 | Fund receives Fixed 3,102% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (779) | (779) |
| IRS | KRW 145.500.000 | Fund receives Fixed 3,147% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (338) | (338) |
| IRS | KRW 162.470.000 | Fund receives Fixed 3,177% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (205) | (205) |
| IRS | KRW 113.180.000 | Fund receives Fixed 3,240% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 110 | 110 |
| IRS | CNY 1.052.552 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 2,525% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (467) | (467) |
| IRS | CNY 2.200.000 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 2,575% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (1.671) | (1.671) |
| IRS | MYR 8.460.000 | Fund receives Floating MYR 3 Month KLIBOR and pays Fixed 2,949% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2024 | 22.541 | 22.541 |
| IRS | BRL 337.000 | Fund receives Fixed 12,025% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | BNP Paribas | 2/1/2025 | (350) | (350) |
| IRS | CNY 6.100.000 | Fund receives Fixed 2,240% and pays Floating CNY 3 Month CNRR | BNP Paribas | 15/6/2024 | 1.453 | 1.453 |
| IRS | CNY 8.060.000 | Fund receives Fixed 2,276% and pays Floating CNY 3 Month CNRR | BNP Paribas | 21/9/2024 | 1.319 | 1.319 |
| IRS | CNY 8.059.194 | Fund receives Fixed 2,294% and pays Floating CNY 3 Month CNRR | BNP Paribas | 21/9/2024 | 1.710 | 1.710 |
| IRS | CNY 2.545.000 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 2,427% | BNP Paribas | 15/6/2027 | (212) | (212) |
| IRS | CNY 1.052.500 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 2,486% | BNP Paribas | 21/9/2027 | (208) | (208) |
| IRS | CNY 1.052.395 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 2,513% | BNP Paribas | 21/9/2027 | (387) | (387) |
| IRS | CNY 6.100.000 | Fund receives Fixed 2,238% and pays Floating CNY 3 Month CNRR | Citibank | 15/6/2024 | 1.411 | 1.411 |
| IRS | KRW 114.035.000 | Fund receives Fixed 2,965% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Citibank | 21/9/2027 | (1.000) | (1.000) |
| IRS | CNY 2.545.000 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 2,420% | Citibank | 15/6/2027 | (99) | (99) |
| IRS | CNY 3.796.380 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 2,583% | Citibank | 21/9/2027 | (3.075) | (3.075) |
| IRS | CNY 3.864.000 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 2,591% | Citibank | 21/9/2027 | (3.324) | (3.324) |
| IRS | CNY 1.999.620 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 2,603% | Citibank | 21/9/2027 | (1.872) | (1.872) |
| IRS | CNY 8.060.403 | Fund receives Fixed 2,315% and pays Floating CNY 3 Month CNRR | Deutsche Bank | 21/9/2024 | 2.165 | 2.165 |
| IRS | CNY 5.140.000 | Fund receives Fixed 2,345% and pays Floating CNY 3 Month CNRR | Deutsche Bank | 21/9/2024 | 1.796 | 1.796 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|---|--------------------|--|-------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| IRS | CNY 1.052.553 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 2,535% | Deutsche Bank | 21/9/2027 | (534) | (534) |
| IRS | CNY 2.200.000 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 2,585% | Deutsche Bank | 21/9/2027 | (1.809) | (1.809) |
| IRS | KRW 114.035.000 | Fund receives Fixed 2,985% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | JP Morgan | 21/9/2027 | (919) | (919) |
| IRS | KRW 61.025.250 | Fund receives Fixed 3,060% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | JP Morgan | 21/9/2027 | (330) | (330) |
| IRS | KRW 238.990.000 | Fund receives Fixed 3,062% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | JP Morgan | 21/9/2027 | (1.270) | (1.270) |
| IRS | KRW 61.025.250 | Fund receives Fixed 3,070% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | JP Morgan | 21/9/2027 | (308) | (308) |
| IRS | KRW 65.719.500 | Fund receives Fixed 3,098% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | JP Morgan | 21/9/2027 | (268) | (268) |
| IRS | KRW 93.500.000 | Fund receives Fixed 3,206% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | JP Morgan | 21/9/2027 | (22) | (22) |
| IRS | KRW 19.850.000.000 | Fund receives Fixed 2,325% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Standard Chartered Bank | 21/9/2023 | (111.911) | (111.911) |
| TRS | USD 1.700.000 | Fund receives 3 Month SOFR and pays Markit iBoxx US Dollar Liquid High Index | BNP Paribas | 20/6/2022 | 26.712 | 26.715 |
| TRS | USD 1.900.000 | Fund receives 3 Month SOFR and pays Markit iBoxx US Dollar Liquid High Index | BNP Paribas | 20/6/2022 | (63.688) | (62.947) |
| TRS | USD 4.100.000 | Fund receives 3 Month SOFR and pays Markit iBoxx US Dollar Liquid High Index | Goldman Sachs | 20/6/2022 | (27.734) | (27.067) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 17.894.402) | | | | | (1.617.532) | (1.983.442) |

CCSDS: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps
 CCILS: Zentral abgewickelte inflationsgebundene Swaps
 CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps
 CDS: Credit Default Swaps
 IRS: Zinsraten-Swaps
 TRS: Gesamtertrag-Swaps

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (31) | EUR | 3 Month EURIBOR Futures June 2023 | Juni 2023 | 7.632.587 | 12.500 |
| 26 | GBP | 3 Month SONIA Futures December 2022 | März 2023 | 7.454.895 | (22.857) |
| 77 | AUD | 90 Day Bank Bill Futures December 2022 | Dezember 2022 | 51.212.930 | (138.907) |
| 67 | AUD | Australian 10 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 5.487.222 | (19.133) |
| (4) | AUD | Australian 3 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 291.511 | 362 |
| (28) | CAD | Canadian 10 Year Bond Futures September 2022 | September 2022 | 2.625.243 | 26.255 |
| (105) | EUR | Euro BOBL Futures June 2022 | Juni 2022 | 13.272.000 | 94.460 |
| (52) | EUR | Euro BTP Futures June 2022 | Juni 2022 | 6.597.240 | 146.903 |
| (90) | EUR | Euro Bund Futures June 2022 | Juni 2022 | 13.634.100 | 183.310 |
| (14) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 2.276.960 | 434.662 |
| (155) | EUR | Euro Schatz Futures June 2022 | Juni 2022 | 17.064.725 | 16.884 |
| (67) | EUR | Euro-OAT Futures June 2022 | Juni 2022 | 9.649.340 | 217.950 |
| (8) | JPY | Japan 10 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 8.679.168 | (3.552) |
| 55 | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2022 | September 2022 | 7.511.802 | (133.946) |
| (22) | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2022 | September 2022 | 3.004.721 | 57.541 |
| 1 | USD | US Long Bond Futures September 2022 | September 2022 | 129.842 | (1.815) |
| (21) | USD | US Long Bond Futures September 2022 | September 2022 | 2.726.692 | 37.077 |
| 43 | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 5.152.976 | (33.924) |
| (7) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 838.857 | 6.373 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| 40 | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 4.457.410 | (29.833) |
| (42) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 4.680.280 | 30.186 |
| 5 | USD | US Treasury 2 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 984.794 | 1.591 |
| (198) | USD | US Treasury 2 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 38.997.860 | 17.682 |
| 21 | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 2.212.872 | (9.626) |
| (311) | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 32.771.583 | 124.054 |
| (6) | USD | US Ultra Bond Futures September 2022 | September 2022 | 869.370 | 13.961 |
| Gesamt | | | | | 1.028.158 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------|--------------------------|-------------------------------|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 364 | Put | EURO STOXX 50 Index | Bank of America Merrill Lynch | EUR 3.738,25 | 16/09/2022 | 11.841 | 45.904 |
| 3.160.000 | Call | OTC EUR/USD | Bank of America Merrill Lynch | EUR 1,19 | 05/08/2022 | (23.915) | 259 |
| 70.000 | Put | OTC USD/JPY | Bank of America Merrill Lynch | USD 105,00 | 28/03/2023 | (2.502) | 1.328 |
| 70.000 | Put | OTC USD/JPY | Bank of America Merrill Lynch | USD 105,00 | 28/03/2023 | (2.502) | 1.328 |
| 50.000 | Put | OTC USD/JPY | Bank of America Merrill Lynch | USD 110,00 | 19/04/2023 | (1.064) | 2.323 |
| 82.000 | Put | OTC USD/BRL | Barclays Bank | USD 4,85 | 22/07/2022 | 712 | 3.013 |
| 66.000 | Put | OTC USD/CLP | Barclays Bank | USD 815,00 | 09/06/2022 | (963) | 215 |
| 66.000 | Put | OTC USD/CLP | Barclays Bank | USD 845,00 | 01/06/2022 | 612 | 1.375 |
| 1.030.000 | Put | OTC USD/JPY | Barclays Bank | USD 115,00 | 21/09/2022 | (6.247) | 1.286 |
| 94.000 | Put | OTC EUR/USD | BNP Paribas | EUR 1,05 | 01/06/2022 | (1.092) | — |
| 164.000 | Put | OTC USD/JPY | Citibank | USD 126,00 | 21/07/2022 | (865) | 1.058 |
| 1.870.000 | Call | OTC EUR/USD | Credit Suisse | EUR 1,21 | 10/08/2022 | (7.291) | 67 |
| 12 | Call | Cellnex Telecom SA | Exchange Traded | EUR 60,00 | 17/06/2022 | (2.376) | 12 |
| 8 | Call | Cellnex Telecom SA | Exchange Traded | EUR 54,00 | 16/09/2022 | (764) | 196 |
| 8 | Put | DAX Index | Exchange Traded | EUR 12.500,00 | 17/06/2022 | (6.256) | 500 |
| 28 | Put | DAX Index | Exchange Traded | EUR 12.900,00 | 17/06/2022 | (28.789) | 3.143 |
| 2 | Call | easyJet Plc | Exchange Traded | GBP 7,50 | 17/06/2022 | (995) | — |
| 38 | Call | Electricite de France SA | Exchange Traded | EUR 12,43 | 17/06/2022 | 40 | 40 |
| 2 | Put | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 4.150,00 | 17/06/2022 | (4.857) | 20.593 |
| 1 | Call | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 4.600,00 | 17/06/2022 | (18.578) | 82 |
| 1 | Call | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 4.900,00 | 17/06/2022 | (5.883) | 16 |
| 1 | Call | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 6.000,00 | 20/01/2023 | (516) | 96 |
| 3 | Put | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 4.300,00 | 15/07/2022 | 32.808 | 66.959 |
| 2 | Put | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 3.750,00 | 17/06/2022 | (12.258) | 2.315 |
| 1 | Put | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 3.800,00 | 19/08/2022 | (5.098) | 8.399 |
| 1 | Put | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 3.650,00 | 15/07/2022 | (3.456) | 2.936 |
| 1 | Put | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 3.400,00 | 19/08/2022 | (2.048) | 3.271 |
| 1 | Put | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 3.500,00 | 21/10/2022 | (3.413) | 7.748 |
| 3 | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.300,00 | 16/09/2022 | (3.686) | 1.951 |
| 3 | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 2.700,00 | 16/09/2022 | (1.790) | 549 |
| 12 | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.400,00 | 16/09/2022 | (9.298) | 8.460 |
| 5 | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.400,00 | 17/06/2022 | (3.467) | 375 |
| 12 | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.700,00 | 16/09/2022 | (10.393) | 18.156 |
| 10 | Call | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 4.200,00 | 17/06/2022 | (3.691) | 65 |
| 1 | Call | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 4.000,00 | 16/12/2022 | 548 | 1.327 |
| 2 | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.000,00 | 16/09/2022 | (702) | 688 |
| 1 | Call | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 4.350,00 | 16/09/2022 | 25 | 92 |
| 6 | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.400,00 | 15/07/2022 | (3.666) | 1.800 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|--------------|------------------------|-----------------|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 1 | Call | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.850,00 | 16/09/2022 | 532 | 1.400 |
| 1 | Call | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.750,00 | 17/06/2022 | 430 | 940 |
| 6 | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.100,00 | 15/07/2022 | (1.787) | 588 |
| 21 | Call | EURO STOXX Banks Index | Exchange Traded | EUR 140,00 | 16/09/2022 | (1.140) | 53 |
| 25 | Call | EURO STOXX Banks Index | Exchange Traded | EUR 130,00 | 16/09/2022 | (625) | 125 |
| 9 | Call | EURO STOXX Banks Index | Exchange Traded | EUR 100,00 | 17/06/2022 | (1.035) | 202 |
| 7 | Call | EURO STOXX Banks Index | Exchange Traded | EUR 95,00 | 17/06/2022 | (509) | 402 |
| 1 | Put | FTSE 100 Index | Exchange Traded | GBP 7.000,00 | 16/09/2022 | (1.948) | 1.551 |
| 1 | Put | FTSE 100 Index | Exchange Traded | GBP 6.200,00 | 16/09/2022 | (856) | 552 |
| 2 | Put | FTSE 100 Index | Exchange Traded | GBP 6.800,00 | 15/07/2022 | (2.454) | 682 |
| 130.000 | Put | OTC USD/JPY | Goldman Sachs | USD 126,50 | 22/08/2022 | (782) | 1.435 |
| 2.920.000 | Call | OTC USD/CNH | HSBC | USD 6,90 | 18/08/2022 | (6.457) | 10.489 |
| 1.920.000 | Call | OTC USD/CNH | HSBC | USD 6,90 | 18/08/2022 | (2.174) | 6.897 |
| 92.000 | Call | OTC AUD/USD | JP Morgan | AUD 0,72 | 01/06/2022 | (529) | — |
| 92.000 | Put | OTC AUD/USD | JP Morgan | AUD 0,70 | 02/06/2022 | (457) | 3 |
| 46.000 | Put | OTC EUR/NOK | JP Morgan | EUR 10,05 | 16/06/2022 | (85) | 277 |
| 1.870.000 | Call | OTC EUR/USD | JP Morgan | EUR 1,21 | 10/08/2022 | (7.413) | 67 |
| 98.000 | Call | OTC USD/IDR | Morgan Stanley | USD 14.800,00 | 15/08/2022 | (922) | 720 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 3.668.682) | | | | | | (160.046) | 234.308 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|--------------|------------------------|-----------------|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (48.000) | Call | OTC USD/BRL | Barclays Bank | USD 5,20 | 22/07/2022 | 215 | (318) |
| (130.000) | Put | OTC USD/BRL | Barclays Bank | USD 4,60 | 22/07/2022 | (465) | (1.691) |
| (66.000) | Call | OTC USD/CLP | Barclays Bank | USD 850,00 | 09/06/2022 | 709 | (172) |
| (98.000) | Put | OTC USD/CLP | Barclays Bank | USD 820,00 | 01/06/2022 | 370 | — |
| (1.030.000) | Put | OTC USD/JPY | Barclays Bank | USD 112,00 | 21/09/2022 | 3.581 | (771) |
| (140.000) | Put | OTC EUR/USD | BNP Paribas | EUR 1,02 | 01/06/2022 | 523 | — |
| (164.000) | Put | OTC USD/JPY | Citibank | USD 120,00 | 21/07/2022 | 337 | (153) |
| (1) | Put | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 3.400,00 | 15/07/2022 | 1.668 | (1.294) |
| (2) | Put | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 3.600,00 | 19/08/2022 | 6.251 | (10.735) |
| (1) | Put | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 3.250,00 | 21/10/2022 | 2.135 | (4.924) |
| (2) | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.200,00 | 17/06/2022 | 811 | (60) |
| (24) | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.550,00 | 16/09/2022 | 17.701 | (27.312) |
| (3) | Call | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 4.400,00 | 17/06/2022 | 256 | (6) |
| (3) | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.000,00 | 17/06/2022 | 753 | (36) |
| (5) | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 2.900,00 | 16/09/2022 | 1.485 | (1.367) |
| (2) | Call | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 4.100,00 | 16/09/2022 | (406) | (932) |
| (12) | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 3.250,00 | 15/07/2022 | 5.020 | (2.172) |
| (9) | Call | EURO STOXX Banks Index | Exchange Traded | EUR 110,00 | 17/06/2022 | 315 | (22) |
| (7) | Call | EURO STOXX Banks Index | Exchange Traded | EUR 105,00 | 17/06/2022 | 252 | (35) |
| (2) | Put | FTSE 100 Index | Exchange Traded | GBP 6.400,00 | 15/07/2022 | 1.277 | (376) |
| (2) | Put | FTSE 100 Index | Exchange Traded | GBP 6.600,00 | 16/09/2022 | 2.617 | (1.821) |
| (48.000) | Put | OTC USD/JPY | Goldman Sachs | USD 126,00 | 22/06/2022 | 222 | (123) |
| (48.000) | Call | OTC USD/JPY | Goldman Sachs | USD 130,00 | 22/06/2022 | 80 | (222) |
| (130.000) | Put | OTC USD/JPY | Goldman Sachs | USD 121,00 | 22/08/2022 | 409 | (359) |
| (32.000) | Call | OTC USD/TRY | Goldman Sachs | USD 17,50 | 19/07/2022 | 255 | (1.375) |
| (2.920.000) | Call | OTC USD/CNH | HSBC | USD 7,10 | 18/08/2022 | 2.395 | (4.037) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|-----------------------|----------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (1.920.000) | Call | OTC USD/CNH | HSBC | USD 7,10 | 18/08/2022 | 845 | (2.654) |
| (116.000) | Call | OTC AUD/USD | JP Morgan | AUD 0,75 | 01/07/2022 | 165 | (99) |
| (92.000) | Put | OTC AUD/USD | JP Morgan | AUD 0,68 | 02/06/2022 | 169 | — |
| (23.000) | Call | OTC EUR/NOK | JP Morgan | EUR 10,50 | 15/07/2022 | 154 | (93) |
| (64.000) | Put | OTC USD/IDR | Morgan Stanley | USD 14.400,00 | 15/08/2022 | (48) | (399) |
| (98.000) | Call | OTC USD/IDR | Morgan Stanley | USD 15.200,00 | 15/08/2022 | 550 | (309) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 1.033.879) | | | | | | 50.601 | (63.867) |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|--|---------------|---------------|---------------|------------------------------------|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| 1.600.000 | Call | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 from 18/1/2023 | Barclays Bank | EUR 1,10 | 18/01/2023 | 550 | 16.870 |
| 79.000 | Call | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 17/8/2022 | Barclays Bank | EUR 3,25 | 17/08/2022 | 16 | 37 |
| 1.040.000 | Put | Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 20/3/2023; and pays 1,36% Fixed annually from 16/9/2022 | Goldman Sachs | EUR 1,36 | 16/09/2022 | 45.066 | 59.411 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 1.589.416) | | | | | | 45.632 | 76.318 |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------|---|---------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (1.040.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,66% Fixed annually from 16/9/2022; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 20/3/2023 | Goldman Sachs | EUR 1,66 | 16/09/2022 | (28.771) | (36.220) |
| (1.600.000) | Put | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2022; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 from 18/1/2023 | Barclays Bank | EUR 1,55 | 18/01/2023 | 2.271 | (6.209) |
| (1.600.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 from 18/1/2023; and provides 1% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Barclays Bank | EUR 0,90 | 18/01/2023 | 64 | (7.776) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|--------------|---|---------------|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (79.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 17/8/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Barclays Bank | EUR 4,37 | 17/08/2022 | (56) | (1.002) |
| (300.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 from 21/9/2022; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Barclays Bank | EUR 4,38 | 21/09/2022 | (212) | (4.448) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 1.790.500) | | | | | | (26.704) | (55.655) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-------------|---------|----------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 34.000 | CAD | 30.685 | Royal Bank of Canada | 21/6/2022 | 138 |
| AUD | 740.000 | EUR | 498.986 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (3.318) |
| AUD | 240.000 | EUR | 156.509 | HSBC | 15/6/2022 | 4.248 |
| AUD | 136.000 | USD | 95.726 | Deutsche Bank | 21/6/2022 | 1.798 |
| BRL | 80.989 | USD | 16.000 | Barclays Bank | 2/6/2022 | 1.139 |
| BRL | 216.464 | USD | 43.220 | Citibank | 2/6/2022 | 2.620 |
| BRL | 158.592 | USD | 32.000 | Deutsche Bank | 2/6/2022 | 1.606 |
| BRL | 33.944 | USD | 6.780 | Goldman Sachs | 2/6/2022 | 408 |
| BRL | 81.178 | USD | 16.000 | JP Morgan | 2/6/2022 | 1.176 |
| BRL | 152.864 | USD | 32.000 | Morgan Stanley | 5/7/2022 | 186 |
| CAD | 30.845 | USD | 24.000 | Toronto Dominion Bank | 21/6/2022 | 366 |
| CHF | 753.110 | EUR | 740.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (7.268) |
| CHF | 774.596 | EUR | 750.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 3.636 |
| CHF | 31.272 | GBP | 26.000 | Deutsche Bank | 27/6/2022 | (94) |
| CLP | 27.568.000 | USD | 32.000 | Bank of America Merrill Lynch | 2/6/2022 | 1.260 |
| CLP | 27.632.000 | USD | 32.000 | Citibank | 2/6/2022 | 1.332 |
| CLP | 40.820.176 | USD | 49.494 | BNP Paribas | 13/6/2022 | (200) |
| CNH | 770.000 | USD | 115.173 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 131 |
| CNH | 2.583.536 | USD | 382.218 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 4.372 |
| CNH | 4.240.000 | USD | 660.262 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (23.594) |
| CNH | 476.464 | USD | 70.482 | HSBC | 15/6/2022 | 813 |
| COP | 125.120.000 | USD | 32.000 | BNP Paribas | 21/6/2022 | 1.204 |
| EUR | 221.973 | AUD | 330.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 932 |
| EUR | 206.319 | AUD | 310.000 | Royal Bank of Canada | 15/6/2022 | (1.326) |
| EUR | 272.236 | AUD | 400.000 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 4.307 |
| EUR | 130.425 | AUD | 200.000 | THE BANK OF NEW YORK MELLON | 15/6/2022 | (3.540) |
| EUR | 361.710 | CAD | 500.000 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (7.182) |
| EUR | 565.695 | CHF | 580.296 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 1.102 |
| EUR | 294.305 | CHF | 302.392 | HSBC | 15/6/2022 | 95 |
| EUR | 250.000 | CHF | 256.827 | JP Morgan | 15/6/2022 | 123 |
| EUR | 380.000 | CHF | 390.889 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (311) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|--------------------------------------|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 28.477 | CNH | 200.000 | Royal Bank of Canada | 15/6/2022 | 535 |
| EUR | 38.246.016 | GBP | 32.187.304 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 435.710 |
| EUR | 180.000 | GBP | 152.249 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 1.153 |
| EUR | 1.510.000 | GBP | 1.266.651 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 22.069 |
| EUR | 930.000 | GBP | 774.422 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 20.289 |
| EUR | 639.887 | GBP | 540.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 5.551 |
| EUR | 689.297 | GBP | 580.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 7.973 |
| EUR | 2.378.161 | GBP | 2.000.000 | Royal Bank of Canada | 15/6/2022 | 28.768 |
| EUR | 588.431 | GBP | 500.000 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 1.083 |
| EUR | 1.191.820 | GBP | 1.000.000 | THE BANK OF NEW YORK MELLON | 15/6/2022 | 17.124 |
| EUR | 165.207 | HKD | 1.420.000 | Royal Bank of Canada | 15/6/2022 | (3.666) |
| EUR | 46.367 | HKD | 400.000 | Westpac | 15/6/2022 | (1.202) |
| EUR | 46.000 | HUF | 17.881.946 | UBS | 21/6/2022 | 927 |
| EUR | 60.757 | JPY | 8.000.000 | Royal Bank of Canada | 15/6/2022 | 2.770 |
| EUR | 29.535 | MXN | 700.000 | HSBC | 15/6/2022 | (3.686) |
| EUR | 186.062 | NZD | 300.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 3.978 |
| EUR | 233.504 | PLN | 1.100.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | (6.563) |
| EUR | 28.908 | SEK | 300.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 401 |
| EUR | 94.020 | SEK | 1.000.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (1.005) |
| EUR | 309.874 | SEK | 3.310.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (4.659) |
| EUR | 50.067 | SGD | 75.000 | THE BANK OF NEW YORK MELLON | 15/6/2022 | (966) |
| EUR | 22.872 | USD | 24.018 | BNP Paribas | 2/6/2022 | 452 |
| EUR | 9.128 | USD | 9.594 | UBS | 2/6/2022 | 172 |
| EUR | 22.192.164 | USD | 24.447.623 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (615.635) |
| EUR | 1.121.496 | USD | 1.218.820 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (15.572) |
| EUR | 1.400.277 | USD | 1.509.018 | BNP Paribas | 15/6/2022 | (7.524) |
| EUR | 8.078.541 | USD | 8.569.268 | Citibank | 15/6/2022 | 84.057 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) | | | | | | | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) | | | | | | |
|---|---------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|-----------|---|-----------|---------|---------------|-----------------------------------|------------|----------|
| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | EUR | Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | EUR |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | | OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 21.239.460 | USD | 23.329.428 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (525.150) | USD | 32.000 | CLP | 27.254.400 | UBS | 2/6/2022 | (906) |
| EUR | 670.000 | USD | 744.593 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | (24.649) | USD | 49.494 | CLP | 40.820.176 | Barclays Bank | 13/6/2022 | 200 |
| EUR | 1.181.720 | USD | 1.262.747 | HSBC | 15/6/2022 | 3.671 | USD | 138.446 | CNH | 890.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 4.815 |
| EUR | 1.860.266 | USD | 2.000.907 | JP Morgan | 15/6/2022 | (6.431) | USD | 584.139 | CNH | 3.727.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 24.249 |
| EUR | 9.043.374 | USD | 9.916.964 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (208.411) | USD | 275.174 | CNH | 1.770.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 9.425 |
| EUR | 423.674 | USD | 441.465 | Natwest Markets | 15/6/2022 | 11.821 | USD | 448.260 | CNH | 3.060.000 | HSBC | 15/6/2022 | (9.328) |
| EUR | 261.885 | USD | 284.449 | Royal Bank of Canada | 15/6/2022 | (3.484) | USD | 32.000 | COP | 129.568.000 | Citibank | 21/6/2022 | (2.308) |
| EUR | 694.261 | USD | 732.783 | Societe Generale | 15/6/2022 | 10.629 | USD | 48.422 | EUR | 46.000 | Deutsche Bank | 2/6/2022 | (798) |
| EUR | 1.756.693 | USD | 1.886.000 | Standard Chartered Bank | 15/6/2022 | (2.804) | USD | 67.372 | EUR | 64.000 | Royal Bank of Canada | 2/6/2022 | (1.108) |
| EUR | 14.730 | USD | 16.000 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (196) | USD | 24.000 | EUR | 21.660 | ANZ | 15/6/2022 | 730 |
| EUR | 643.776 | USD | 695.000 | Toronto Dominion Bank | 15/6/2022 | (4.607) | USD | 2.235.520 | EUR | 2.095.812 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (10.239) |
| EUR | 324.897 | USD | 357.561 | UBS | 15/6/2022 | (8.680) | USD | 758.024 | EUR | 686.924 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 20.256 |
| EUR | 15.978 | ZAR | 270.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (128) | USD | 757.662 | EUR | 710.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | (3.157) |
| GBP | 753.541 | EUR | 900.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (14.818) | USD | 1.356.280 | EUR | 1.250.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 15.307 |
| GBP | 533.961 | EUR | 626.676 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 565 | USD | 613.851 | EUR | 570.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 2.677 |
| GBP | 1.141.281 | EUR | 1.360.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (19.342) | USD | 560.273 | EUR | 516.516 | HSBC | 15/6/2022 | 6.176 |
| GBP | 307.749 | EUR | 370.000 | HSBC | 15/6/2022 | (8.488) | USD | 3.574.886 | EUR | 3.330.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 5.101 |
| GBP | 797.692 | EUR | 948.245 | JP Morgan | 15/6/2022 | (11.200) | USD | 1.281.572 | EUR | 1.174.738 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 20.873 |
| GBP | 520.000 | EUR | 615.157 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (4.314) | USD | 210.000 | EUR | 188.205 | Royal Bank of Canada | 15/6/2022 | 7.710 |
| GBP | 2.620.000 | EUR | 3.128.538 | THE BANK OF NEW YORK MELLON | 15/6/2022 | (50.833) | USD | 460.000 | EUR | 435.274 | Standard Chartered Bank | 15/6/2022 | (6.129) |
| GBP | 542.911 | USD | 676.094 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 7.009 | USD | 389.000 | EUR | 367.055 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (4.148) |
| GBP | 590.000 | USD | 725.355 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 16.369 | USD | 2.855.478 | EUR | 2.721.610 | UBS | 15/6/2022 | (57.662) |
| GBP | 520.000 | USD | 643.763 | HSBC | 15/6/2022 | 10.260 | USD | 580.090 | GBP | 460.000 | Citibank | 15/6/2022 | 820 |
| GBP | 220.000 | USD | 289.865 | JP Morgan | 15/6/2022 | (11.989) | USD | 326.006 | GBP | 260.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (1.282) |
| GBP | 77.089 | USD | 101.805 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (4.421) | USD | 884.517 | GBP | 720.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | (20.592) |
| HKD | 1.550.000 | EUR | 183.890 | Chartered Bank | 15/6/2022 | 442 | USD | 326.195 | GBP | 260.000 | HSBC | 15/6/2022 | (1.105) |
| HUF | 17.926.430 | EUR | 46.000 | UBS | 21/6/2022 | (816) | USD | 420.408 | GBP | 320.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 16.307 |
| IDR | 3.300.000.000 | USD | 227.853 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (860) | USD | 1.132.171 | GBP | 920.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (24.490) |
| INR | 2.483.840 | USD | 32.000 | Citibank | 21/6/2022 | (84) | USD | 326.551 | GBP | 260.000 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (774) |
| JPY | 6.183.034 | USD | 48.000 | Goldman Sachs | 21/6/2022 | 48 | USD | 114.879 | IDR | 1.650.000.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 1.318 |
| JPY | 6.132.708 | USD | 48.000 | JP Morgan | 21/6/2022 | (316) | USD | 64.000 | INR | 4.996.352 | Nomura International | 15/6/2022 | 1.191 |
| KRW | 330.000.000 | EUR | 244.916 | JP Morgan | 15/6/2022 | 2.900 | USD | 48.000 | JPY | 6.100.914 | Citibank | 21/6/2022 | (174) |
| MXN | 546.018 | USD | 26.862 | Deutsche Bank | 1/6/2022 | 920 | USD | 32.000 | JPY | 4.069.808 | Citibank | 21/6/2022 | 548 |
| MXN | 429.566 | USD | 21.138 | Goldman Sachs | 1/6/2022 | 720 | USD | 16.000 | JPY | 2.060.576 | JP Morgan | 21/6/2022 | 346 |
| MXN | 2.046.292 | USD | 101.858 | HSBC | 1/6/2022 | 2.338 | USD | 16.000 | JPY | 2.060.576 | UBS | 21/6/2022 | (12) |
| MXN | 321.215 | USD | 16.000 | Deutsche Bank | 16/6/2022 | 314 | USD | 51.858 | MXN | 1.039.208 | Deutsche Bank | 1/6/2022 | (1.066) |
| MXN | 945.370 | USD | 48.000 | Barclays Bank | 21/6/2022 | 30 | USD | 32.000 | MXN | 661.852 | Goldman Sachs | 1/6/2022 | (1.638) |
| MYR | 750.000 | USD | 179.340 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (7.703) | USD | 34.000 | MXN | 697.176 | HSBC | 1/6/2022 | (1.454) |
| NZD | 1.260.000 | USD | 816.002 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 3.484 | USD | 32.000 | MXN | 652.140 | Morgan Stanley | 1/6/2022 | (1.176) |
| PLN | 221.714 | USD | 50.000 | Morgan Stanley | 21/6/2022 | 1.700 | USD | 16.000 | MXN | 326.728 | HSBC | 16/6/2022 | (576) |
| SEK | 2.500.000 | EUR | 240.242 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (2.679) | USD | 48.000 | MXN | 958.752 | HSBC | 21/6/2022 | (664) |
| SGD | 240.000 | USD | 175.644 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (557) | USD | 23.780 | MXN | 482.326 | BNP Paribas | 24/8/2022 | (395) |
| TRY | 15.739 | USD | 988 | Barclays Bank | 8/6/2022 | (32) | USD | 45.802 | MXN | 926.000 | JP Morgan | 24/8/2022 | (621) |
| TRY | 495.048 | USD | 31.012 | UBS | 8/6/2022 | (944) | USD | 175.029 | MYR | 750.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 3.681 |
| USD | 818.962 | AUD | 1.140.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 434 | USD | 50.000 | PLN | 217.476 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2022 | (776) |
| USD | 32.180 | AUD | 46.000 | Deutsche Bank | 21/6/2022 | (794) | USD | 176.576 | SGD | 240.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 1.426 |
| USD | 82.000 | BRL | 403.600 | Citibank | 2/6/2022 | (3.563) | USD | 32.000 | TRY | 512.000 | Citibank | 8/6/2022 | 908 |
| USD | 32.000 | BRL | 154.912 | HSBC | 2/6/2022 | (876) | USD | 50.000 | TRY | 773.760 | Goldman Sachs | 29/6/2022 | 3.968 |
| USD | 8.606 | CLP | 7.407.184 | Barclays Bank | 2/6/2022 | (332) | USD | 16.000 | TRY | 279.824 | Barclays Bank | 20/7/2022 | (122) |
| USD | 23.394 | CLP | 20.159.780 | Goldman Sachs | 2/6/2022 | (928) | USD | 34.000 | ZAR | 532.650 | JP Morgan | 17/6/2022 | (44) |
| | | | | | | | USD | 86.000 | ZAR | 1.375.914 | Toronto Dominion Bank | 17/6/2022 | (1.820) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|------------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISEINTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 16.000 | ZAR | 259.032 | UBS | 17/6/2022 | (520) |
| ZAR | 769.671 | USD | 48.000 | BNP Paribas | 17/6/2022 | 1.119 |
| | | | | | | (904.015) |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 152 | EUR | 146 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 2 |
| EUR | 3 | CHF | 3 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | — |
| | | | | | | 2 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 97.658 | GBP | 83.868 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (860) |
| GBP | 2.891.847 | EUR | 3.374.708 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 22.333 |
| | | | | | | 21.473 |
| Auf SEK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 30.575 | SEK | 321.505 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 24 |
| SEK | 14.182.115 | EUR | 1.353.147 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (5.492) |
| | | | | | | (5.468) |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 11.278 | USD | 11.923 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 155 |
| USD | 6.556.006 | EUR | 6.183.683 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (67.421) |
| | | | | | | (67.266) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 183.825.213) | | | | | | (955.274) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|---------------------------------------|--------------|
| Finanzen | 26,71 |
| Mit Hypotheken besicherte Wertpapiere | 15,38 |
| Asset Backed Securities (ABS) | 7,21 |
| Staatsanleihen | 6,71 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 5,21 |
| Zyklische Konsumgüter | 4,91 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 4,24 |
| Versorger | 3,00 |
| Kommunikation | 2,98 |
| Energie | 2,94 |
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 1,70 |
| Technologie | 1,68 |
| Industrie | 1,53 |
| Grundstoffe | 1,21 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 85,41 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 14,59 |
| | 100,00 |

| Holding | Wertpapierbezeichnung | Marktwert EUR | In % des NAV |
|---|-------------------------------------|---------------|--------------|
| To be Announced Securities Contracts | | | |
| United States | | | |
| USD 191.000 | Fannie Mae or Freddie Mac 3,000 TBA | 170.559 | 0,11 |
| USD 1.548.000 | Fannie Mae or Freddie Mac 5,000 TBA | 1.491.102 | 0,96 |
| USD (191.000) | Fannie Mae or Freddie Mac 3,000 TBA | (170.858) | (0,11) |
| USD (944.000) | Fannie Mae or Freddie Mac 3,500 TBA | (866.550) | (0,56) |
| | | 624.253 | 0,40 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 12.666.703) | | 624.253 | 0,40 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Equity Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | |
|--|-------------------------------|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|-------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Vereinigte Staaten von Amerika <i>Fortsetzung</i> | | | | |
| STAMMAKTIEN | | | | | | | | |
| Kanada | | | | | | | | |
| 7.660 | Canadian National Railway Co | 873.507 | 1,32 | 5.678 | NIKE Inc 'B' | 659.727 | 1,00 | |
| 2.256 | Docebo Inc | 78.403 | 0,12 | 8.234 | ROBLOX Corp 'A' | 255.913 | 0,39 | |
| | | 951.910 | 1,44 | 1.787 | SVB Financial Group | 866.695 | 1,31 | |
| | | | | 2.518 | Thermo Fisher Scientific Inc | 1.438.886 | 2,18 | |
| | | | | 28.818 | WillScot Mobile Mini Holdings Corp | 1.046.958 | 1,59 | |
| | | | | | | 16.575.486 | 25,11 | |
| | | | | Gesamt Stammaktien | | | 44.066.873 | 66,75 |
| Kaimaninseln | | | | ANLEIHEN | | | | |
| 48.000 | Tencent Holdings Ltd | 2.216.754 | 3,36 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| 119.500 | Wuxi Biologics Cayman Inc | 883.251 | 1,34 | USD 5.000.000 | United States Treasury Bill 18/8/2022 (Zero Coupon) | 4.989.979 | 7,56 | |
| | | 3.100.005 | 4,70 | USD 3.000.000 | United States Treasury Bill 8/9/2022 (Zero Coupon) | 2.990.983 | 4,53 | |
| Dänemark | | | | | | | | |
| 9.299 | Ascendis Pharma A/S ADR | 814.871 | 1,24 | | | | | |
| 18.496 | Novo Nordisk A/S 'B' | 2.048.127 | 3,10 | | | | | |
| 29.842 | Vestas Wind Systems A/S | 771.511 | 1,17 | | | | | |
| | | 3.634.509 | 5,51 | Gesamt Anleihen | | | | |
| Frankreich | | | | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | |
| 1.228 | Kering SA | 662.615 | 1,00 | 52.047.835 | | | | |
| 9.385 | Sanofi | 994.812 | 1,51 | 78,84 | | | | |
| | | 1.657.427 | 2,51 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | | |
| Deutschland | | | | Irland | | | | |
| 43.616 | Infineon Technologies AG | 1.352.416 | 2,05 | 61.905 | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Dist)~ | 6.191.104 | 9,38 | |
| 4.773 | MTU Aero Engines AG | 942.084 | 1,43 | | | 6.191.104 | 9,38 | |
| | | 2.294.500 | 3,48 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | | | |
| Island | | | | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | | |
| 154.881 | Marel HF | 726.713 | 1,10 | 6.191.104 | | | | |
| | | 726.713 | 1,10 | 58.238.939 | | | | |
| Italien | | | | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | | |
| 484.803 | Intesa Sanpaolo SpA | 1.051.155 | 1,59 | 7.775.062 | | | | |
| 71.729 | UniCredit SpA | 832.327 | 1,26 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | | | |
| | | 1.883.482 | 2,85 | 66.014.001 | | | | |
| Japan | | | | ~ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9. | | | | |
| 54.200 | Recruit Holdings Co Ltd | 1.992.644 | 3,02 | | | | | |
| 17.200 | Sony Corp | 1.618.281 | 2,45 | | | | | |
| | | 3.610.925 | 5,47 | | | | | |
| Niederlande | | | | | | | | |
| 2.860 | ASML Holding NV | 1.654.745 | 2,50 | | | | | |
| 13.979 | Koninklijke DSM NV | 2.335.351 | 3,54 | | | | | |
| | | 3.990.096 | 6,04 | | | | | |
| Spanien | | | | | | | | |
| 49.471 | Cellnex Telecom SA | 2.259.211 | 3,42 | | | | | |
| | | 2.259.211 | 3,42 | | | | | |
| Schweden | | | | | | | | |
| 75.349 | Epiroc AB 'A' | 1.459.989 | 2,21 | | | | | |
| | | 1.459.989 | 2,21 | | | | | |
| Schweiz | | | | | | | | |
| 5.638 | Roche Holding AG | 1.922.620 | 2,91 | | | | | |
| | | 1.922.620 | 2,91 | | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | | | |
| 8.197 | Airbnb Inc 'A' | 969.377 | 1,47 | | | | | |
| 576 | Amazon.com Inc | 1.345.611 | 2,04 | | | | | |
| 4.302 | Axon Enterprise Inc | 428.952 | 0,65 | | | | | |
| 17.336 | Baker Hughes Co | 645.766 | 0,98 | | | | | |
| 6.780 | Chart Industries Inc | 1.209.755 | 1,83 | | | | | |
| 49.638 | Comcast Corp 'A' | 2.173.648 | 3,29 | | | | | |
| 2.456 | Equinix Inc (REIT) | 1.675.041 | 2,54 | | | | | |
| 26.709 | GXO Logistics Inc | 1.479.679 | 2,24 | | | | | |
| 7.720 | Live Nation Entertainment Inc | 727.533 | 1,10 | | | | | |
| 2.635 | Mastercard Inc 'A' | 939.325 | 1,42 | | | | | |
| 2.849 | McDonald's Corp | 712.620 | 1,08 | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------------------|-------------------------------------|---------------|---|---|-----------------------|-------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (2.625) | WD-40 Co | JP Morgan | 18.323 |
| Frankreich | | | | (8.786) | Williams-Sonoma Inc | UBS | (24.425) |
| 10.242 | Air Liquide SA | Goldman Sachs | 28.088 | | | | <u>124.047</u> |
| | | | | | | | Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 34.497.942) |
| | | | | | | | 107.973 |
| | | | | | | | |
| Deutschland | | | | | | | |
| (9.769) | BASF SE | JP Morgan | (42.069) | | | | |
| (27.062) | Freenet AG | UBS | (42.036) | | | | |
| (12.616) | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | UBS | 1.351 | | | | |
| | | | | <u>(82.754)</u> | | | |
| Japan | | | | | | | |
| (26.800) | Asics Corp | Goldman Sachs | 14.044 | | | | |
| (16.300) | Secom Co Ltd | Goldman Sachs | (7.722) | | | | |
| (500.500) | Seven Bank Ltd | UBS | (11.661) | | | | |
| (92.000) | SoftBank Corp | JP Morgan | 20.005 | | | | |
| | | | | <u>14.666</u> | | | |
| Niederlande | | | | | | | |
| (5.630) | Heineken NV | Goldman Sachs | 7.479 | | | | |
| (20.220) | Randstad NV | UBS | (44.188) | | | | |
| | | | | <u>(36.709)</u> | | | |
| Südkorea | | | | | | | |
| (3.156) | LG Energy Solution | JP Morgan | (156.731) | | | | |
| | | | | <u>(156.731)</u> | | | |
| Spanien | | | | | | | |
| (361.357) | Mapfre SA | JP Morgan | (11.226) | | | | |
| (241.486) | Telefonica SA | UBS | (77.866) | | | | |
| | | | | <u>(89.092)</u> | | | |
| Schweden | | | | | | | |
| (92.837) | Volvo Car AB 'B' | Goldman Sachs | (5.104) | | | | |
| | | | | <u>(5.104)</u> | | | |
| Großbritannien | | | | | | | |
| 506.342 | Barclays Plc | JP Morgan | 155.534 | | | | |
| (39.486) | Bunzl Plc | Goldman Sachs | 75.558 | | | | |
| (132.559) | Sage Group Plc | JP Morgan | 10.346 | | | | |
| 140.663 | Standard Chartered Plc | UBS | 70.124 | | | | |
| | | | | <u>311.562</u> | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | | |
| (28.317) | Abercrombie & Fitch Co 'A' | JP Morgan | 378.315 | | | | |
| (12.778) | Affirm Holdings Inc | Goldman Sachs | (32.468) | | | | |
| (36.291) | Amcor Plc | UBS | (2.388) | | | | |
| (53.116) | AT&T Inc | Goldman Sachs | (49.663) | | | | |
| (3.804) | Block Inc | JP Morgan | (1.441) | | | | |
| (240) | Booking Holdings Inc | JP Morgan | (47.863) | | | | |
| (15.528) | Brink's Co | UBS | (61.025) | | | | |
| (7.207) | CarMax Inc | JP Morgan | (36.684) | | | | |
| (35.387) | Conagra Brands Inc | UBS | 113.946 | | | | |
| (2.546) | Expedia Group Inc | JP Morgan | (1.400) | | | | |
| (38.852) | Fintech Acquisition Corp V 'A' | JP Morgan | (389) | | | | |
| (36.361) | HP Inc | JP Morgan | (58.178) | | | | |
| (29.149) | Interpublic Group of Cos Inc | Goldman Sachs | (2.915) | | | | |
| (16.968) | Janus Henderson Group Plc | UBS | (10.693) | | | | |
| (21.118) | Molson Coors Beverage Co 'B' | Goldman Sachs | 44.348 | | | | |
| (17.062) | Omnicom Group Inc | UBS | 45.214 | | | | |
| (6.496) | ON Semiconductor Corp | Goldman Sachs | (31.506) | | | | |
| (7.384) | Penske Automotive Group Inc | Goldman Sachs | 8.196 | | | | |
| (6.547) | Progressive Corp | Goldman Sachs | (58.661) | | | | |
| (6.841) | Robert Half International Inc | Goldman Sachs | 21.341 | | | | |
| (4.880) | Spotify Technology SA | JP Morgan | (85.937) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|--|---------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (48) | EUR | CAC 40 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 3.320.189 | (41.239) |
| (19) | USD | E-Mini S&P 500 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 3.909.250 | 74.100 |
| (8) | HKD | Hang Seng Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 1.090.536 | (76.716) |
| (161) | JPY | Mini-Topix Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 2.386.899 | (183.237) |
| (396) | EUR | STOXX Europe 600 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 9.396.361 | (471.200) |
| Gesamt | | | | | (698.292) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 1.298.384 | USD | 1.362.321 | State Street Bank & Trust Company | 17/6/2022 | 29.562 |
| USD | 1.116.422 | CAD | 1.430.851 | UBS | 17/6/2022 | (15.146) |
| USD | 1.830.951 | CHF | 1.822.685 | State Street Bank & Trust Company | 17/6/2022 | (70.123) |
| USD | 2.590.280 | DKK | 18.371.959 | UBS | 17/6/2022 | (57.097) |
| USD | 1.392.300 | EUR | 1.295.762 | Standard Chartered Bank | 17/6/2022 | 3.228 |
| USD | 12.488.842 | EUR | 11.902.706 | State Street Bank & Trust Company | 17/6/2022 | (271.000) |
| USD | 3.249.657 | JPY | 419.876.782 | State Street Bank & Trust Company | 17/6/2022 | (12.878) |
| USD | 1.330.559 | SEK | 13.229.287 | State Street Bank & Trust Company | 17/6/2022 | (17.038) |
| | | | | | | (410.492) |

| Auf AUD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|---|------------|-----|------------|-----------------------------------|-----------|----------|
| AUD | 30.778.816 | USD | 21.857.251 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 241.499 |
| USD | 928.039 | AUD | 1.323.881 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (22.489) |
| | | | | | | 219.010 |

| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|---|---------|-----|---------|-----------------------------------|-----------|-------|
| CHF | 435.772 | USD | 454.431 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 32 |
| USD | 290.725 | CHF | 277.834 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 974 |
| | | | | | | 1.006 |

| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|---|-------|-----|-------|-----------------------------------|-----------|-----|
| EUR | 8.582 | USD | 9.097 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 100 |
| USD | 647 | EUR | 612 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (8) |
| | | | | | | 92 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 1.347.338 | USD | 1.667.153 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 29.015 |
| USD | 155.252 | GBP | 125.830 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (3.157) |
| | | | | | | 25.858 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 51.488.867) | | | | | | (164.526) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Nicht zyklische Konsumgüter | 17,54 |
| Industrie | 13,55 |
| Staatsanleihen | 12,09 |
| Kommunikation | 10,16 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 9,38 |
| Finanzen | 8,12 |
| Zyklische Konsumgüter | 6,63 |
| Technologie | 5,06 |
| Grundstoffe | 3,54 |
| Energie | 2,15 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 88,22 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 11,78 |
| 100,00 | |

BlackRock Global Event Driven Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| STAMMAKTIE UND VORZUGSAKTIE | | | | | | | |
| Australien | | | | | | | |
| 292.365 | Crown Resorts Ltd | 2.694.784 | 0,05 | 10.607 | Danaher Corp (Pref) | 14.940.172 | 0,27 |
| | | 2.694.784 | 0,05 | 600.940 | Definitive Healthcare Corp [^] | 11.411.851 | 0,21 |
| Belgien | | | | 3.881.133 | DoubleVerify Holdings Inc | 85.889.473 | 1,56 |
| 430.740 | Azelis Group NV | 11.000.496 | 0,20 | 18.335 | Duolingo Inc | 1.504.020 | 0,03 |
| | | 11.000.496 | 0,20 | 555.674 | DuPont de Nemours Inc | 37.741.378 | 0,68 |
| Bermuda | | | | 9.293 | Dutch Bros Inc 'A' [^] | 353.413 | 0,01 |
| 366.185 | Axalta Coating Systems Ltd [^] | 9.912.628 | 0,18 | 1.695.502 | Elanco Animal Health Inc [^] | 40.658.138 | 0,74 |
| | | 9.912.628 | 0,18 | 114.000 | Elanco Animal Health Inc (Pref) | 4.324.020 | 0,08 |
| Kanada | | | | 94.481 | Enfusion Inc 'A' | 1.012.836 | 0,02 |
| 6.950.000 | Bombardier Inc 'B' | 6.651.244 | 0,12 | 275.297 | EngageSmart Inc | 5.792.249 | 0,10 |
| 2.136.687 | GFL Environmental Inc [^] | 65.874.060 | 1,20 | 1.458.653 | Envista Holdings Corp [^] | 62.649.146 | 1,14 |
| 7.912 | Shopify Inc 'A' | 2.927.440 | 0,05 | 58.037 | Five9 Inc [^] | 5.770.619 | 0,10 |
| | | 75.452.744 | 1,37 | 341.675 | ForgeRock Inc 'A' | 6.707.080 | 0,12 |
| Kaimaninseln | | | | 189.389 | Freshworks Inc 'A' [^] | 2.971.513 | 0,05 |
| 581.019 | ATRenew Inc ADR | 1.632.663 | 0,03 | 74.038 | Gitlab Inc 'A' | 3.059.250 | 0,06 |
| 1.385.994 | GLOBALFOUNDRIES Inc [^] | 81.406.358 | 1,48 | 64.427 | Hexcel Corp [^] | 3.727.746 | 0,07 |
| 147.468 | Gracell Biotechnologies Inc ADR | 473.372 | 0,01 | 4.015.460 | Howmet Aerospace Inc [^] | 142.508.675 | 2,59 |
| 1.610.500 | Lufax Holding Ltd ADR | 10.113.940 | 0,18 | 1.580.909 | Informatica Inc 'A' [^] | 32.171.498 | 0,58 |
| 905.551 | RLX Technology Inc ADR | 1.797.519 | 0,03 | 113.963 | Innovage Holding Corp | 544.743 | 0,01 |
| 126.514 | Tuya Inc ADR | 326.406 | 0,01 | 224.954 | International Flavors & Fragrances Inc | 29.385.741 | 0,53 |
| | | 95.750.258 | 1,74 | 134.398 | Keysight Technologies Inc | 19.513.246 | 0,35 |
| Israel | | | | 466.000 | KKR Acquisition Holdings I Corp (Unit) | 4.608.740 | 0,08 |
| 29.428 | Riskified Ltd 'A' | 150.083 | 0,00 | 128.493 | L Brands Inc | 5.286.202 | 0,10 |
| | | 150.083 | 0,00 | 125.886 | Lattice Semiconductor Corp | 6.500.753 | 0,12 |
| Italien | | | | 489.458 | Legalzoom.com Inc | 6.338.481 | 0,11 |
| 198.435 | Atlantia SpA | 4.787.155 | 0,09 | 54.458 | Lyell Immunopharma Inc | 231.991 | 0,00 |
| | | 4.787.155 | 0,09 | 29.495 | Meta Platforms Inc 'A' | 5.716.426 | 0,10 |
| Niederlande | | | | 19.979 | Netflix Inc | 3.859.543 | 0,07 |
| 35.946 | Akzo Nobel NV [^] | 3.120.619 | 0,06 | 931.684 | Olin Corp | 62.143.323 | 1,13 |
| 77.218 | Elastic NV | 4.775.161 | 0,09 | 107.341 | ON24 Inc | 1.365.378 | 0,02 |
| 1.035.454 | QIAGEN NV | 48.207.136 | 0,87 | 1.835.000 | Orion Acquisition Corp (Unit) | 17.946.300 | 0,33 |
| | | 56.102.916 | 1,02 | 133.069 | QUALCOMM Inc | 18.414.088 | 0,33 |
| Schweiz | | | | 174.769 | Remitly Global Inc | 1.873.524 | 0,03 |
| 311.625 | On Holding AG 'A' [^] | 6.562.822 | 0,12 | 225.351 | Rivian Automotive Inc 'A' | 6.970.106 | 0,13 |
| 217.267 | Vifor Pharma AG | 37.588.663 | 0,68 | 158.551 | Robinhood Markets Inc 'A' [^] | 1.634.661 | 0,03 |
| | | 44.151.485 | 0,80 | 51.576 | ROBLOX Corp 'A' | 1.602.982 | 0,03 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | 52.726 | Root Inc 'A' | 71.971 | 0,00 |
| 8.398 | 2020 Cash Mandatory Exchangeable Trust (Pref) | 9.699.321 | 0,18 | 31.763 | salesforce.com Inc | 5.099.867 | 0,09 |
| 117.319 | ACV Auctions Inc 'A' | 993.692 | 0,02 | 12.311 | ServiceNow Inc | 5.791.956 | 0,10 |
| 248.082 | Allegheny Technologies Inc [^] | 6.730.465 | 0,12 | 47.877 | Sherwin-Williams Co | 12.764.966 | 0,23 |
| 935.669 | Arconic Rolled Products Corp [^] | 26.245.515 | 0,48 | 26.466 | Snowflake Inc 'A' | 3.384.737 | 0,06 |
| 30.044 | Boeing Co | 3.908.724 | 0,07 | 1.038.188 | Sotera Health Co [^] | 21.532.019 | 0,39 |
| 7.203.846 | Brookdale Senior Living Inc [^] | 41.133.961 | 0,75 | 367.816 | Sovos Brands Inc | 5.158.619 | 0,09 |
| 1.288.554 | Caesars Entertainment Inc | 65.175.061 | 1,18 | 873.466 | Sterling Check Corp [^] | 15.993.163 | 0,29 |
| 45.165 | Carvana Co | 1.424.956 | 0,03 | 144.426 | Sweetgreen Inc 'A' [^] | 2.642.996 | 0,05 |
| 51.736 | Charter Communications Inc 'A' | 26.212.562 | 0,48 | 43.032 | Talis Biomedical Corp | 45.399 | 0,00 |
| 106.093 | Cigna Corp | 28.674.816 | 0,52 | 146.819 | Tenet Healthcare Corp | 9.579.940 | 0,17 |
| 69.448 | Cloudflare Inc 'A' | 3.915.478 | 0,07 | 310.229 | Thoughtworks Holding Inc | 5.320.427 | 0,10 |
| 283.328 | Conagra Brands Inc [^] | 9.185.494 | 0,17 | 325.922 | T-Mobile USA Inc | 43.389.996 | 0,79 |
| 145.407 | ContextLogic Inc 'A' | 250.100 | 0,00 | 123.954 | Toast Inc 'A' | 2.070.032 | 0,04 |
| 10.972.141 | Coty Inc 'A' [^] | 77.024.430 | 1,40 | 68.059 | Unity Software Inc | 2.740.736 | 0,05 |
| 38.808 | CrowdStrike Holdings Inc 'A' | 6.455.323 | 0,12 | 548.074 | Welltower Inc (REIT) | 48.921.085 | 0,89 |
| 170.895 | Danaher Corp | 44.772.781 | 0,81 | 526.132 | WESCO International Inc (Pref) | 14.836.922 | 0,27 |
| | | | | 28.932 | Workday Inc 'A' | 4.491.114 | 0,08 |
| | | | | 48.633 | Zoom Video Communications Inc 'A' | 5.250.419 | 0,10 |
| | | | | | | 1.218.018.348 | 22,10 |
| | | | | | | 1.518.020.897 | 27,55 |
| | | | | ANLEIHEN | | | |
| | | | | Kanada | | | |
| | | | | USD 14.000.000 | Bombardier Inc 7,50% 15/3/2025 | 13.394.570 | 0,24 |
| | | | | USD 22.016.000 | Bombardier Inc 7,125% 15/6/2026 | 19.952.303 | 0,36 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| Kanada Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| USD 3.968.000 | Bombardier Inc 6,00% 15/2/2028 | 3.322.987 | 0,06 | USD 1.462.000 | Peloton Interactive Inc 15/2/2026 (Zero Coupon) | 994.675 | 0,02 |
| USD 3.777.000 | Canadian Solar Inc 2,50% 1/10/2025 | 4.111.680 | 0,08 | USD 5.411.000 | Redfin Corp 15/10/2025 (Zero Coupon) | 3.384.959 | 0,06 |
| | | 40.781.540 | 0,74 | USD 2.235.000 | Repay Holdings Corp 1/2/2026 (Zero Coupon) | 1.758.218 | 0,03 |
| Kaimaninseln | | | | USD 13.487.000 | RingCentral Inc 15/3/2026 (Zero Coupon) | 10.498.754 | 0,19 |
| USD 14.000.000 | Latam Finance Ltd 6,875% 11/4/2024 | 13.159.020 | 0,24 | USD 5.020.000 | Shift4 Payments Inc 15/12/2025 (Zero Coupon) | 4.618.517 | 0,08 |
| | | 13.159.020 | 0,24 | USD 3.252.000 | SoFi Technologies Inc 15/10/2026 (Zero Coupon) | 2.302.147 | 0,04 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | USD 4.013.000 | SolarEdge Technologies Inc 15/9/2025 (Zero Coupon) | 4.958.881 | 0,09 |
| USD 2.903.000 | Allegheny Technologies Inc 3,50% 15/6/2025 | 5.455.840 | 0,10 | USD 29.530.000 | Sotheby's 7,375% 15/10/2027 | 28.894.695 | 0,53 |
| USD 10.500.000 | AMC Entertainment Holdings Inc 10,00% 15/6/2026 | 8.261.243 | 0,15 | USD 5.446.000 | Spotify USA Inc 15/3/2026 (Zero Coupon) | 4.437.443 | 0,08 |
| USD 25.715.000 | American Airlines Group Inc 5,00% 1/6/2022 | 25.715.000 | 0,47 | USD 25.894.000 | Staples Inc 7,50% 15/4/2026 | 23.894.775 | 0,43 |
| USD 6.808.000 | Audacy Capital Corp 6,75% 31/3/2029 | 4.284.581 | 0,08 | USD 24.829.000 | Staples Inc 10,75% 15/4/2027 [^] | 20.660.335 | 0,38 |
| USD 2.536.000 | Bentley Systems Inc 0,125% 15/1/2026 | 2.230.423 | 0,04 | USD 13.767.000 | Tenet Healthcare Corp 4,25% 1/6/2029 | 12.815.520 | 0,23 |
| USD 12.564.000 | Bill.com Holdings Inc 1/12/2025 (Zero Coupon) | 13.207.270 | 0,24 | USD 20.320.000 | T-Mobile USA Inc 2,625% 15/4/2026 | 19.207.785 | 0,35 |
| USD 8.079.000 | Block Inc 0,25% 1/11/2027 | 6.440.072 | 0,12 | USD 51.900.000 | United States Treasury Bill 9/6/2022 (Zero Coupon) | 51.895.761 | 0,94 |
| USD 7.587.000 | Box Inc 15/1/2026 (Zero Coupon) | 9.028.001 | 0,17 | USD 25.000.000 | United States Treasury Bill 21/6/2022 (Zero Coupon) | 24.993.451 | 0,45 |
| USD 18.588.000 | Brookdale Senior Living Inc 2,00% 15/10/2026 | 19.318.360 | 0,35 | USD 75.000.000 | United States Treasury Bill 4/8/2022 (Zero Coupon) | 74.877.867 | 1,36 |
| USD 18.875.000 | Bruce Mansfield Unit 1 6,85% 1/6/2034 | 94.375 | 0,00 | USD 2.739.000 | Upwork Inc 0,25% 15/8/2026 | 2.089.501 | 0,04 |
| USD 9.369.000 | Caesars Entertainment Inc 6,25% 1/7/2025 | 9.467.218 | 0,17 | USD 5.746.000 | Wayfair Inc 0,625% 1/10/2025 | 4.128.029 | 0,08 |
| USD 10.660.000 | Caesars Entertainment Inc 8,125% 1/7/2027 | 10.925.541 | 0,20 | USD 23.400.000 | WeWork Cos Inc 7,875% 1/5/2025 [^] | 19.354.491 | 0,35 |
| USD 16.382.000 | Caesars Entertainment Inc 4,625% 15/10/2029 | 13.972.863 | 0,25 | | | 606.377.207 | 11,00 |
| USD 26.400.000 | Cengage Learning Inc 9,50% 15/6/2024 [^] | 24.894.320 | 0,45 | Gesamt Anleihen | | 660.317.767 | 11,98 |
| USD 7.879.000 | CHS/Community Health Systems Inc 5,625% 15/3/2027 | 7.321.403 | 0,13 | EINLAGENZERTIFIKATE | | | |
| USD 10.626.000 | Coinbase Global Inc 3,625% 1/10/2031 | 7.168.512 | 0,13 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| USD 27.263.000 | Coty Inc 5,00% 15/4/2026 | 25.920.161 | 0,47 | USD 13.900.000 | Banco Santander SA FRN 1/8/2022 | 13.900.000 | 0,25 |
| USD 2.000.000 | Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co 5,375% 15/8/2026 | 638.290 | 0,01 | USD 41.000.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 8/6/2022 | 41.000.000 | 0,74 |
| USD 22.000.000 | Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co 6,625% 15/8/2027 | 4.166.250 | 0,08 | USD 22.450.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 3/11/2022 | 22.450.000 | 0,41 |
| USD 12.333.000 | Envista Holdings Corp 2,375% 1/6/2025 | 26.016.421 | 0,47 | USD 13.000.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 12/1/2023 | 13.000.000 | 0,24 |
| USD 1.000.000 | Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc 6,75% 15/7/2030 | 859.230 | 0,02 | USD 1.000.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 3/3/2023 | 1.000.000 | 0,02 |
| USD 5.500.000 | GrubHub Holdings Inc 5,50% 1/7/2027 [^] | 4.479.200 | 0,08 | USD 4.750.000 | Citibank NA FRN 2/2/2023 | 4.750.000 | 0,09 |
| USD 6.781.000 | LivePerson Inc 15/12/2026 (Zero Coupon) | 5.070.998 | 0,09 | USD 26.000.000 | Cooperatieve Rabobank UA FRN 18/7/2022 | 25.998.305 | 0,47 |
| USD 35.000.000 | Michaels Cos Inc 7,875% 1/5/2029 | 24.929.442 | 0,45 | USD 14.600.000 | Kookmin Bank 1,10% 9/2/2023 | 14.600.000 | 0,27 |
| USD 2.707.000 | Middleby Corp 1,00% 1/9/2025 | 3.459.197 | 0,06 | USD 17.300.000 | Landesbank Baden Wuerttemberg FRN 3/6/2022 | 17.300.000 | 0,31 |
| USD 7.194.000 | Omniceil Inc 0,25% 15/9/2025 | 9.010.357 | 0,16 | USD 20.000.000 | Natixis SA FRN 17/6/2022 | 20.000.000 | 0,36 |
| USD 9.600.000 | Palo Alto Networks Inc 0,75% 1/7/2023 | 18.276.835 | 0,33 | USD 35.000.000 | Nordea Bank Abp 1,13% 12/10/2022 | 35.000.000 | 0,64 |
| | | | | USD 21.650.000 | Norinchukin Bank FRN 3/6/2022 | 21.650.000 | 0,39 |
| | | | | USD 24.250.000 | Standard Chartered Bank FRN 22/11/2022 | 24.250.000 | 0,44 |
| | | | | USD 20.000.000 | Standard Chartered Bank FRN 13/3/2023 | 20.000.000 | 0,36 |
| | | | | USD 19.700.000 | Standard Chartered Bank FRN 28/7/2023 | 19.700.000 | 0,36 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Neuseeland | | | |
| USD 25.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp FRN 29/7/2022 | 25.000.000 | 0,45 | USD 13.975.000 | ASB Finance Ltd 1/8/2022 (Zero Coupon) | 13.970.264 | 0,25 |
| USD 15.900.000 | Westpac Banking Corp FRN 9/8/2022 | 15.900.000 | 0,29 | USD 17.300.000 | BNZ International Funding Ltd 15/6/2022 (Zero Coupon) | 17.296.704 | 0,32 |
| | | 335.498.305 | 6,09 | USD 18.250.000 | Westpac Securities NZ Ltd 1/7/2022 (Zero Coupon) | 18.244.601 | 0,33 |
| Gesamt Einlagenzertifikate | | 335.498.305 | 6,09 | | | 49.511.569 | 0,90 |
| KURZFRISTIGE TITEL | | | | Singapur | | | |
| Australien | | | | USD 42.750.000 | DBS Bank Ltd 2/6/2022 (Zero Coupon) | 42.749.644 | 0,78 |
| USD 35.000.000 | Commonwealth Bank of Australia 1,21% 3/4/2023 | 35.000.000 | 0,64 | USD 65.650.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Limited 5/7/2022 (Zero Coupon) | 65.589.237 | 1,19 |
| USD 18.800.000 | National Australia Bank Ltd 0,93% 10/8/2022 | 18.800.000 | 0,34 | | | 108.338.881 | 1,97 |
| USD 13.200.000 | Westpac Banking Corp 30/8/2022 (Zero Coupon) | 13.193.565 | 0,24 | Spanien | | | |
| USD 30.000.000 | Westpac Banking Corp 23/3/2023 (Zero Coupon) | 30.000.000 | 0,54 | USD 25.000.000 | Banco Santander SA 3/8/2022 (Zero Coupon) | 24.938.750 | 0,45 |
| | | 96.993.565 | 1,76 | | | 24.938.750 | 0,45 |
| Kanada | | | | Schweden | | | |
| USD 15.000.000 | Bank Of Nova Scotia 5/7/2022 (Zero Coupon) | 14.995.750 | 0,27 | USD 18.000.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB 24/8/2022 (Zero Coupon) | 17.965.980 | 0,33 |
| USD 12.800.000 | Bank Of Nova Scotia 6/9/2022 (Zero Coupon) | 12.758.613 | 0,23 | | | 17.965.980 | 0,33 |
| USD 1.700.000 | Export Development Corp 23/6/2022 (Zero Coupon) | 1.699.107 | 0,03 | Großbritannien | | | |
| USD 21.150.000 | National Bank of Canada 31/10/2022 (Zero Coupon) | 21.119.638 | 0,38 | USD 40.000.000 | Lloyds Bank Plc 15/6/2022 (Zero Coupon) | 39.986.155 | 0,73 |
| USD 12.000.000 | Nutrien Ltd 28/6/2022 (Zero Coupon) | 11.988.750 | 0,22 | USD 10.600.000 | Lloyds Bank Plc 17/6/2022 (Zero Coupon) | 10.595.996 | 0,19 |
| USD 17.500.000 | Nutrien Ltd 29/6/2022 (Zero Coupon) | 17.482.986 | 0,32 | USD 25.000.000 | Lloyds Bank Plc 1/7/2022 (Zero Coupon) | 24.978.958 | 0,45 |
| USD 28.100.000 | Nutrien Ltd 30/6/2022 (Zero Coupon) | 28.071.705 | 0,51 | USD 35.000.000 | Nationwide Building Society 21/6/2022 (Zero Coupon) | 34.982.306 | 0,63 |
| USD 8.000.000 | Nutrien Ltd 18/7/2022 (Zero Coupon) | 7.985.378 | 0,15 | USD 980.000 | Natwest Market Plc 27/7/2022 (Zero Coupon) | 979.040 | 0,02 |
| USD 5.750.000 | Toronto-Dominion Bank 3/8/2022 (Zero Coupon) | 5.747.987 | 0,10 | USD 12.550.000 | Santander UK Plc 11/7/2022 (Zero Coupon) | 12.545.119 | 0,23 |
| | | 121.849.914 | 2,21 | USD 29.250.000 | Standard Chartered Bank 14/11/2022 (Zero Coupon) | 28.964.065 | 0,53 |
| Frankreich | | | | | | 153.031.639 | 2,78 |
| USD 30.425.000 | Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA 1/8/2022 (Zero Coupon) | 30.352.310 | 0,55 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| USD 11.000.000 | Natixis SA 11/7/2022 (Zero Coupon) | 10.995.661 | 0,20 | USD 15.500.000 | ABN Amro Funding USA LLC 21/11/2022 (Zero Coupon) | 15.424.769 | 0,28 |
| USD 13.150.000 | Natixis SA 1/8/2022 (Zero Coupon) | 13.142.201 | 0,24 | USD 58.200.000 | Alinghi Funding Co LLC 15/8/2022 (Zero Coupon) | 58.019.338 | 1,05 |
| | | 54.490.172 | 0,99 | USD 19.500.000 | Amcor Finance Inc 3/6/2022 (Zero Coupon) | 19.498.917 | 0,35 |
| Deutschland | | | | USD 325.000 | Amcor Flexibles North America Inc 6/6/2022 (Zero Coupon) | 324.950 | 0,01 |
| USD 25.950.000 | DZ Bank AG Deutsche Zentral- Genossenschaftsbank 24/8/2022 (Zero Coupon) | 25.857.964 | 0,47 | USD 8.500.000 | Amcor Flexibles North America Inc 14/6/2022 (Zero Coupon) | 8.496.409 | 0,15 |
| USD 40.000.000 | Landesbank Baden Wuerttemberg 15/6/2022 (Zero Coupon) | 39.985.844 | 0,72 | USD 5.550.000 | AT&T Inc 28/6/2022 (Zero Coupon) | 5.544.797 | 0,10 |
| | | 65.843.808 | 1,19 | USD 27.500.000 | Barton Capital SA 6/6/2022 (Zero Coupon) | 27.496.906 | 0,50 |
| Japan | | | | USD 33.900.000 | Barton Capital SA 25/7/2022 (Zero Coupon) | 33.835.929 | 0,61 |
| USD 15.100.000 | Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp 6/7/2022 (Zero Coupon) | 15.083.851 | 0,27 | USD 64.650.000 | Bayerische Landesbank 21/6/2022 (Zero Coupon) | 64.616.598 | 1,17 |
| USD 2.900.000 | Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp 25/8/2022 (Zero Coupon) | 2.889.181 | 0,05 | USD 15.000.000 | Bayerische Landesbank 7/7/2022 (Zero Coupon) | 14.985.000 | 0,27 |
| USD 48.900.000 | Mizuho Bank Ltd 15/6/2022 (Zero Coupon) | 48.884.597 | 0,89 | USD 4.500.000 | Bedford Row Funding Corp 9/6/2022 (Zero Coupon) | 4.499.000 | 0,08 |
| | | 66.857.629 | 1,21 | USD 34.600.000 | Bell Canada International Inc 29/6/2022 (Zero Coupon) | 34.563.766 | 0,63 |
| | | | | USD 34.400.000 | Bennington Stark Capital Co 6/6/2022 (Zero Coupon) | 34.395.700 | 0,62 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|----------------|--|------------------------|--------------------|----------------|---|------------------------|--------------------|
| | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | |
| USD 5.000.000 | Brighthouse Financial Inc 1/6/2022 (Zero Coupon) | 5.000.000 | 0,09 | USD 24.400.000 | Legacy Capital LLC 20/7/2022 (Zero Coupon) | 24.359.482 | 0,44 |
| USD 54.950.000 | Brighthouse Financial Inc 20/7/2022 (Zero Coupon) | 54.858.752 | 1,00 | USD 13.300.000 | Lime Funding LLC 9/6/2022 (Zero Coupon) | 13.297.281 | 0,24 |
| USD 80.000.000 | Britannia Funding Company LLC 20/7/2022 (Zero Coupon) | 79.872.600 | 1,45 | USD 35.350.000 | LMA SA 28/7/2022 (Zero Coupon) | 35.281.156 | 0,64 |
| USD 9.200.000 | Collateralized Commercial Paper V Co LLC 5/7/2022 (Zero Coupon) | 9.196.698 | 0,17 | USD 18.300.000 | Macquarie Bank Ltd 15/8/2022 (Zero Coupon) | 18.267.975 | 0,33 |
| USD 50.000.000 | Collateralized Commercial Paper V Co LLC 16/8/2022 (Zero Coupon) | 49.965.167 | 0,91 | USD 34.000.000 | Macquarie Bank Ltd 18/8/2022 (Zero Coupon) | 33.890.973 | 0,61 |
| USD 25.400.000 | Dominion Resources Services Inc 24/6/2022 (Zero Coupon) | 25.378.255 | 0,46 | USD 7.000.000 | Macquarie Bank Ltd 2 8/10/2022 (Zero Coupon) | 6.943.794 | 0,13 |
| USD 40.000.000 | Enbridge US Inc 22/6/2022 (Zero Coupon) | 39.970.133 | 0,73 | USD 31.300.000 | Metlife Short Term Funding LLC 18/7/2022 (Zero Coupon) | 31.253.824 | 0,57 |
| USD 26.300.000 | Enbridge US Inc 30/6/2022 (Zero Coupon) | 26.270.975 | 0,48 | USD 4.289.000 | Mont Blanc Capital Corp 8/6/2022 (Zero Coupon) | 4.288.341 | 0,08 |
| USD 23.500.000 | Enbridge US Inc 5/7/2022 (Zero Coupon) | 23.469.029 | 0,43 | USD 19.650.000 | National Australia Bank Ltd FRN 24/2/2023 | 19.650.000 | 0,36 |
| USD 5.100.000 | Enel Finance America LLC 18/7/2022 (Zero Coupon) | 5.090.013 | 0,09 | USD 56.000.000 | Nieuw Amsterdam Receivables Corp 22/6/2022 (Zero Coupon) | 55.972.233 | 1,02 |
| USD 25.700.000 | Engie Sa 8/7/2022 (Zero Coupon) | 25.665.662 | 0,47 | USD 10.000.000 | Nieuw Amsterdam Receivables Corp 14/7/2022 (Zero Coupon) | 9.985.786 | 0,18 |
| USD 24.600.000 | Engie SA 8/6/2022 (Zero Coupon) | 24.594.475 | 0,45 | USD 28.250.000 | Regatta Funding Co LLC 25/7/2022 (Zero Coupon) | 28.191.946 | 0,51 |
| USD 32.900.000 | Evergy Kansas Central Inc 27/6/2022 (Zero Coupon) | 32.868.635 | 0,60 | USD 25.650.000 | Royal Bank of Canada 7/11/2022 (Zero Coupon) | 25.468.740 | 0,46 |
| USD 5.000.000 | Evergy Missouri West Inc 27/6/2022 (Zero Coupon) | 4.995.233 | 0,09 | USD 44.300.000 | Salisbury Receivables Company LLC 14/7/2022 (Zero Coupon) | 44.300.000 | 0,80 |
| USD 13.400.000 | Eversource Energy 7/6/2022 (Zero Coupon) | 13.397.543 | 0,24 | USD 10.000.000 | Sherwin-Williams Co 7/6/2022 (Zero Coupon) | 9.998.417 | 0,18 |
| USD 24.500.000 | Eversource Energy 21/6/2022 (Zero Coupon) | 24.484.892 | 0,44 | USD 26.900.000 | Sherwin-Williams Co 13/6/2022 (Zero Coupon) | 26.890.585 | 0,49 |
| USD 40.000.000 | Federation des Caisses Desjardins 6/6/2022 (Zero Coupon) | 39.996.000 | 0,73 | USD 20.250.000 | Shinhan Bank New York 15/7/2022 (Zero Coupon) | 20.222.033 | 0,37 |
| USD 10.800.000 | Federation des Caisses Desjardins 7/6/2022 (Zero Coupon) | 10.798.668 | 0,20 | USD 10.350.000 | Spire Inc 22/6/2022 (Zero Coupon) | 10.343.117 | 0,19 |
| USD 47.500.000 | Federation des Caisses Desjardins 17/6/2022 (Zero Coupon) | 47.483.305 | 0,86 | USD 20.000.000 | ST Engineering North America Inc 13/7/2022 (Zero Coupon) | 19.974.567 | 0,36 |
| USD 14.050.000 | Federation des Caisses Desjardins 31/8/2022 (Zero Coupon) | 13.995.662 | 0,25 | USD 36.145.000 | Starbird Funding Corp 11/7/2022 (Zero Coupon) | 36.100.823 | 0,65 |
| USD 17.860.000 | Fidelity National Information Services Inc 1/6/2022 (Zero Coupon) | 17.860.000 | 0,32 | USD 14.800.000 | Suncorp Metway Ltd 12/7/2022 (Zero Coupon) | 14.783.144 | 0,27 |
| USD 12.895.000 | Fidelity National Information Services Inc 2/6/2022 (Zero Coupon) | 12.894.602 | 0,23 | USD 62.200.000 | Suncorp Metway Ltd 26/7/2022 (Zero Coupon) | 62.084.066 | 1,13 |
| USD 5.000.000 | Fidelity National Information Services Inc 27/6/2022 (Zero Coupon) | 4.994.881 | 0,09 | USD 25.600.000 | Verizon Communication Inc 11/7/2022 (Zero Coupon) | 25.564.444 | 0,46 |
| USD 6.500.000 | Goldman Sachs International 10/8/2022 (Zero Coupon) | 6.489.889 | 0,12 | USD 52.499.000 | Versailles Commercial Paper LLC 12/7/2022 (Zero Coupon) | 52.435.024 | 0,95 |
| USD 20.000.000 | Hyundai Capital America 22/6/2022 (Zero Coupon) | 19.986.350 | 0,36 | USD 15.250.000 | Victory Receivables Corp 28/6/2022 (Zero Coupon) | 15.239.020 | 0,28 |
| USD 12.000.000 | ING US Funding LLC 8/6/2022 (Zero Coupon) | 11.999.347 | 0,22 | USD 54.125.000 | Victory Receivables Corp 1/8/2022 (Zero Coupon) | 53.995.228 | 0,98 |
| USD 14.500.000 | Korea Development Bank 25/8/2022 (Zero Coupon) | 14.443.853 | 0,26 | USD 16.915.000 | Victory Receivables Corp 10/8/2022 (Zero Coupon) | 16.868.625 | 0,31 |
| USD 28.000.000 | Legacy Capital LLC 21/6/2022 (Zero Coupon) | 27.983.667 | 0,51 | USD 40.000.000 | VW Credit Inc 3/6/2022 (Zero Coupon) | 39.997.778 | 0,73 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| USD 36.900.000 | VW Credit Inc 7/6/2022 (Zero Coupon) | 36.892.989 | 0,67 |
| USD 27.800.000 | VW Credit Inc 21/6/2022 (Zero Coupon) | 27.779.304 | 0,50 |
| | | 1.816.027.060 | 32,96 |
| Gesamt kurzfristige Titel | | 2.575.848.967 | 46,75 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 5.089.685.936 | 92,37 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| STAMMAKTIEN | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 476.486 | Escrow Altegrity Inc | 2.739.794 | 0,05 |
| 1.300.000 | Hertz Global Holdings | 24.700.000 | 0,45 |
| 112.616 | Project Dvorak 'F' | 2.095.784 | 0,04 |
| | | 29.535.578 | 0,54 |
| Gesamt Stammaktien | | 29.535.578 | 0,54 |
| ANLEIHEN | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| USD 6.968.580 | Bombardier Inc 31/5/2023 (Zero Coupon) | 6.724.680 | 0,12 |
| USD 4.500.000 | MoneyGram International Inc 5,375% 1/8/2026 | 4.521.970 | 0,08 |
| | | 11.246.650 | 0,20 |
| Gesamt Anleihen | | 11.246.650 | 0,20 |
| Gesamt sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | 40.782.228 | 0,74 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 5.130.468.164 | 93,11 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 379.591.293 | 6,89 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | 5.510.059.457 | 100,00 |
| * Wertpapier unter Vorbehalt einer Anpassung an die beizulegenden Zeitwerte gemäß Anmerkung 2 (a). | | | |
| ^ Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------------------|--|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (3.840) | Applied Materials Inc | Morgan Stanley | (27.245) |
| Australien | | | | 1.422.515 | Arconic Rolled Products Corp | Morgan Stanley | 569.006 |
| 3.044.042 | Crown Resorts Ltd | Goldman Sachs | 284.071 | (6.043) | ASML Holding NV Reg | Citibank | (138.385) |
| 4.413.527 | Crown Resorts Ltd | JP Morgan | (31.682) | (575) | ASML Holding NV Reg | Morgan Stanley | (13.168) |
| 7.185.349 | Crown Resorts Ltd | Morgan Stanley | (103.160) | (39.520) | Avery Dennison Corp | Morgan Stanley | (154.422) |
| 119.591 | Crown Resorts Ltd | UBS | 11.160 | (79.022) | Ball Corp | Morgan Stanley | (44.437) |
| | | | 160.389 | (5.478) | Becton Dickinson and Co | Citibank | 22.405 |
| Kanada | | | | (14.631) | Bentley Systems Inc 'B' | JP Morgan | 8.611 |
| 4.611.575 | Shaw Communications Inc 'B' | Morgan Stanley | 164.133 | (39.981) | Berry Global Group Inc | Morgan Stanley | (74.764) |
| | | | 164.133 | (49.746) | Bill.com Holdings Inc | JP Morgan | (579.998) |
| Italien | | | | 26.247 | Biohaven Pharmaceutical Holding Co Ltd | Barclays Bank | (3.675) |
| 1.449.100 | Atlantia SpA | Barclays Bank | 93.141 | 231.588 | Biohaven Pharmaceutical Holding Co Ltd | JP Morgan | 314.010 |
| 201.264 | Atlantia SpA | BNP Paribas | (86.242) | (2.751) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Citibank | (27.895) |
| | | | 6.899 | 163.011 | Black Knight Inc | JP Morgan | (366.775) |
| Schweden | | | | (11.074) | Block Inc | JP Morgan | (47.870) |
| 2.410.370 | Swedish Match AB | BNP Paribas | (45.481) | (36.435) | Boeing Co | Citibank | (219.703) |
| | | | (45.481) | (14.146) | Boeing Co | Morgan Stanley | (87.828) |
| Schweiz | | | | (224.415) | Box Inc 'A' | JP Morgan | 530.541 |
| 56.393 | Vifor Pharma AG | Bank of America Merrill Lynch | (37.272) | (29.704) | Bruker Corp | Citibank | (55.546) |
| 145.279 | Vifor Pharma AG | Barclays Bank | (60.687) | (68.599) | Canadian Solar Inc | JP Morgan | (366.215) |
| 65.691 | Vifor Pharma AG | BNP Paribas | (447.218) | (16.654) | Carrier Global Corp | Citibank | (11.824) |
| 592.748 | Vifor Pharma AG | JP Morgan | (2.443.327) | 129.760 | Carrier Global Corp | Morgan Stanley | 92.130 |
| 143.726 | Vifor Pharma AG | Morgan Stanley | (60.038) | (45.064) | Caterpillar Inc | Citibank | (575.467) |
| | | | (3.048.542) | (13.852) | Caterpillar Inc | Morgan Stanley | (177.159) |
| Großbritannien | | | | 433.924 | CDK Global Inc | JP Morgan | 177.909 |
| 11.095.726 | Avast Plc | BNP Paribas | 976.669 | (19.340) | Celanese Corp | Morgan Stanley | (121.455) |
| 450.425 | Avast Plc | Citibank | (31.652) | 521.947 | Cerner Corp | Bank of America Merrill Lynch | 276.632 |
| 7.437.053 | Avast Plc | Morgan Stanley | (522.661) | 1.913.051 | Cerner Corp | Goldman Sachs | 1.013.917 |
| 2.144.771 | HomeServe Plc | BNP Paribas | 105.537 | 1.493.500 | Cerner Corp | JP Morgan | 1.448.695 |
| 7.650.322 | Meggitt Plc | Barclays Bank | (115.572) | 1.554.805 | Change Healthcare Inc | Goldman Sachs | 1.306.036 |
| 5.053.147 | Meggitt Plc | Goldman Sachs | 152.674 | 2.932 | Cigna Corp | Citibank | 20.260 |
| 12.260.939 | Meggitt Plc | Morgan Stanley | (185.224) | 85.344 | Cigna Corp | Morgan Stanley | 589.727 |
| 1.225.705 | Ultra Electronics Holdings Plc | Goldman Sachs | 925.824 | 1.211.501 | Citrix Systems Inc | Barclays Bank | 1.150.926 |
| 450.667 | Ultra Electronics Holdings Plc | JP Morgan | 385.795 | 485.238 | Citrix Systems Inc | JP Morgan | 344.519 |
| 126.954 | Ultra Electronics Holdings Plc | Morgan Stanley | (51.143) | 645.990 | CMC Materials Inc | JP Morgan | 839.787 |
| | | | 1.640.247 | 444.216 | Coherent Inc | Goldman Sachs | 1.026.139 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | 107.720 | Coherent Inc | Morgan Stanley | 276.840 |
| (42.416) | 3M Co | Citibank | (97.557) | 617.202 | Cornerstone Building Brands Inc | JP Morgan | 117.268 |
| (17.461) | 3M Co | Morgan Stanley | (40.924) | 702.625 | Corteva Inc | Morgan Stanley | 1.714.405 |
| 660.139 | Activision Blizzard Inc | Barclays Bank | 389.482 | (37.593) | Cummins Inc | Citibank | (317.285) |
| 583.861 | Activision Blizzard Inc | JP Morgan | 361.994 | (12.929) | Cummins Inc | Morgan Stanley | (110.356) |
| (96.565) | Advanced Micro Devices Inc | Citibank | (613.188) | (33.364) | Deere & Co | Citibank | (794.063) |
| (6.117) | Advanced Micro Devices Inc | Morgan Stanley | (38.843) | (7.744) | Deere & Co | Morgan Stanley | (184.785) |
| (13.774) | Agilent Technologies Inc | Citibank | (43.526) | 184.819 | Dow Inc | Morgan Stanley | 188.515 |
| (34.982) | Air Products & Chemicals Inc | Morgan Stanley | (323.039) | 666.310 | DuPont de Nemours Inc | Morgan Stanley | 1.632.460 |
| (74.003) | Albemarle Corp | Morgan Stanley | (1.245.560) | (88.179) | Eastman Chemical Co | Morgan Stanley | (558.282) |
| 35.076 | Alleghany Corp | JP Morgan | 67.697 | (34.871) | Elcolab Inc | Morgan Stanley | (50.390) |
| 679.733 | American Campus Communities Inc (REIT) | Goldman Sachs | 135.947 | (74.020) | Elanco Animal Health Inc | Citibank | (21.466) |
| 1.680.304 | American Campus Communities Inc (REIT) | JP Morgan | 714.899 | (1.103) | Embecka Corp | Citibank | 1.202 |
| (28.767) | Analog Devices Inc | Citibank | (106.438) | (141.282) | Emerson Electric Co | Citibank | (367.333) |
| (5.800) | Analog Devices Inc | Morgan Stanley | (21.460) | (41.973) | Emerson Electric Co | Morgan Stanley | (110.860) |
| 1.071.827 | Anaplan Inc | Goldman Sachs | 1.136.137 | (52.546) | Enbridge Inc | Citibank | (80.395) |
| 1.184.314 | Anaplan Inc | JP Morgan | 497.412 | (291.083) | Entegris Inc | JP Morgan | (1.653.351) |
| (51.726) | Antero Midstream Corp | Citibank | (31.036) | (439.625) | Envista Holdings Corp | Morgan Stanley | (250.586) |
| 46.071 | Anthem Inc | Citibank | 1.032.912 | (46.639) | Equitrans Midstream Corp | Citibank | (16.790) |
| 58.649 | Anthem Inc | Morgan Stanley | 1.314.911 | (36.708) | FedEx Corp | Citibank | (555.759) |
| (32.059) | Aon Plc 'A' | Barclays Bank | (295.263) | (12.215) | FedEx Corp | Morgan Stanley | (185.774) |
| (38.856) | Applied Materials Inc | Citibank | (275.683) | 6.634.385 | First Horizon Corp | Barclays Bank | 3.051.817 |
| | | | | 2.735.844 | First Horizon Corp | JP Morgan | 2.626.410 |
| | | | | (48.291) | FMC Corp | Morgan Stanley | (6.380) |
| | | | | (323.082) | Freeport-McMoRan Inc | Morgan Stanley | (465.688) |
| | | | | (577) | Garrett Motion Inc | Citibank | (115) |
| | | | | (89.115) | General Electric Co | Citibank | (299.426) |
| | | | | (29.851) | General Electric Co | Morgan Stanley | (102.179) |
| | | | | (35.319) | Genesis Energy LP | Citibank | (31.081) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|----------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 172.190 | GFL Environmental Inc | Morgan Stanley | 175.634 | (142.173) | Republic Services Inc | Morgan Stanley | (532.200) |
| (20.794) | Hologic Inc | Citibank | 68.620 | (1.000) | Resideo Technologies Inc | Citibank | (1.020) |
| (41.452) | Honeywell International Inc | Citibank | (126.843) | (2.798) | RingCentral Inc 'A' | JP Morgan | 11.892 |
| (14.116) | Honeywell International Inc | Morgan Stanley | (44.126) | (29.194) | Rockwell Automation Inc | Citibank | (169.617) |
| 242.645 | Howmet Aerospace Inc | Morgan Stanley | 325.124 | (10.154) | Rockwell Automation Inc | Morgan Stanley | (60.711) |
| 85.679 | Humana Inc | Morgan Stanley | 1.387.143 | 188.550 | Rogers Corp | Barclays Bank | 175.352 |
| (96.963) | Huntsman Corp | Morgan Stanley | (73.692) | 165.570 | Rogers Corp | Citibank | 153.980 |
| (404.267) | II-VI Inc | Goldman Sachs | 24.256 | 142.798 | Rogers Corp | JP Morgan | (1.363.721) |
| (98.002) | II-VI Inc | Morgan Stanley | (35.281) | 1.279.964 | Sailpoint Technologies Holdings Inc | JP Morgan | 447.987 |
| (37.685) | Illinois Tool Works Inc | Citibank | (52.382) | (124.181) | Sealed Air Corp | Morgan Stanley | (192.632) |
| (12.365) | Illinois Tool Works Inc | Morgan Stanley | (17.956) | (35.557) | Shift4 Payments Inc 'A' | Morgan Stanley | (39.270) |
| (4.106) | Illumina Inc | Citibank | 6.734 | (11.307) | Skyworks Solutions Inc | Citibank | (58.909) |
| (23.467) | Intercontinental Exchange Inc | JP Morgan | (120.386) | (2.114) | Skyworks Solutions Inc | Morgan Stanley | (11.014) |
| 161.501 | International Flavors & Fragrances Inc | Morgan Stanley | 245.482 | (64.999) | SoFi Technologies Inc | JP Morgan | (77.291) |
| (129.808) | International Paper Co | Morgan Stanley | (69.067) | (10.446) | SolarEdge Technologies Inc | Morgan Stanley | (229.386) |
| (98.115) | Kinder Morgan Inc | Citibank | (79.473) | (1.263) | Spotify Technology SA | JP Morgan | (18.214) |
| (15.474) | KLA Corp | Citibank | (304.528) | (39.148) | Stanley Black & Decker Inc | Citibank | 10.961 |
| (1.736) | KLA Corp | Morgan Stanley | (34.164) | (14.626) | Stanley Black & Decker Inc | Morgan Stanley | 2.918 |
| 58.345 | Kohl's Corp | JP Morgan | (579.949) | (8.168) | Sylvamo Corp | Morgan Stanley | (13.315) |
| (12.426) | Lam Research Corp | Citibank | (393.531) | (41.113) | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | Citibank | (145.951) |
| (865) | Lam Research Corp | Morgan Stanley | (27.395) | (1.510) | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | Morgan Stanley | (5.361) |
| (7.676) | Livent Corp | Morgan Stanley | (23.882) | (19.469) | Teradyne Inc | Citibank | (94.522) |
| (18.937) | LivePerson Inc | JP Morgan | (3.869) | (804) | Teradyne Inc | Morgan Stanley | (3.903) |
| (107.506) | LyondellBasell Industries NV 'A' | Morgan Stanley | (1.022.633) | (12.568) | Texas Instruments Inc | Citibank | (55.928) |
| (19.053) | Magellan Midstream Partners LP | Citibank | (54.301) | (2.717) | Texas Instruments Inc | Morgan Stanley | (12.091) |
| 1.166.049 | Mandiant Inc | Goldman Sachs | 163.247 | (3.254) | Thermo Fisher Scientific Inc | Citibank | (52.812) |
| 2.052.232 | Mandiant Inc | JP Morgan | 628.362 | 24.547 | T-Mobile US Inc | Morgan Stanley | 79.532 |
| (58.529) | Marsh & McLennan Cos Inc | Barclays Bank | (388.633) | 1.313.204 | Tower Semiconductor Ltd | JP Morgan | 1.982.938 |
| (21.096) | Martin Marietta Materials Inc | Morgan Stanley | (99.050) | 365.332 | Twitter Inc | JP Morgan | (2.951.883) |
| (4.333) | Mettler-Toledo International Inc | Citibank | (257.337) | (38.178) | Union Pacific Corp | Citibank | (156.530) |
| (28.676) | Microchip Technology Inc | Citibank | (127.321) | (10.969) | Union Pacific Corp | Morgan Stanley | (45.429) |
| (6.621) | Microchip Technology Inc | Morgan Stanley | (29.397) | (49.778) | United Parcel Service Inc 'B' | Citibank | (258.348) |
| (24.942) | Micron Technology Inc | Citibank | (74.826) | (13.425) | United Parcel Service Inc 'B' | Morgan Stanley | (70.417) |
| (5.528) | Micron Technology Inc | Morgan Stanley | (16.584) | (31.067) | UnitedHealth Group Inc | Morgan Stanley | (316.883) |
| (16.709) | Middleby Corp | Morgan Stanley | (157.220) | (11.107) | Upwork Inc | JP Morgan | (4.123) |
| (4.823) | MKS Instruments Inc | Citibank | (11.286) | 1.469.927 | Vonage Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.220.039 |
| (1.153) | MKS Instruments Inc | Morgan Stanley | (2.698) | 640.191 | Vonage Holdings Corp | Goldman Sachs | 531.359 |
| (2.209) | Monolithic Power Systems Inc | Citibank | (61.388) | 3.987.381 | Vonage Holdings Corp | JP Morgan | 1.874.069 |
| (602) | Monolithic Power Systems Inc | Morgan Stanley | (16.730) | (40.230) | Vulcan Materials Co | Morgan Stanley | (22.837) |
| (253.466) | Mosaic Co | Morgan Stanley | (322.494) | (133.765) | Waste Management Inc | Morgan Stanley | (338.502) |
| (25.729) | MPLX LP | Citibank | (45.283) | (359) | Waters Corp | Citibank | (2.560) |
| (101.218) | Newmont Corp | Morgan Stanley | (160.771) | (1.332) | Wayfair Inc 'A' | JP Morgan | 7.251 |
| 309.095 | Nielsen Holdings Plc | Citibank | (18.546) | 337.701 | Welbilt Inc | JP Morgan | 70.917 |
| 344.244 | Nielsen Holdings Plc | JP Morgan | (37.867) | (21.119) | Western Midstream Partners LP | Citibank | (26.188) |
| (335.090) | NortonLifeLock Inc | BNP Paribas | (251.317) | (254) | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Citibank | (1.816) |
| (13.539) | NortonLifeLock Inc | Citibank | (406) | (122.293) | Westrock Co | Morgan Stanley | (342.420) |
| (224.599) | NortonLifeLock Inc | Morgan Stanley | (6.738) | 596.994 | Williams Cos Inc | Citibank | 955.190 |
| (105.137) | Nucor Corp | Morgan Stanley | (896.281) | 111.982 | Willis Towers Watson Plc | Barclays Bank | 921.612 |
| 256.559 | NXP Semiconductors NV | JP Morgan | 4.651.415 | 55.822 | Willis Towers Watson Plc | JP Morgan | 250.641 |
| (59.652) | Omniceil Inc | Morgan Stanley | (5.801) | | | | 13.292.287 |
| (20.317) | ON Semiconductor Corp | Citibank | (83.503) | | Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 4.097.171.660) | | 12.169.932 |
| (5.833) | ON Semiconductor Corp | Morgan Stanley | (23.974) | | | | |
| (7.066) | Otis Worldwide Corp | Citibank | (2.120) | | | | |
| 92.306 | Otis Worldwide Corp | Morgan Stanley | 27.692 | | | | |
| (34.160) | Palo Alto Networks Inc | JP Morgan | (1.504.142) | | | | |
| (177) | Peloton Interactive Inc 'A' | JP Morgan | (12) | | | | |
| (11.107) | PerkinElmer Inc | Citibank | (52.092) | | | | |
| (6.704) | Phillips 66 | Citibank | (55.040) | | | | |
| (70.188) | PPG Industries Inc | Morgan Stanley | (207.160) | | | | |
| (10.225) | Qorvo Inc | Citibank | (46.728) | | | | |
| (1.011) | Qorvo Inc | Morgan Stanley | (4.620) | | | | |
| (6.354) | Redfin Corp | JP Morgan | 4.283 | | | | |
| (21.418) | Repay Holdings Corp | JP Morgan | (8.582) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn USD | Marktwert USD |
|--|-----------------|---|----------------|---------------|------------------------------------|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | USD 178.075.000 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.38 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | 4.277.272 | (2.413.421) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 2.413.421) | | | | | 4.277.272 | (2.413.421) |
| CCCDs: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps | | | | | | |

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn USD |
|-------------------------------------|-----------------|---|---------------|---|------------------------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (2.568) | USD | E-Mini S&P 500 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 528.366.000 | 13.827.602 |
| (130) | USD | NASDAQ 100 E-Mini Stock Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 32.635.200 | 1.921.196 |
| Gesamt | | | | | 15.748.798 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------|---------|---------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf BRL lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| BRL | 578.153.996 | USD | 114.232.592 | State Street Bank & Trust Company | 2/6/2022 | 8.697.814 |
| BRL | 506.335.012 | USD | 105.321.183 | State Street Bank & Trust Company | 5/7/2022 | 1.371.123 |
| USD | 120.370.490 | BRL | 578.153.997 | State Street Bank & Trust Company | 2/6/2022 | (2.559.917) |
| USD | 600.000 | BRL | 2.883.601 | State Street Bank & Trust Company | 5/7/2022 | (7.617) |
| | | | | | | 7.501.403 |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 81.608.522 | USD | 83.142.213 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 1.966.569 |
| USD | 7.424.764 | CHF | 7.350.385 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (240.883) |
| | | | | | | 1.725.686 |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 2.979.740.443 | USD | 3.159.281.594 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 34.693.453 |
| USD | 331.235.570 | EUR | 314.760.691 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (6.155.486) |
| | | | | | | 28.537.967 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------|---------|---------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 970.488.132 | USD | 1.201.096.514 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 20.652.630 |
| USD | 112.705.068 | GBP | 91.586.735 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (2.593.627) |
| | | | | | | 18.059.003 |
| Auf HKD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| HKD | 43.130 | USD | 5.499 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (1) |
| USD | 239 | HKD | 1.874 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | — |
| | | | | | | (1) |
| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| JPY | 8.756.676.699 | USD | 67.336.666 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 698.970 |
| USD | 2.469.687 | JPY | 319.497.126 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (12.669) |
| | | | | | | 686.301 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|-----------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf SGD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| SGD | 3.888.716 | USD | 2.810.828 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 25.494 |
| USD | 158.334 | SGD | 220.132 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (2.225) |
| | | | | | | 23.269 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 5.387.869.727) | | | | | | 56.533.628 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 43,31 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 11,01 |
| Zyklische Konsumgüter | 7,67 |
| Technologie | 7,48 |
| Industrie | 6,08 |
| Grundstoffe | 5,06 |
| Kommunikation | 4,47 |
| Versorger | 3,03 |
| Staatsanleihen | 2,78 |
| Energie | 1,81 |
| Diversifiziert | 0,41 |
| Asset Backed Securities (ABS) | 0,00 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 93,11 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 6,89 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Real Asset Securities Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | | | |
| STAMMAKTIE | | | | | | | |
| Australien | | | | Südkorea | | | |
| 2.210.297 | Dexus (REIT) | 16.628.211 | 2,01 | 1.033.587 | ESR Kendall Square Co Ltd (REIT) | 5.655.823 | 0,68 |
| 10.956.655 | GDI Property Group Partnership (REIT) | 8.297.821 | 1,01 | | | 5.655.823 | 0,68 |
| 1.512.478 | Goodman Group (REIT) | 22.311.794 | 2,70 | Spanien | | | |
| 14.630.675 | National Storage (REIT) | 25.311.333 | 3,07 | 67.869 | Aena SME SA | 10.378.590 | 1,26 |
| 3.064.342 | NEXTDC Ltd [^] | 24.219.109 | 2,93 | 668.459 | Cellnex Telecom SA [^] | 30.526.774 | 3,70 |
| 2.420.394 | Transurban Group (Unit) | 24.967.579 | 3,03 | | | 40.905.364 | 4,96 |
| | | 121.735.847 | 14,75 | Großbritannien | | | |
| Belgien | | | | 19.254.349 | Assura Plc (REIT) [^] | 17.270.507 | 2,09 |
| 87.926 | VGP NV | 17.123.873 | 2,07 | 217.535 | Derwent London Plc (REIT) | 8.166.353 | 0,99 |
| 224.575 | Warehouses De Pauw CVA (REIT) [^] | 8.295.058 | 1,01 | 6.497.332 | Life Science Plc (REIT) | 8.179.412 | 0,99 |
| | | 25.418.931 | 3,08 | 1.434.301 | Secure Income Plc (REIT) | 8.486.518 | 1,03 |
| Kaimaninseln | | | | 247.487 | Severn Trent Plc [^] | 9.116.289 | 1,11 |
| 336.320 | Chindata Group Holdings Ltd ADR [^] | 2.559.395 | 0,31 | 5.231.120 | Supermarket Income Plc (REIT) [^] | 8.528.170 | 1,03 |
| 2.707.400 | ESR Cayman Ltd | 8.021.645 | 0,97 | 8.427.421 | Target Healthcare Plc (REIT) | 12.243.114 | 1,49 |
| 1.111.388 | GDS Holdings Ltd 'A' | 4.220.559 | 0,51 | 4.787.125 | Tritax Big Box Plc (REIT) | 12.233.823 | 1,48 |
| 752.713 | IHS Holding Ltd | 8.769.107 | 1,07 | | | 84.224.186 | 10,21 |
| | | 23.570.706 | 2,86 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| Frankreich | | | | 150.092 | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | 25.021.837 | 3,03 |
| 160.950 | Covivio (REIT) | 11.620.951 | 1,41 | 120.539 | Boston Properties Inc (REIT) [^] | 13.467.822 | 1,63 |
| | | 11.620.951 | 1,41 | 591.427 | CenterPoint Energy Inc [^] | 18.893.136 | 2,29 |
| Deutschland | | | | 90.207 | Crown Castle International Corp (REIT) | 17.145.645 | 2,08 |
| 823.668 | Vonovia SE | 30.882.399 | 3,74 | 40.089 | Equinix Inc (REIT) | 27.341.500 | 3,31 |
| | | 30.882.399 | 3,74 | 183.242 | Eversource Energy [^] | 16.900.410 | 2,05 |
| Guernsey | | | | 716.323 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | 13.302.118 | 1,61 |
| 3.706.883 | Industrials Ltd (REIT) | 8.469.873 | 1,03 | 337.361 | NextEra Energy Inc [^] | 25.752.452 | 3,12 |
| 5.852.101 | Sirius Real Estate Ltd | 8.545.966 | 1,03 | 956.241 | Outfront Media Inc (REIT) | 19.689.002 | 2,39 |
| | | 17.015.839 | 2,06 | 265.394 | Physicians Realty Trust (REIT) | 4.909.789 | 0,59 |
| Italien | | | | 247.532 | Public Service Enterprise Group Inc | 16.899.010 | 2,05 |
| 882.958 | Infrastrutture Wireless Italiane SpA | 9.747.177 | 1,18 | 321.498 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | 20.688.396 | 2,51 |
| | | 9.747.177 | 1,18 | 248.762 | SL Green Realty Corp (REIT) [^] | 15.438.170 | 1,87 |
| Japan | | | | 295.592 | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | 12.367.569 | 1,50 |
| 2.761.100 | Hulic Co Ltd [^] | 22.600.857 | 2,74 | 100.556 | Sun Communities Inc (REIT) | 16.504.256 | 2,00 |
| 153.300 | Japan Airport Terminal Co Ltd | 6.309.867 | 0,76 | 510.584 | UDR Inc (REIT) | 24.467.185 | 2,96 |
| 8.498 | Orix JREIT Inc (REIT) [^] | 12.288.492 | 1,49 | 137.770 | Welltower Inc (REIT) | 12.297.350 | 1,49 |
| 447.000 | West Japan Railway Co [^] | 16.506.698 | 2,00 | | | 301.085.647 | 36,48 |
| | | 57.705.914 | 6,99 | Gesamt Stammaktien | | | |
| Mexiko | | | | | | 768.992.521 | 93,18 |
| 4.446.458 | Corp Inmobiliaria Vesta SAB de CV | 8.796.537 | 1,07 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| | | 8.796.537 | 1,07 | | | 768.992.521 | 93,18 |
| Philippinen | | | | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | |
| 6.632.800 | AREIT Inc (REIT) | 5.127.720 | 0,62 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | |
| | | 5.127.720 | 0,62 | 56.286.210 6,82 | | | |
| Portugal | | | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | | |
| 3.185.753 | EDP - Energias de Portugal SA | 16.043.280 | 1,94 | 825.278.731 100,00 | | | |
| | | 16.043.280 | 1,94 | | | | |
| Singapur | | | | | | | |
| 4.305.980 | Cromwell European (REIT) | 9.456.200 | 1,15 | | | | |
| | | 9.456.200 | 1,15 | | | | |

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

BlackRock Global Real Asset Securities Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn USD |
|--|-------------------------------|---------------|------------------------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | |
| Portugal | | | |
| 1.912.784 | EDP - Energias de Portugal SA | Goldman Sachs | 446.588 |
| | | | 446.588 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 9.632.677) | | | 446.588 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Real Asset Securities Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Marktwert USD |
|-------------------------------------|-----------|--------------------------------------|-------------------------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (11.900) | Call | Covivio | Bank of America Merrill Lynch | EUR 74,66 | 01/06/2022 | 9.682 | — |
| (23.100) | Call | Derwent London Plc | Bank of America Merrill Lynch | GBP 32,52 | 01/06/2022 | 10.631 | — |
| (88.200) | Call | Spirit Realty Capital Inc | Bank of America Merrill Lynch | USD 40,35 | 12/07/2022 | (38.247) | (183.044) |
| (35.000) | Call | Industrials Reit Ltd | Barclays Bank | GBP 2,00 | 22/06/2022 | 1.418 | (90) |
| (35.000) | Call | Industrials Reit Ltd | Barclays Bank | GBP 2,00 | 16/06/2022 | 1.395 | (44) |
| (75.000) | Call | Secure Income REIT Plc | Barclays Bank | GBP 4,25 | 16/06/2022 | (40.571) | (43.961) |
| (66.000) | Call | Severn Trent Plc | Barclays Bank | GBP 32,00 | 12/07/2022 | 37.897 | (4.446) |
| (323.000) | Call | Tritax Big Box REIT Plc | Barclays Bank | GBP 2,17 | 08/06/2022 | 7.943 | (2.300) |
| (323.000) | Call | Tritax Big Box REIT Plc | Barclays Bank | GBP 2,17 | 06/07/2022 | 2.713 | (16.079) |
| (323.000) | Call | Tritax Big Box REIT Plc | Barclays Bank | GBP 2,17 | 14/06/2022 | 6.427 | (5.550) |
| (323.000) | Call | Tritax Big Box REIT Plc | Barclays Bank | GBP 2,17 | 13/07/2022 | 1.500 | (19.026) |
| (323.000) | Call | Tritax Big Box REIT Plc | Barclays Bank | GBP 2,17 | 22/06/2022 | 4.871 | (9.646) |
| (323.000) | Call | Tritax Big Box REIT Plc | Barclays Bank | GBP 2,17 | 29/06/2022 | 3.695 | (12.959) |
| (100.000) | Call | Corp Inmobiliaria Vesta SAB de CV | Citibank | MXN 38,91 | 06/07/2022 | (2.229) | (6.004) |
| (535.100) | Call | EDP - Energias de Portugal SA | Credit Suisse | EUR 4,79 | 01/06/2022 | 36.293 | (2.527) |
| (178.400) | Call | Infrastrutture Wireless Italiane SpA | Credit Suisse | EUR 10,70 | 14/06/2022 | 22.520 | (8.700) |
| (174.500) | Call | Infrastrutture Wireless Italiane SpA | Credit Suisse | EUR 10,64 | 01/06/2022 | 38.556 | (10) |
| (90.000) | Call | Secure Income REIT Plc | Credit Suisse | GBP 4,69 | 14/06/2022 | (8.037) | (13.376) |
| (150.000) | Call | Target Healthcare REIT Plc | Credit Suisse | GBP 1,19 | 01/06/2022 | 1.356 | (7) |
| (100.000) | Call | Target Healthcare REIT Plc | Credit Suisse | GBP 1,12 | 06/07/2022 | (5.332) | (7.317) |
| (22.900) | Call | Warehouses De Pauw SCA | Credit Suisse | EUR 41,47 | 01/06/2022 | 10.958 | — |
| (65.700) | Call | Warehouses De Pauw SCA | Credit Suisse | EUR 35,72 | 06/07/2022 | (25.761) | (91.270) |
| (291) | Call | Alexandria Real Estate Equities Inc | Exchange Traded | USD 200,00 | 17/06/2022 | 131.252 | (9.458) |
| (85) | Call | Alexandria Real Estate Equities Inc | Exchange Traded | USD 190,00 | 17/06/2022 | 18.265 | (3.400) |
| (470) | Call | Alexandria Real Estate Equities Inc | Exchange Traded | USD 170,00 | 15/07/2022 | 81.075 | (170.375) |
| (24) | Call | Boston Properties Inc | Exchange Traded | USD 130,00 | 17/06/2022 | 3.288 | (192) |
| (310) | Call | Boston Properties Inc | Exchange Traded | USD 110,00 | 15/07/2022 | (67.981) | (155.000) |
| (128) | Call | CenterPoint Energy Inc | Exchange Traded | USD 32,00 | 17/06/2022 | (2.816) | (7.680) |
| (756) | Call | Chindata Group Holdings Ltd ADR | Exchange Traded | USD 7,50 | 17/06/2022 | (35.910) | (54.810) |
| (757) | Call | Chindata Group Holdings Ltd ADR | Exchange Traded | USD 7,50 | 15/07/2022 | (56.397) | (96.517) |
| (405) | Call | Crown Castle International Corp | Exchange Traded | USD 180,00 | 17/06/2022 | (289.980) | (465.750) |
| (163) | Call | Equinix Inc | Exchange Traded | USD 760,00 | 17/06/2022 | 316.436 | (39.528) |
| (13) | Call | Equinix Inc | Exchange Traded | USD 680,00 | 17/06/2022 | (12.025) | (26.975) |
| (389) | Call | Eversource Energy | Exchange Traded | USD 95,00 | 17/06/2022 | 43.376 | (21.395) |
| (218) | Call | Eversource Energy | Exchange Traded | USD 90,00 | 17/06/2022 | (39.458) | (77.390) |
| (217) | Call | Eversource Energy | Exchange Traded | USD 95,00 | 15/07/2022 | 2.170 | (22.785) |
| (464) | Call | NextEra Energy Inc | Exchange Traded | USD 85,00 | 17/06/2022 | 112.752 | (4.640) |
| (263) | Call | NextEra Energy Inc | Exchange Traded | USD 77,50 | 17/06/2022 | (22.302) | (36.820) |
| (327) | Call | NextEra Energy Inc | Exchange Traded | USD 75,00 | 15/07/2022 | (72.265) | (120.990) |
| (1.667) | Call | Outfront Media Inc | Exchange Traded | USD 30,00 | 17/06/2022 | 90.495 | (8.335) |
| (804) | Call | Outfront Media Inc | Exchange Traded | USD 25,00 | 17/06/2022 | 17.513 | (10.050) |
| (413) | Call | Public Service Enterprise Group Inc | Exchange Traded | USD 70,00 | 17/06/2022 | 30.640 | (14.455) |
| (504) | Call | Public Service Enterprise Group Inc | Exchange Traded | USD 70,00 | 15/07/2022 | 6.048 | (47.880) |
| (362) | Call | Rexford Industrial Realty Inc | Exchange Traded | USD 80,00 | 17/06/2022 | 52.807 | (9.050) |
| (983) | Call | Rexford Industrial Realty Inc | Exchange Traded | USD 65,00 | 15/07/2022 | (54.483) | (260.495) |
| (453) | Call | SL Green Realty Corp | Exchange Traded | USD 80,00 | 17/06/2022 | 69.083 | (12.458) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Real Asset Securities Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Marktwert USD |
|-------------------------------------|--------------|--------------------------------------|-----------------|----------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (78) | Call | SL Green Realty Corp | Exchange Traded | USD 77,50 | 17/06/2022 | 4.010 | (3.120) |
| (588) | Call | SL Green Realty Corp | Exchange Traded | USD 62,50 | 15/07/2022 | (33.848) | (171.990) |
| (62) | Call | Spirit Realty Capital Inc | Exchange Traded | USD 45,00 | 17/06/2022 | 3.235 | (3.100) |
| (363) | Call | Sun Communities Inc | Exchange Traded | USD 190,00 | 17/06/2022 | 71.693 | (88.027) |
| (33) | Call | Sun Communities Inc | Exchange Traded | USD 175,00 | 17/06/2022 | 4.515 | (7.755) |
| (45) | Call | Sun Communities Inc | Exchange Traded | USD 165,00 | 17/06/2022 | 6.164 | (14.850) |
| (1.398) | Call | UDR Inc | Exchange Traded | USD 55,00 | 15/07/2022 | 59.417 | (20.970) |
| (605) | Call | Welltower Inc | Exchange Traded | USD 92,50 | 17/06/2022 | 33.422 | (46.887) |
| (900.000) | Call | Assura Plc | Goldman Sachs | GBP 0,71 | 07/06/2022 | (82) | (12.795) |
| (1.000.000) | Call | Assura Plc | Goldman Sachs | GBP 0,66 | 16/06/2022 | (49.030) | (57.894) |
| (1.000.000) | Put | Assura Plc | Goldman Sachs | GBP 0,66 | 22/06/2022 | 5.831 | (5.530) |
| (115.400) | Call | Cellnex Telecom SA | Goldman Sachs | EUR 44,55 | 16/06/2022 | 127.371 | (34.749) |
| (35.700) | Call | Covivio | Goldman Sachs | EUR 69,74 | 16/06/2022 | 25.292 | (20.578) |
| (898.400) | Call | EDP - Energias de Portugal SA | Goldman Sachs | EUR 4,56 | 08/06/2022 | (70.782) | (168.687) |
| (414.000) | Call | Hulic Co Ltd | Goldman Sachs | JPY 1.109,88 | 16/06/2022 | 54.073 | (22.211) |
| (414.000) | Call | Hulic Co Ltd | Goldman Sachs | JPY 1.099,21 | 09/06/2022 | 58.681 | (14.212) |
| (2.500) | Call | Orix JREIT Inc | Goldman Sachs | JPY 186.430,00 | 09/06/2022 | 16.293 | (38.223) |
| (300.000) | Call | Sirius Real Estate Ltd | Goldman Sachs | GBP 1,24 | 09/06/2022 | 13.886 | (1.442) |
| (350.000) | Call | Sirius Real Estate Ltd | Goldman Sachs | GBP 1,22 | 15/06/2022 | 4.285 | (6.355) |
| (500.000) | Call | Sirius Real Estate Ltd | Goldman Sachs | GBP 1,15 | 29/06/2022 | (13.857) | (35.645) |
| (400.000) | Call | Supermarket Income REIT Plc | Goldman Sachs | GBP 1,28 | 22/06/2022 | (10.480) | (19.219) |
| (150.000) | Call | Target Healthcare REIT Plc | Goldman Sachs | GBP 1,19 | 14/06/2022 | (3) | (1.646) |
| (175.000) | Call | Target Healthcare REIT Plc | Goldman Sachs | GBP 1,13 | 22/06/2022 | (5.815) | (8.958) |
| (175.000) | Call | Target Healthcare REIT Plc | Goldman Sachs | GBP 1,13 | 08/06/2022 | (3.975) | (6.591) |
| (250.000) | Call | Target Healthcare REIT Plc | Goldman Sachs | GBP 1,11 | 09/06/2022 | (12.003) | (14.563) |
| (250.000) | Call | Target Healthcare REIT Plc | Goldman Sachs | GBP 1,11 | 22/06/2022 | (13.883) | (17.254) |
| (250.000) | Call | Target Healthcare REIT Plc | Goldman Sachs | GBP 1,11 | 16/06/2022 | (13.163) | (16.159) |
| (3.000) | Call | VGP | Goldman Sachs | EUR 247,45 | 22/06/2022 | 16.284 | (38) |
| (3.000) | Call | VGP | Goldman Sachs | EUR 247,45 | 15/06/2022 | 14.628 | (5) |
| (3.000) | Call | VGP | Goldman Sachs | EUR 247,45 | 08/06/2022 | 12.837 | — |
| (3.000) | Call | VGP | Goldman Sachs | EUR 247,45 | 29/06/2022 | 17.797 | (123) |
| (3.000) | Call | VGP | Goldman Sachs | EUR 247,45 | 01/06/2022 | 10.910 | — |
| (189.300) | Call | Vonovia SE | Goldman Sachs | EUR 41,05 | 07/06/2022 | 86.923 | (150) |
| (123.000) | Call | Vonovia SE | Goldman Sachs | EUR 40,14 | 15/06/2022 | 81.837 | (3.471) |
| (189.300) | Call | West Japan Railway Co | Goldman Sachs | JPY 5.073,31 | 15/06/2022 | 181.039 | (16.399) |
| (106.000) | Call | ESR Cayman Ltd | JP Morgan | HKD 25,41 | 07/06/2022 | 6.759 | (139) |
| (1.300) | Call | Orix JREIT Inc | JP Morgan | JPY 186.048,00 | 29/06/2022 | 10.811 | (38.887) |
| (22.300) | Call | Aena SME SA | Morgan Stanley | EUR 152,13 | 08/06/2022 | 71.890 | (2.496) |
| (208) | Call | Boston Properties Inc | Morgan Stanley | USD 133,00 | 17/06/2022 | 108.840 | (54) |
| (100.900) | Call | Cellnex Telecom SA | Morgan Stanley | EUR 46,64 | 01/06/2022 | 133.984 | — |
| (73.200) | Call | Cellnex Telecom SA | Morgan Stanley | EUR 41,86 | 06/07/2022 | (69.198) | (150.233) |
| (485) | Call | CenterPoint Energy Inc | Morgan Stanley | USD 33,07 | 10/06/2022 | 35.286 | (2.544) |
| (423) | Call | CenterPoint Energy Inc | Morgan Stanley | USD 32,15 | 03/06/2022 | 34.868 | (5.317) |
| (1.625) | Call | CenterPoint Energy Inc | Morgan Stanley | USD 31,10 | 17/06/2022 | (60.005) | (178.630) |
| (12.900) | Call | Derwent London Plc | Morgan Stanley | GBP 29,94 | 16/06/2022 | 2.840 | (6.522) |
| (688.000) | Call | ESR Cayman Ltd | Morgan Stanley | HKD 24,59 | 07/06/2022 | 40.267 | (4.545) |
| (424.000) | Call | ESR Cayman Ltd | Morgan Stanley | HKD 24,73 | 22/06/2022 | 22.556 | (12.464) |
| (335.500) | Call | GDS Holdings Ltd 'A' | Morgan Stanley | HKD 41,93 | 07/06/2022 | 175.949 | (46) |
| (164.500) | Call | GDS Holdings Ltd 'A' | Morgan Stanley | HKD 30,20 | 07/06/2022 | 20.908 | (23.422) |
| (44.400) | Call | Infrastrutture Wireless Italiane SpA | Morgan Stanley | EUR 10,49 | 16/06/2022 | (493) | (5.029) |
| (464) | Call | NextEra Energy Inc | Morgan Stanley | USD 84,00 | 07/06/2022 | 119.489 | (223) |
| (1.290) | Call | Outfront Media Inc | Morgan Stanley | USD 23,00 | 15/07/2022 | 32.639 | (66.691) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Real Asset Securities Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Marktwert USD |
|---|-----------|-------------------------------------|----------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (154) | Call | Public Service Enterprise Group Inc | Morgan Stanley | USD 72,00 | 17/06/2022 | 35.816 | (1.144) |
| (50.000) | Call | Secure Income REIT Plc | Morgan Stanley | GBP 4,68 | 07/06/2022 | (1.981) | (5.547) |
| (65.000) | Call | Secure Income REIT Plc | Morgan Stanley | GBP 4,41 | 22/06/2022 | (23.998) | (28.106) |
| (766) | Call | Spirit Realty Capital Inc | Morgan Stanley | USD 45,96 | 17/06/2022 | 124.604 | (254) |
| (1.023.500) | Call | Transurban Group | Morgan Stanley | AUD 13,71 | 01/06/2022 | (249.951) | (463.381) |
| (500.900) | Call | Transurban Group | Morgan Stanley | AUD 15,03 | 22/06/2022 | 78.109 | (37.156) |
| (588.300) | Call | Transurban Group | Morgan Stanley | AUD 14,63 | 08/07/2022 | (5.995) | (122.577) |
| (815) | Call | UDR Inc | Morgan Stanley | USD 58,00 | 17/06/2022 | 209.245 | (1.025) |
| (38.800) | Call | Vonovia SE | Morgan Stanley | EUR 37,55 | 22/06/2022 | 34.854 | (9.918) |
| (10.300) | Call | Warehouses De Pauw SCA | Morgan Stanley | EUR 34,63 | 16/06/2022 | (2.263) | (13.315) |
| (900.000) | Call | Assura Plc | UBS | GBP 0,70 | 14/06/2022 | (11.153) | (20.658) |
| (4.964.400) | Call | Assura Plc | UBS | GBP 0,73 | 13/07/2022 | (30.373) | (83.108) |
| (61.800) | Call | Derwent London Plc | UBS | GBP 31,04 | 13/07/2022 | 15.102 | (25.240) |
| (470.000) | Call | Dexus | UBS | AUD 11,25 | 16/06/2022 | 74.235 | (796) |
| (471.000) | Call | Dexus | UBS | AUD 11,56 | 22/06/2022 | 50.009 | (726) |
| (500.000) | Call | National Storage REIT | UBS | AUD 2,42 | 09/06/2022 | 5.507 | (12.314) |
| (465.000) | Call | NEXTDC Ltd | UBS | AUD 11,12 | 16/06/2022 | 24.927 | (96.053) |
| (317.000) | Call | NEXTDC Ltd | UBS | AUD 10,82 | 09/06/2022 | (20.674) | (83.849) |
| (40.000) | Call | Severn Trent Plc | UBS | GBP 32,11 | 12/07/2022 | 20.571 | (2.433) |
| (500.000) | Call | Sirius Real Estate Ltd | UBS | GBP 1,15 | 22/06/2022 | (10.350) | (31.074) |
| (500.000) | Call | Sirius Real Estate Ltd | UBS | GBP 1,15 | 16/06/2022 | (8.127) | (27.104) |
| (175.000) | Call | Target Healthcare REIT Plc | UBS | GBP 1,11 | 29/06/2022 | (10.848) | (13.729) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 67.649.368) | | | | | | 2.067.419 | (4.559.129) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD |
|---|-------------|---------|---------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| JPY | 206.470.000 | USD | 1.613.138 | Morgan Stanley | 8/7/2022 | (7.387) |
| USD | 944.017 | JPY | 122.688.000 | Bank of America | 8/7/2022 | (10.148) |
| USD | 50.959.108 | JPY | 6.600.266.000 | Merrill Lynch | 8/7/2022 | (372.246) |
| USD | 7.091.775 | JPY | 901.381.000 | JP Morgan | 8/7/2022 | 81.587 |
| | | | | Royal Bank of Canada | 8/7/2022 | 81.587 |
| | | | | | | (308.194) |
| Auf AUD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| AUD | 6.889 | USD | 4.893 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 54 |
| USD | 352 | AUD | 504 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (10) |
| | | | | | | 44 |
| Auf CAD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CAD | 6.556 | USD | 5.112 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 74 |
| USD | 461 | CAD | 597 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (12) |
| | | | | | | 62 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD |
|---|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 5.107.887 | USD | 5.203.466 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 123.503 |
| USD | 617.211 | CHF | 610.619 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (19.598) |
| | | | | | | 103.905 |
| Auf CNH lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CNH | 34.276 | USD | 5.100 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 34 |
| USD | 612 | CNH | 4.126 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (7) |
| | | | | | | 27 |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 33.225.351 | USD | 35.238.896 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 375.261 |
| USD | 3.730.980 | EUR | 3.537.978 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (61.369) |
| | | | | | | 313.892 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Real Asset Securities Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 50.940 | USD | 63.082 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 1.048 |
| USD | 7.416 | GBP | 6.023 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (168) |
| | | | | | | 880 |
| Auf HKD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| HKD | 22.610.602 | USD | 2.882.523 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (225) |
| USD | 212.452 | HKD | 1.666.743 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (18) |
| | | | | | | (243) |
| Auf SGD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| SGD | 44.195.670 | USD | 31.954.082 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 281.017 |
| USD | 2.536.682 | SGD | 3.525.571 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (34.774) |
| | | | | | | 246.243 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 144.261.489) | | | | | | 356.616 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 60,80 |
| Versorger | 12,56 |
| Industrie | 9,97 |
| Kommunikation | 3,75 |
| Grundstoffe | 3,07 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 3,03 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 93,18 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 6,82 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|--|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Irland Fortsetzung | | | |
| BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | | | | | |
| Deutschland | | | | | | | |
| EUR 7.902 | iShares SLI UCITS ETF DE ⁻ | 973.527 | 1,05 | EUR 636.203 | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF (Acc) ⁻ | 3.294.895 | 3,55 |
| | | 973.527 | 1,05 | EUR 285.147 | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 1.712.023 | 1,85 |
| Irland | | | | EUR 98.305 | iShares MSCI Europe Minimum Volatility ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 643.603 | 0,69 |
| USD 262.277 | iShares Ageing Population UCITS ETF ⁻ | 1.579.783 | 1,70 | EUR 476.696 | iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 2.504.561 | 2,70 |
| USD 56.241 | iShares Automation & Robotics UCITS ETF 'A' ⁻ | 538.129 | 0,58 | EUR 2.599.188 | iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 17.908.405 | 19,30 |
| USD 684.606 | iShares China CNY Bond UCITS ETF ^{-A} | 3.194.338 | 3,44 | EUR 316.232 | iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF ⁻ | 2.336.638 | 2,52 |
| GBP 5.130 | iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP Acc ⁻ | 816.155 | 0,88 | USD 113.145 | iShares Physical Gold ETC ⁻ | 3.813.132 | 4,11 |
| GBP 3.588 | iShares Core GBP Corporate Bond UCITS ETF ^{-A} | 565.012 | 0,61 | GBP 466.831 | iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF (Dist) ⁻ | 1.921.491 | 2,07 |
| EUR 27.061 | iShares Developed Markets Property Yield UCITS ETF ⁻ | 663.184 | 0,72 | EUR 1.197.063 | iShares USD Corporate Bond ESG UCITS ETF (Acc) ⁻ | 5.198.845 | 5,60 |
| USD 239.816 | iShares Digitalisation UCITS ETF ⁻ | 1.619.668 | 1,75 | EUR 597.404 | iShares USD High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 2.889.105 | 3,11 |
| EUR 59.427 | iShares EUR Government Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻ | 5.738.271 | 6,18 | EUR 11.863 | iShares USD TIPS UCITS ETF ⁻ | 2.681.868 | 2,89 |
| EUR 253.117 | iShares EUR High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 1.207.874 | 1,30 | EUR 295.846 | iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻ | 1.385.920 | 1,49 |
| EUR 10.289 | iShares Euro Corporate Bond Interest Rate Hedged ESG UCITS ETF 'H' ⁻ | 948.749 | 1,02 | EUR 14.214 | iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF (Dist) ⁻ | 1.719.325 | 1,85 |
| EUR 2.282.357 | iShares Euro Govt Bond Climate UCITS ETF (Acc) ⁻ | 9.974.813 | 10,75 | EUR 212.867 | iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF ⁻ | 869.477 | 0,94 |
| EUR 9.879 | iShares Euro Inflation Linked Government Bond UCITS ETF ⁻ | 2.287.285 | 2,46 | EUR 25.276 | iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF ⁻ | 4.448.576 | 4,79 |
| USD 150.734 | iShares Global Clean Energy UCITS ETF ⁻ | 1.614.490 | 1,74 | | | 91.475.733 | 98,56 |
| EUR 58.471 | iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ⁻ | 2.488.233 | 2,68 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | 92.449.260 | 99,61 |
| EUR 804.041 | iShares JP Morgan ESG USD EM Bond UCITS ETF 'A' ⁻ | 3.738.630 | 4,03 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 92.449.260 | 99,61 |
| EUR 6.937 | iShares MSCI Canada UCITS ETF (Acc) ⁻ | 1.173.255 | 1,26 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 92.449.260 | 99,61 |
| | | | | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 362.844 | 0,39 |
| | | | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 92.812.104 | 100,00 |

⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9.
[^] Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier.

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|------------|---------|------------|-----------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 1.205.144 | CAD | 1.627.395 | Deutsche Bank | 7/6/2022 | 3.928 |
| EUR | 362.469 | GBP | 305.000 | Barclays Bank | 7/6/2022 | 4.057 |
| EUR | 486.146 | GBP | 409.065 | Morgan Stanley | 7/6/2022 | 5.445 |
| EUR | 362.472 | GBP | 305.000 | Toronto Dominion Bank | 7/6/2022 | 4.060 |
| EUR | 39.628.573 | USD | 41.867.984 | BNP Paribas | 7/6/2022 | 553.165 |
| EUR | 1.292.051 | USD | 1.379.211 | Goldman Sachs | 7/6/2022 | 4.833 |
| EUR | 615.090 | USD | 661.018 | HSBC | 7/6/2022 | (1.838) |
| EUR | 2.852.072 | USD | 3.016.414 | Societe Generale | 7/6/2022 | 36.852 |
| USD | 2.532.745 | EUR | 2.405.674 | HSBC | 7/6/2022 | (41.862) |
| | | | | | | 568.640 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|---|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 99.924 | GBP | 85.604 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (634) |
| GBP | 1.463.656 | EUR | 1.708.412 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 10.939 |
| | | | | | | 10.305 |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 707.439 | USD | 747.481 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 10.095 |
| USD | 18.266.831 | EUR | 17.227.585 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (186.000) |
| | | | | | | (175.905) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 68.116.164) | | | | | | 403.040 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022 Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|-----------------|
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 93,17 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 6,44 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 99,61 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 0,39 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|--|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Irland Fortsetzung | | | |
| BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | | | | | |
| Deutschland | | | | | | | |
| EUR 6.796 | iShares SLI UCITS ETF DE ⁻ | 837.267 | 0,53 | EUR 455.293 | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF (Acc) ⁻ | 2.357.962 | 1,49 |
| | | 837.267 | 0,53 | EUR 176.097 | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 1.057.286 | 0,67 |
| Irland | | | | EUR 67.619 | iShares MSCI Europe Minimum Volatility ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 442.702 | 0,28 |
| USD 217.968 | iShares Ageing Population UCITS ETF ⁻ | 1.312.895 | 0,83 | EUR 296.733 | iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 1.559.035 | 0,99 |
| USD 45.164 | iShares Automation & Robotics UCITS ETF 'A' ⁻ | 432.141 | 0,27 | EUR 2.097.734 | iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 14.453.387 | 9,14 |
| USD 1.816.084 | iShares China CNY Bond UCITS ETF ^{-A} | 8.473.760 | 5,36 | USD 146.582 | iShares Physical Gold ETC ^{-A} | 4.940.002 | 3,13 |
| GBP 4.208 | iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP Acc ⁻ | 669.470 | 0,42 | GBP 596.668 | iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF (Dist) ^{-A} | 2.455.905 | 1,55 |
| GBP 15.691 | iShares Core GBP Corporate Bond UCITS ETF ^{-A} | 2.470.905 | 1,56 | EUR 2.618.929 | iShares USD Corporate Bond ESG UCITS ETF (Acc) ⁻ | 11.374.009 | 7,20 |
| EUR 51.007 | iShares Developed Markets Property Yield UCITS ETF ^{-A} | 1.250.029 | 0,79 | EUR 1.266.631 | iShares USD High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 6.125.554 | 3,88 |
| USD 200.976 | iShares Digitalisation UCITS ETF ⁻ | 1.357.350 | 0,86 | EUR 48.907 | iShares USD TIPS UCITS ETF ⁻ | 11.056.405 | 7,00 |
| EUR 93.406 | iShares EUR Government Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻ | 9.019.283 | 5,71 | EUR 746.623 | iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻ | 3.497.630 | 2,21 |
| EUR 558.096 | iShares EUR High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 2.663.234 | 1,69 | EUR 65.941 | iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF (Dist) ⁻ | 7.976.223 | 5,05 |
| EUR 49.492 | iShares Euro Corporate Bond Interest Rate Hedged ESG UCITS ETF 'H' ⁻ | 4.563.657 | 2,89 | EUR 77.534 | iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF ^{-A} | 13.645.984 | 8,63 |
| EUR 5.836.181 | iShares Euro Govt Bond Climate UCITS ETF (Acc) ⁻ | 25.506.445 | 16,14 | | | 156.696.716 | 99,14 |
| EUR 22.626 | iShares Euro Inflation Linked Government Bond UCITS ETF ⁻ | 5.238.598 | 3,31 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | 157.533.983 | 99,67 |
| USD 128.960 | iShares Global Clean Energy UCITS ETF ⁻ | 1.381.272 | 0,87 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 157.533.983 | 99,67 |
| EUR 2.278.296 | iShares JP Morgan ESG USD EM Bond UCITS ETF 'A' ⁻ | 10.593.621 | 6,70 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 157.533.983 | 99,67 |
| EUR 4.860 | iShares MSCI Canada UCITS ETF (Acc) ⁻ | 821.972 | 0,52 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 523.017 | 0,33 |
| | | | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 158.057.000 | 100,00 |

⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9.
^A Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier.

| Currency | Purchases | Currency | Sales | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|---|------------|----------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 855.674 | CAD | 1.155.504 | Morgan Stanley | 7/6/2022 | 2.771 |
| EUR | 2.186.715 | GBP | 1.840.000 | Bank of America Merrill Lynch | 7/6/2022 | 24.494 |
| EUR | 938.853 | GBP | 790.000 | Barclays Bank | 7/6/2022 | 10.509 |
| EUR | 1.429 | GBP | 1.203 | Toronto Dominion Bank | 7/6/2022 | 16 |
| EUR | 81.171.904 | USD | 85.772.054 | BNP Paribas | 7/6/2022 | 1.120.808 |
| EUR | 1.605.075 | USD | 1.724.924 | HSBC | 7/6/2022 | (4.797) |
| EUR | 8.467.460 | USD | 8.955.371 | Societe Generale | 7/6/2022 | 109.408 |
| USD | 4.516.697 | EUR | 4.292.547 | HSBC | 7/6/2022 | (77.113) |
| | | | | | | 1.186.096 |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 1.813.982 | EUR | 1.742.954 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 21.942 |
| EUR | 62.469 | CHF | 65.208 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (975) |
| | | | | | | 20.967 |

| Currency | Purchases | Currency | Sales | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|------------|----------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 654.492 | GBP | 561.684 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (5.317) |
| GBP | 14.026.551 | EUR | 16.371.848 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 105.091 |
| | | | | | | 99.774 |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 1.926.936 | USD | 2.029.952 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 33.145 |
| USD | 79.829.237 | EUR | 75.273.322 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (798.628) |
| | | | | | | (765.483) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 193.512.910) | | | | | | 541.354 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022 Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|-----------------|
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 96,31 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 3,36 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 99,67 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 0,33 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Growth

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|--|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Irland Fortsetzung | | | |
| BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | | | | | |
| Deutschland | | | | | | | |
| EUR 38.077 | iShares SLI UCITS ETF DE ⁻ | 4.691.086 | 1,06 | EUR 898.474 | iShares MSCI Europe Minimum Volatility ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 5.882.309 | 1,32 |
| | | 4.691.086 | 1,06 | EUR 3.170.175 | iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 16.656.099 | 3,74 |
| Irland | | | | EUR 12.490.650 | iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 86.060.578 | 19,35 |
| USD 2.441.702 | iShares Ageing Population UCITS ETF ⁻ | 14.707.196 | 3,31 | EUR 5.992.177 | iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF ⁻ | 44.276.196 | 9,95 |
| USD 513.778 | iShares Automation & Robotics UCITS ETF 'A' ⁻ | 4.915.963 | 1,11 | EUR 5.213.968 | iShares MSCI USA Minimum Volatility ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 31.059.607 | 6,98 |
| GBP 38.820 | iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP Acc ⁻ | 6.176.047 | 1,39 | EUR 2.027.246 | iShares MSCI World Momentum Factor ESG UCITS ETF ⁻ | 7.679.208 | 1,73 |
| EUR 158.077 | iShares Developed Markets Property Yield UCITS ETF ^{-^} | 3.873.993 | 0,87 | EUR 1.880.715 | iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF ⁻ | 8.518.699 | 1,92 |
| USD 2.265.966 | iShares Digitalisation UCITS ETF ⁻ | 15.303.865 | 3,44 | USD 414.808 | iShares Physical Gold ETC ⁻ | 13.979.563 | 3,14 |
| USD 212.858 | iShares Edge MSCI World Minimum Volatility UCITS ETF (Acc) ⁻ | 11.178.896 | 2,51 | EUR 26.708 | iShares USD TIPS UCITS ETF ^{-^} | 6.037.878 | 1,36 |
| USD 430.116 | iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF ⁻ | 19.850.583 | 4,46 | EUR 8.928.507 | iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF ⁻ | 36.469.380 | 8,20 |
| USD 249.999 | iShares Edge MSCI World Size Factor UCITS ETF ⁻ | 9.243.838 | 2,08 | EUR 59.662 | iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF ⁻ | 10.500.512 | 2,36 |
| EUR 114.534 | iShares EUR Government Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻ | 11.059.403 | 2,49 | | | 437.700.149 | 98,40 |
| EUR 1.392.428 | iShares Euro Govt Bond Climate UCITS ETF (Acc) ⁻ | 6.085.467 | 1,37 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | 442.391.235 | 99,46 |
| USD 1.504.203 | iShares Global Clean Energy UCITS ETF ⁻ | 16.111.297 | 3,62 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 442.391.235 | 99,46 |
| EUR 58.703 | iShares MSCI Canada UCITS ETF (Acc) ⁻ | 9.928.438 | 2,23 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 442.391.235 | 99,46 |
| EUR 6.135.126 | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF (Acc) ⁻ | 31.773.818 | 7,14 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 2.412.521 | 0,54 |
| EUR 1.727.401 | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 10.371.316 | 2,33 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 444.803.756 | 100,00 |

⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9.

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

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-------------|---------|-------------|--------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 10.454.003 | CAD | 14.117.106 | Morgan Stanley Bank of America | 7/6/2022 | 33.856 |
| EUR | 4.498.214 | GBP | 3.785.000 | Merrill Lynch | 7/6/2022 | 50.385 |
| EUR | 1.949 | GBP | 1.640 | Morgan Stanley | 7/6/2022 | 22 |
| EUR | 1.925.259 | GBP | 1.620.000 | Toronto Dominion Bank | 7/6/2022 | 21.565 |
| EUR | 181.494.590 | USD | 191.784.140 | BNP Paribas | 7/6/2022 | 2.502.368 |
| EUR | 3.625.191 | USD | 3.895.879 | HSBC | 7/6/2022 | (10.835) |
| EUR | 4.047.106 | USD | 4.265.572 | Toronto Dominion Bank | 7/6/2022 | 66.046 |
| EUR | 2.855.944 | USD | 3.079.254 | Societe Generale | 5/7/2022 | (13.695) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|---|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 11.707.274 | EUR | 11.114.835 | HSBC | 7/6/2022 | (188.431) |
| USD | 2.575.681 | EUR | 2.435.351 | Societe Generale | 7/6/2022 | (31.467) |
| USD | 2.581.583 | EUR | 2.445.774 | UBS | 7/6/2022 | (36.381) |
| | | | | | | 2.393.433 |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 2.234.975 | EUR | 2.148.213 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 26.283 |
| EUR | 257.925 | CHF | 268.426 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (3.236) |
| | | | | | | 23.047 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Growth Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 7.658.485 | GBP | 6.550.057 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (35.838) |
| GBP | 58.763.825 | EUR | 68.632.129 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 397.513 |
| | | | | | | 361.675 |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 5.972.381 | USD | 6.310.079 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 85.550 |
| USD | 72.520.272 | EUR | 68.397.967 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (741.988) |
| | | | | | | (656.438) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 374.694.664) | | | | | | 2.121.717 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 80,92 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 18,54 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 99,46 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 0,54 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|---|------------------------|--------------------|--|--|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | Irland Fortsetzung | | | | |
| BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | | | | | | | |
| Deutschland | | | | | | | | | |
| EUR 58.302 | | iShares SLI UCITS ETF DE ⁻ | 7.182.806 | 0,92 | EUR 1.669.368 | | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 10.022.885 | 1,28 |
| | | | 7.182.806 | 0,92 | EUR 873.613 | | iShares MSCI Europe Minimum Volatility ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 5.719.544 | 0,73 |
| Irland | | | | | EUR 3.544.515 | | iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 18.622.882 | 2,38 |
| USD 3.296.087 | | iShares Ageing Population UCITS ETF ⁻ | 19.853.445 | 2,54 | EUR 20.168.336 | | iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 138.959.835 | 17,75 |
| USD 647.086 | | iShares Automation & Robotics UCITS ETF 'A' ⁻ | 6.191.489 | 0,79 | EUR 6.645.755 | | iShares MSCI USA Minimum Volatility ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 39.588.763 | 5,06 |
| USD 4.453.879 | | iShares China CNY Bond UCITS ETF ^{-^} | 20.781.583 | 2,65 | EUR 2.435.945 | | iShares MSCI World Momentum Factor ESG UCITS ETF ⁻ | 9.227.360 | 1,18 |
| GBP 43.016 | | iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP Acc ⁻ | 6.843.608 | 0,87 | EUR 2.282.556 | | iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF ⁻ | 10.338.837 | 1,32 |
| EUR 244.316 | | iShares Developed Markets Property Yield UCITS ETF ^{-^} | 5.987.452 | 0,76 | USD 991.914 | | iShares Physical Gold ETC ⁻ | 33.428.778 | 4,27 |
| USD 3.013.825 | | iShares Digitalisation UCITS ETF ⁻ | 20.354.750 | 2,60 | EUR 7.688.631 | | iShares USD Corporate Bond ESG UCITS ETF (Acc) ⁻ | 33.391.724 | 4,26 |
| USD 255.730 | | iShares Edge MSCI World Minimum Volatility UCITS ETF (Acc) ⁻ | 13.430.451 | 1,72 | EUR 4.771.278 | | iShares USD High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 23.074.378 | 2,95 |
| USD 517.547 | | iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF ⁻ | 23.885.672 | 3,05 | EUR 74.948 | | iShares USD TIPS UCITS ETF ⁻ | 16.943.494 | 2,16 |
| USD 297.553 | | iShares Edge MSCI World Size Factor UCITS ETF ⁻ | 11.002.171 | 1,40 | EUR 2.217.832 | | iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻ | 10.389.656 | 1,33 |
| EUR 137.221 | | iShares EUR Government Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻ | 13.250.060 | 1,69 | EUR 409.551 | | iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF (Dist) ⁻ | 49.539.289 | 6,33 |
| EUR 2.037.451 | | iShares EUR High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 9.722.716 | 1,24 | EUR 3.775.161 | | iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF ⁻ | 15.420.023 | 1,97 |
| EUR 14.130.956 | | iShares Euro Govt Bond Climate UCITS ETF (Acc) ⁻ | 61.757.930 | 7,89 | EUR 143.853 | | iShares USD Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF ⁻ | 17.449.369 | 2,23 |
| EUR 115.270 | | iShares Euro Inflation Linked Government Bond UCITS ETF ⁻ | 26.688.463 | 3,41 | | | | 772.014.090 | 98,60 |
| USD 1.938.608 | | iShares Global Clean Energy UCITS ETF ⁻ | 20.764.145 | 2,65 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | | 779.196.896 | 99,52 |
| EUR 215.455 | | iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ^{-^} | 9.168.688 | 1,17 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | 779.196.896 | 99,52 |
| EUR 5.339.001 | | iShares JP Morgan ESG USD EM Bond UCITS ETF 'A' ⁻ | 24.825.287 | 3,17 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | 779.196.896 | 99,52 |
| EUR 62.739 | | iShares MSCI Canada UCITS ETF (Acc) ⁻ | 10.611.047 | 1,36 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | 3.750.505 | 0,48 |
| EUR 6.715.257 | | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF (Acc) ⁻ | 34.778.316 | 4,44 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | | 782.947.401 | 100,00 |

⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9.

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

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-------------|---------|-------------|--|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 11.219.475 | CAD | 15.150.801 | Morgan Stanley Bank of America | 7/6/2022 | 36.335 |
| EUR | 2.162.946 | GBP | 1.820.000 | Merrill Lynch | 7/6/2022 | 24.227 |
| EUR | 4.614.444 | GBP | 3.936.716 | Societe Generale Toronto Dominion Bank | 7/6/2022 | (11.670) |
| EUR | 926.044 | GBP | 779.215 | BNP Paribas | 7/6/2022 | 10.373 |
| EUR | 340.211.507 | USD | 359.526.317 | HSBC | 7/6/2022 | 4.665.437 |
| EUR | 4.256.580 | USD | 4.574.413 | Societe Generale | 7/6/2022 | (12.722) |
| EUR | 20.317.724 | USD | 21.488.470 | | 7/6/2022 | 262.526 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|------------|---------|------------|-----------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 4.427.643 | USD | 4.615.277 | Standard Chartered Bank | 7/6/2022 | 120.203 |
| EUR | 5.270.399 | USD | 5.682.499 | Societe Generale | 5/7/2022 | (25.272) |
| USD | 18.928.093 | EUR | 17.974.476 | HSBC | 7/6/2022 | (308.878) |
| USD | 4.400.834 | EUR | 4.243.424 | THE BANK OF NEW YORK MELLON | 7/6/2022 | (136.124) |
| USD | 4.963.646 | EUR | 4.702.524 | UBS | 7/6/2022 | (69.951) |
| | | | | | | 4.554.484 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|-------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 4.732.122 | EUR | 4.547.831 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 56.240 |
| EUR | 326.072 | CHF | 339.384 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (4.128) |
| | | | | | | 52.112 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 9.785.767 | GBP | 8.376.105 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (53.611) |
| GBP | 112.240.439 | EUR | 131.057.195 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 791.229 |
| | | | | | | 737.618 |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 12.926.441 | USD | 13.641.829 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 199.633 |
| USD | 192.722.796 | EUR | 181.751.183 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (1.955.251) |
| | | | | | | (1.755.618) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 753.887.608) | | | | | | 3.588.596 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 92,31 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 7,21 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 99,52 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 0,48 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| ANLEIHEN | | | |
| Deutschland | | | |
| USD 9.000.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,625% 15/2/2023 | 8.967.870 | 7,41 |
| | | <u>8.967.870</u> | <u>7,41</u> |
| Supranationale Anleihen | | | |
| USD 12.573.000 | Asian Development Bank 1,875% 19/7/2022 | 12.580.206 | 10,40 |
| USD 3.673.000 | Asian Development Bank 1,625% 24/1/2023 | 3.660.647 | 3,03 |
| USD 5.000.000 | Asian Development Bank 2,75% 17/3/2023 | 5.024.629 | 4,15 |
| USD 5.019.000 | European Investment Bank 2,50% 15/3/2023 | 5.035.590 | 4,16 |
| USD 13.000.000 | International Bank for Reconstruction & Development 2,125% 1/7/2022 | 13.009.217 | 10,75 |
| USD 12.168.000 | International Bank for Reconstruction & Development 1,75% 19/4/2023 | 12.121.431 | 10,02 |
| | | <u>51.431.720</u> | <u>42,51</u> |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| USD 5.500.000 | United States Treasury Bill 16/6/2022 (Zero Coupon) | 5.499.856 | 4,54 |
| USD 3.800.000 | United States Treasury Bill 8/9/2022 (Zero Coupon) | 3.796.215 | 3,14 |
| USD 6.410.000 | United States Treasury Bill 3/11/2022 (Zero Coupon) | 6.403.807 | 5,29 |
| USD 5.000.000 | United States Treasury Bill 26/1/2023 (Zero Coupon) | 4.947.984 | 4,09 |
| USD 5.000.000 | United States Treasury Bill 23/2/2023 (Zero Coupon) | 4.951.309 | 4,09 |
| USD 5.000.000 | United States Treasury Bill 23/3/2023 (Zero Coupon) | 4.931.289 | 4,08 |
| | | <u>30.530.460</u> | <u>25,23</u> |
| Gesamt Anleihen | | <u>90.930.050</u> | <u>75,15</u> |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| | | <u>90.930.050</u> | <u>75,15</u> |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | |
| | | <u>90.930.050</u> | <u>75,15</u> |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | |
| | | <u>30.067.987</u> | <u>24,85</u> |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | | |
| | | <u>120.998.037</u> | <u>100,00</u> |

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|--|----------------------------------|---|-------------------------------|--------------------------------------|----------------------------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (107) | CSL Ltd | BNP Paribas | 416 |
| Australien | | | | (249) | CSL Ltd | Goldam Sachs | 969 |
| 588 | Ampol Ltd | Barclays Bank | (51) | (1) | Deterra Royalties Ltd ^{††} | Bank of America Merrill Lynch | — |
| 1.445 | Ampol Ltd | BNP Paribas | (332) | (199) | Domino's Pizza Enterprises Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 255 |
| 454 | Ampol Ltd | Citibank | (39) | (1.012) | Domino's Pizza Enterprises Ltd | BNP Paribas | 930 |
| 1.517 | Ampol Ltd | Goldam Sachs | (349) | (763) | Domino's Pizza Enterprises Ltd | Goldam Sachs | 701 |
| 532 | Ampol Ltd | HSBC | 46 | (551) | Domino's Pizza Enterprises Ltd | HSBC | (487) |
| (1.265) | APA Group (Unit) | Barclays Bank | 427 | 3.201 | Endeavour Group Ltd | Citibank | (666) |
| (14.570) | APA Group (Unit) | BNP Paribas | (628) | 2.023 | Endeavour Group Ltd | Goldam Sachs | (712) |
| (11.618) | APA Group (Unit) | Goldam Sachs | (500) | (25.611) | Evolution Mining Ltd | BNP Paribas | (6.986) |
| (3.018) | APA Group (Unit) | HSBC | (585) | 1.771 | Fortescue Metals Group Ltd | Barclays Bank | (763) |
| 1.060 | Aristocrat Leisure Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.628 | 3.836 | Fortescue Metals Group Ltd | BNP Paribas | 1.053 |
| 1.878 | Aristocrat Leisure Ltd | Barclays Bank | (2.723) | 526 | IDP Education Ltd | Barclays Bank | 102 |
| 4.883 | Aristocrat Leisure Ltd | BNP Paribas | 7.501 | 1.585 | IDP Education Ltd | BNP Paribas | 978 |
| 269 | Aristocrat Leisure Ltd | Citibank | (390) | 518 | IDP Education Ltd | Citibank | 100 |
| 10.337 | Aristocrat Leisure Ltd | Goldam Sachs | 15.880 | 1.949 | IDP Education Ltd | Goldam Sachs | 1.203 |
| 421 | Aristocrat Leisure Ltd | HSBC | 728 | 546 | IDP Education Ltd | HSBC | (86) |
| 1.265 | Aristocrat Leisure Ltd | JP Morgan | 2.188 | (2) | Iluka Resources Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2) |
| 581 | ASX Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (442) | (49.865) | Insurance Australia Group Ltd | Barclays Bank | 8.233 |
| 150 | ASX Ltd | Barclays Bank | (298) | 6.258 | James Hardie Industries Plc - CDI | Barclays Bank | (9.658) |
| 556 | ASX Ltd | BNP Paribas | (423) | 4.594 | James Hardie Industries Plc - CDI | BNP Paribas | (9.069) |
| 650 | ASX Ltd | Goldam Sachs | (495) | 4.094 | James Hardie Industries Plc - CDI | Goldam Sachs | (8.082) |
| 27.681 | Aurizon Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 795 | (6.494) | Lendlease Corp Ltd (Unit) | Goldam Sachs | 3.077 |
| 23.419 | Aurizon Holdings Ltd | Barclays Bank | 336 | 111 | Lottery Corp Ltd | BNP Paribas | 378 |
| 48.522 | Aurizon Holdings Ltd | BNP Paribas | 1.393 | 39.646 | Lottery Corp Ltd | Citibank | 134.900 |
| 38.593 | Aurizon Holdings Ltd | Goldam Sachs | 1.108 | 24.907 | Lottery Corp Ltd | HSBC | 84.749 |
| 10.429 | Aurizon Holdings Ltd | HSBC | 75 | 18.451 | Lottery Corp Ltd | JP Morgan | 62.781 |
| 18.911 | Aurizon Holdings Ltd | JP Morgan | 136 | (124) | Macquarie Group Ltd | Barclays Bank | (727) |
| 1.137 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (365) | (257) | Macquarie Group Ltd | BNP Paribas | (1.166) |
| 939 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | Barclays Bank | (388) | (147) | Macquarie Group Ltd | Goldam Sachs | (620) |
| 552 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | BNP Paribas | (214) | (234) | Macquarie Group Ltd | HSBC | (885) |
| 1.619 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | Citibank | (314) | (75.654) | Medibank Pvt Ltd | Goldam Sachs | — |
| 674 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | Goldam Sachs | (261) | (1.365) | Mineral Resources Ltd | BNP Paribas | (8.652) |
| 840 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | HSBC | (181) | (511) | National Australia Bank Ltd | Barclays Bank | (176) |
| 5.849 | BlueScope Steel Ltd | Barclays Bank | 168 | (6.554) | National Australia Bank Ltd | BNP Paribas | 282 |
| 657 | BlueScope Steel Ltd | BNP Paribas | 297 | (4.094) | Newcrest Mining Ltd | BNP Paribas | (764) |
| 1.482 | BlueScope Steel Ltd | Citibank | 43 | (6.029) | Newcrest Mining Ltd | Goldam Sachs | (1.125) |
| 3.582 | BlueScope Steel Ltd | Goldam Sachs | 1.620 | (1.603) | Newcrest Mining Ltd | HSBC | 1.116 |
| 1.056 | BlueScope Steel Ltd | JP Morgan | 68 | (2.687) | Northern Star Resources Ltd | Barclays Bank | 193 |
| 32.594 | Brambles Ltd | BNP Paribas | (16.846) | (7.133) | Northern Star Resources Ltd | BNP Paribas | (1.587) |
| 257 | Cochlear Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.967 | (3.902) | Northern Star Resources Ltd | Goldam Sachs | (868) |
| 1.461 | Cochlear Ltd | Barclays Bank | 3.818 | (10.481) | Orica Ltd | BNP Paribas | 1.204 |
| 561 | Cochlear Ltd | BNP Paribas | 4.293 | (2.772) | Qantas Airways Ltd | HSBC | (259) |
| 197 | Cochlear Ltd | Citibank | 515 | (3.410) | QBE Insurance Group Ltd | JP Morgan | 955 |
| 139 | Cochlear Ltd | Goldam Sachs | 1.064 | (1.117) | Ramsay Health Care Ltd | Barclays Bank | 778 |
| 170 | Cochlear Ltd | HSBC | 792 | (3.256) | Ramsay Health Care Ltd | BNP Paribas | 257 |
| 1.205 | Coles Group Ltd | Barclays Bank | (199) | (1.419) | Ramsay Health Care Ltd | Goldam Sachs | 220 |
| 6.717 | Coles Group Ltd | BNP Paribas | (5.208) | (207) | Ramsay Health Care Ltd | HSBC | 86 |
| 10.694 | Coles Group Ltd | Goldam Sachs | (8.291) | 1.034 | REA Group Ltd | BNP Paribas | (935) |
| 4.212 | Coles Group Ltd | HSBC | (3.810) | 2.111 | REA Group Ltd | Goldam Sachs | (1.909) |
| (1.176) | Commonwealth Bank of Australia | BNP Paribas | (870) | 119 | REA Group Ltd | HSBC | 455 |
| (2.470) | Computershare Ltd | Barclays Bank | 2.074 | 83 | REA Group Ltd | JP Morgan | 318 |
| (2.791) | Computershare Ltd | BNP Paribas | 1.422 | (3.477) | Reece Ltd | BNP Paribas | 225 |
| (2.704) | Computershare Ltd | Goldam Sachs | 1.378 | (2.455) | Reece Ltd | HSBC | 846 |
| (2.343) | Computershare Ltd | HSBC | 1.598 | 115 | Rio Tinto Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 830 |
| (900) | Computershare Ltd | JP Morgan | 614 | 39 | Rio Tinto Ltd | Barclays Bank | 139 |
| (951) | Crown Resorts Ltd | Barclays Bank | 14 | | | | |
| (9.362) | Crown Resorts Ltd | BNP Paribas | (874) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|----------------------------------|-------------------------------|---|----------------------------|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Australien Fortsetzung | | | | Belgien Fortsetzung | | | |
| 1.719 | Rio Tinto Ltd | BNP Paribas | 12.402 | (131) | Argenx SE | Goldam Sachs | 590 |
| 72 | Rio Tinto Ltd | Goldam Sachs | 519 | (837) | Colruyt SA | Barclays Bank | 565 |
| 162 | Rio Tinto Ltd | JP Morgan | 890 | (2.009) | Colruyt SA | Goldam Sachs | 7.210 |
| (28.262) | Santos Ltd | Barclays Bank | (406) | (2.118) | Colruyt SA | HSBC | 8.440 |
| (4.666) | Santos Ltd | BNP Paribas | (368) | 379 | Elia Group SA | Barclays Bank | (1.421) |
| (16.424) | Santos Ltd | Goldam Sachs | (1.297) | 77 | Elia Group SA | HSBC | 767 |
| (6.177) | SEEK Ltd | Barclays Bank | 5.188 | 513 | Groupe Bruxelles Lambert SA | Bank of America Merrill Lynch | 923 |
| (670) | Sonic Healthcare Ltd | Barclays Bank | 43 | 556 | Groupe Bruxelles Lambert SA | Barclays Bank | 620 |
| 1.550 | South32 Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 668 | 2.056 | Groupe Bruxelles Lambert SA | BNP Paribas | 3.700 |
| 17.280 | South32 Ltd | Barclays Bank | 4.093 | 796 | Groupe Bruxelles Lambert SA | Goldam Sachs | 1.433 |
| 3.393 | South32 Ltd | BNP Paribas | 1.461 | 203 | Groupe Bruxelles Lambert SA | HSBC | 892 |
| 21.603 | Suncorp Group Ltd | Barclays Bank | (12.406) | 393 | Groupe Bruxelles Lambert SA | JP Morgan | 1.726 |
| 111 | Tabcorp Holdings Ltd | BNP Paribas | (333) | 6.284 | Proximus SADP | BNP Paribas | (2.390) |
| 39.646 | Tabcorp Holdings Ltd | Citibank | (125.508) | (167) | Solvay SA | Barclays Bank | (68) |
| 24.907 | Tabcorp Holdings Ltd | HSBC | (74.558) | (138) | Solvay SA | BNP Paribas | 263 |
| 18.451 | Tabcorp Holdings Ltd | JP Morgan | (55.232) | (566) | Solvay SA | Goldam Sachs | 1.079 |
| (3.695) | Telstra Corp Ltd | Barclays Bank | 106 | 2.664 | UCB SA | BNP Paribas | (18.436) |
| (34.381) | Telstra Corp Ltd | BNP Paribas | 1.273 | 245 | Umicore SA | Bank of America Merrill Lynch | 407 |
| (9.285) | Telstra Corp Ltd | Goldam Sachs | 350 | 629 | Umicore SA | Citibank | 788 |
| (8.238) | Telstra Corp Ltd | HSBC | 112 | 680 | Umicore SA | JP Morgan | 2.324 |
| (3.316) | Telstra Corp Ltd | JP Morgan | 238 | | | | 23.086 |
| (33.649) | Transurban Group (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | (6.763) | Kanada | | | |
| (14.517) | Transurban Group (Unit) | BNP Paribas | (2.918) | (162) | Agnico Eagle Mines Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (275) |
| (5.379) | Transurban Group (Unit) | Goldam Sachs | (1.081) | (819) | Agnico Eagle Mines Ltd | BNP Paribas | (1.393) |
| (4.075) | Treasury Wine Estates Ltd | Goldam Sachs | (2.135) | (777) | Agnico Eagle Mines Ltd | Goldam Sachs | (1.321) |
| 737 | Wesfarmers Ltd | Goldam Sachs | (1.307) | (3.845) | Air Canada | Bank of America Merrill Lynch | (4.588) |
| (28.016) | Westpac Banking Corp | BNP Paribas | 10.257 | (7.995) | Air Canada | BNP Paribas | (9.736) |
| (1.198) | WiseTech Global Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (851) | (348) | Air Canada | Goldam Sachs | (427) |
| (1.855) | Woolworths Group Ltd | BNP Paribas | 3.742 | (1.206) | Air Canada | JP Morgan | (1.488) |
| (1.294) | Woolworths Group Ltd | Goldam Sachs | 2.610 | (16.056) | Algonquin Power & Utilities Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3.810) |
| (217) | Woolworths Group Ltd | HSBC | 578 | (3.650) | Algonquin Power & Utilities Corp | BNP Paribas | (866) |
| (590) | Xero Ltd | Barclays Bank | 504 | (1.004) | Algonquin Power & Utilities Corp | Citibank | 222 |
| (1.369) | Xero Ltd | BNP Paribas | (1.386) | (8.825) | Algonquin Power & Utilities Corp | HSBC | (5.165) |
| (475) | Xero Ltd | Goldam Sachs | (481) | 4.532 | AltaGas Ltd | Goldam Sachs | 4.140 |
| (76) | Xero Ltd | JP Morgan | (270) | 4.220 | AltaGas Ltd | HSBC | 6.191 |
| | | | 19.189 | (8.844) | Ballard Power Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.345) |
| Österreich | | | | (718) | Ballard Power Systems Inc | BNP Paribas | (596) |
| (1.752) | Erste Group Bank AG | BNP Paribas | (2.872) | (1.329) | Ballard Power Systems Inc | HSBC | (578) |
| (615) | Erste Group Bank AG | Goldam Sachs | (1.008) | 422 | Bank of Montreal | BNP Paribas | 1.412 |
| 56 | OMV AG | Barclays Bank | 204 | 1.120 | Bank of Montreal | Goldam Sachs | 3.747 |
| 2.571 | OMV AG | BNP Paribas | 21.428 | 823 | Bank of Nova Scotia | Bank of America Merrill Lynch | 2.402 |
| 699 | OMV AG | Citibank | 2.546 | 1.109 | Bank of Nova Scotia | BNP Paribas | 2.281 |
| 800 | OMV AG | Goldam Sachs | 6.667 | 411 | Bank of Nova Scotia | Citibank | 700 |
| 311 | OMV AG | JP Morgan | 3.295 | 757 | Bank of Nova Scotia | Goldam Sachs | 2.605 |
| 2.424 | Raiffeisen Bank International AG | BNP Paribas | 935 | 892 | Bank of Nova Scotia | HSBC | 3.099 |
| (1.369) | Verbund AG | Barclays Bank | (11.219) | 339 | Bank of Nova Scotia | JP Morgan | 1.003 |
| (350) | Verbund AG | BNP Paribas | (3.112) | (3.430) | Bausch Health Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.313 |
| (670) | Verbund AG | Citibank | (5.491) | (3.693) | Bausch Health Cos Inc | BNP Paribas | 4.644 |
| (238) | Verbund AG | HSBC | (2.473) | (894) | Bausch Health Cos Inc | Citibank | (255) |
| 1.077 | voestalpine AG | Barclays Bank | 231 | (5.652) | Bausch Health Cos Inc | Goldam Sachs | 7.108 |
| 875 | voestalpine AG | BNP Paribas | 2.475 | (1.439) | Bausch Health Cos Inc | HSBC | 5.144 |
| 277 | voestalpine AG | Goldam Sachs | 783 | (745) | BCE Inc | Bank of America Merrill Lynch | 112 |
| | | | 12.389 | (4.206) | BCE Inc | BNP Paribas | 632 |
| Belgien | | | | | | | |
| 392 | Ageas SA | Bank of America Merrill Lynch | 949 | | | | |
| 641 | Ageas SA | BNP Paribas | 1.552 | | | | |
| 186 | Ageas SA | Goldam Sachs | 450 | | | | |
| 215 | Ageas SA | JP Morgan | 792 | | | | |
| (2.096) | Anheuser-Busch InBev SA | Barclays Bank | (1.280) | | | | |
| (3.874) | Anheuser-Busch InBev SA | BNP Paribas | 6.599 | | | | |
| (770) | Anheuser-Busch InBev SA | Citibank | (470) | | | | |
| (1.032) | Anheuser-Busch InBev SA | Goldam Sachs | 1.758 | | | | |
| (460) | Anheuser-Busch InBev SA | HSBC | (774) | | | | |
| (571) | Argenx SE | Barclays Bank | 4.098 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--------------------------------------|-----------------|---|---------------------------|--------------------------------|-----------------|---|
| Kanada Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| (1.136) | BCE Inc | Citibank | (602) | 537 | Dollarama Inc | JP Morgan | 388 |
| (2.448) | BCE Inc | Goldam Sachs | 368 | 400 | Empire Co Ltd 'A' | Bank of America | |
| (17) | BCE Inc | HSBC | 13 | | | Merrill Lynch | (275) |
| (1.486) | BlackBerry Ltd | Bank of America | | 373 | Empire Co Ltd 'A' | BNP Paribas | (257) |
| | | Merrill Lynch | (752) | 10.811 | Empire Co Ltd 'A' | Goldam Sachs | (7.439) |
| (4.761) | BlackBerry Ltd | BNP Paribas | (2.410) | (4.146) | Enbridge Inc | BNP Paribas | (4.788) |
| (1.917) | BlackBerry Ltd | HSBC | (1.941) | (3.444) | Enbridge Inc | Goldam Sachs | (3.977) |
| (3.683) | Brookfield Asset Management Inc 'A' | Bank of America | | (57) | Fairfax Financial Holdings Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (7.719) | (38) | Fairfax Financial Holdings Ltd | Merrill Lynch | (782) |
| (837) | Brookfield Asset Management Inc 'A' | BNP Paribas | (1.754) | (271) | Fairfax Financial Holdings Ltd | BNP Paribas | (521) |
| (3.341) | Brookfield Renewable Corp 'A' | Bank of America | | (59) | Fairfax Financial Holdings Ltd | Goldam Sachs | (3.717) |
| | | Merrill Lynch | (7.082) | (1.992) | First Quantum Minerals Ltd | JP Morgan | (1.584) |
| (907) | Brookfield Renewable Corp 'A' | BNP Paribas | (1.923) | | | Bank of America | |
| (580) | Brookfield Renewable Corp 'A' | Goldam Sachs | (1.229) | (1.302) | First Quantum Minerals Ltd | Merrill Lynch | (3.608) |
| (2.049) | Brookfield Renewable Corp 'A' | JP Morgan | (1.912) | (1.216) | First Quantum Minerals Ltd | BNP Paribas | (2.358) |
| (3.468) | CAE Inc | Bank of America | | (141) | FirstService Corp | Citibank | (866) |
| | | Merrill Lynch | (5.678) | (1.311) | Fortis Inc | BNP Paribas | 151 |
| (3.022) | CAE Inc | BNP Paribas | (4.948) | (1.908) | Fortis Inc | Bank of America | |
| (2.737) | Cameco Corp | Goldam Sachs | (6.018) | (8.074) | Fortis Inc | Merrill Lynch | (726) |
| 574 | Canadian Apartment Properties (REIT) | BNP Paribas | 222 | (531) | Fortis Inc | BNP Paribas | (1.056) |
| 166 | Canadian Apartment Properties (REIT) | Citibank | (63) | 734 | Franco-Nevada Corp | Goldam Sachs | (4.470) |
| 23 | Canadian Apartment Properties (REIT) | Goldam Sachs | 9 | 197 | Franco-Nevada Corp | JP Morgan | 248 |
| 2.706 | Canadian Imperial Bank of Commerce | BNP Paribas | 813 | 197 | Franco-Nevada Corp | BNP Paribas | 4.052 |
| 3.446 | Canadian Imperial Bank of Commerce | Goldam Sachs | 1.036 | 1.193 | Franco-Nevada Corp | Goldam Sachs | 1.088 |
| 92 | Canadian Imperial Bank of Commerce | HSBC | 6 | 171 | Franco-Nevada Corp | HSBC | (1.717) |
| 148 | Canadian National Railway Co | Bank of America | | 2.614 | George Weston Ltd | JP Morgan | (246) |
| | | Merrill Lynch | (61) | (7.995) | GFL Environmental Inc | Bank of America | |
| 363 | Canadian National Railway Co | BNP Paribas | (149) | | | Merrill Lynch | 827 |
| 204 | Canadian National Railway Co | Citibank | 465 | (7.697) | GFL Environmental Inc | Bank of America | |
| 419 | Canadian National Railway Co | Goldam Sachs | (172) | (1.413) | GFL Environmental Inc | Merrill Lynch | (13.153) |
| 154 | Canadian National Railway Co | HSBC | (16) | (8.190) | GFL Environmental Inc | BNP Paribas | (12.662) |
| 584 | Canadian National Railway Co | JP Morgan | 23 | 1.691 | GFL Environmental Inc | Citibank | (1.173) |
| 397 | Canadian Pacific Railway Ltd | BNP Paribas | 53 | | Gildan Activewear Inc | HSBC | (15.546) |
| 125 | Canadian Tire Corp Ltd 'A' | Bank of America | | 344 | Gildan Activewear Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (396) | 2.362 | Gildan Activewear Inc | Merrill Lynch | (629) |
| 29 | Canadian Tire Corp Ltd 'A' | BNP Paribas | (92) | 83 | Gildan Activewear Inc | BNP Paribas | (25) |
| 729 | Canadian Tire Corp Ltd 'A' | Citibank | 4.861 | 1.032 | Gildan Activewear Inc | Goldam Sachs | (878) |
| 518 | Canadian Tire Corp Ltd 'A' | Goldam Sachs | (1.643) | (328) | Great-West Lifeco Inc | HSBC | 51 |
| 200 | Canadian Tire Corp Ltd 'A' | HSBC | 272 | (1.339) | Great-West Lifeco Inc | JP Morgan | 629 |
| 24 | Canadian Tire Corp Ltd 'A' | JP Morgan | 33 | 10.119 | Hydro One Ltd | Bank of America | |
| (5.013) | Canadian Utilities Ltd 'A' | Bank of America | | 17.028 | Hydro One Ltd | Merrill Lynch | (350) |
| | | Merrill Lynch | (396) | 10.232 | Hydro One Ltd | BNP Paribas | (1.430) |
| (851) | CCL Industries Inc 'B' | Bank of America | | 2.792 | iA Financial Corp Inc | BNP Paribas | (240) |
| | | Merrill Lynch | 404 | | | Goldam Sachs | (404) |
| (3.094) | CCL Industries Inc 'B' | BNP Paribas | 1.468 | 218 | iA Financial Corp Inc | HSBC | (2.266) |
| (936) | CCL Industries Inc 'B' | Goldam Sachs | 444 | 693 | iA Financial Corp Inc | Bank of America | |
| (275) | CCL Industries Inc 'B' | HSBC | (1.164) | 214 | iA Financial Corp Inc | Merrill Lynch | 508 |
| (400) | CGI Inc | BNP Paribas | (1.035) | (5.748) | IGM Financial Inc | BNP Paribas | 40 |
| (153) | CGI Inc | Goldam Sachs | (396) | | | Citibank | (378) |
| (366) | CGI Inc | HSBC | (1.589) | (1.369) | Keyera Corp | HSBC | (300) |
| 31 | Constellation Software Inc | Bank of America | | 884 | Intact Financial Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 967 | | | Merrill Lynch | 3.307 |
| 113 | Constellation Software Inc | BNP Paribas | 3.524 | 66 | Intact Financial Corp | HSBC | 258 |
| 491 | Constellation Software Inc | Goldam Sachs | 15.312 | (1.956) | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 464 |
| | | | | (3.047) | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | BNP Paribas | 723 |
| | | | | (886) | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | Citibank | 119 |
| | | | | (19.024) | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | Goldam Sachs | 4.514 |
| | | | | (3.778) | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | HSBC | (1.375) |
| | | | | (1.531) | Keyera Corp | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (569) |
| | | | | (1.369) | Keyera Corp | BNP Paribas | (509) |
| | | | | (930) | Keyera Corp | Citibank | (662) |
| | | | | (480) | Keyera Corp | Goldam Sachs | (178) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|---------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|
| Kanada Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| 32.544 | Kinross Gold Corp | Bank of America | | (402) | Restaurant Brands International Inc | Goldam Sachs | 118 |
| (645) | Lightspeed Commerce Inc | Merrill Lynch | 5.920 | (882) | Restaurant Brands International Inc | HSBC | (14) |
| (1.280) | Lightspeed Commerce Inc | Bank of America | (3.872) | (497) | Restaurant Brands International Inc | JP Morgan | (8) |
| (2.697) | Lightspeed Commerce Inc | Merrill Lynch | (7.684) | 318 | Ritchie Bros Auctioneers Inc | Bank of America | (1.210) |
| (933) | Lightspeed Commerce Inc | BNP Paribas | (16.190) | 169 | Ritchie Bros Auctioneers Inc | Merrill Lynch | (643) |
| 1.006 | Loblaws Cos Ltd | Goldam Sachs | (7.040) | 377 | Ritchie Bros Auctioneers Inc | BNP Paribas | (1.434) |
| 391 | Loblaws Cos Ltd | HSBC | | (1.607) | Rogers Communications Inc 'B' | Goldam Sachs | |
| 1.295 | Loblaws Cos Ltd | Bank of America | 1.766 | (2.743) | Rogers Communications Inc 'B' | BNP Paribas | (64) |
| 1.304 | Lundin Mining Corp | Merrill Lynch | 687 | (2.743) | Rogers Communications Inc 'B' | Goldam Sachs | (108) |
| | | Citibank | 2.274 | 562 | Royal Bank of Canada | BNP Paribas | 2.182 |
| 1.355 | Lundin Mining Corp | Goldam Sachs | (176) | 1.351 | Royal Bank of Canada | Goldam Sachs | 5.246 |
| 2.438 | Magna International Inc | Merrill Lynch | 289 | (4.388) | Saputo Inc | Bank of America | |
| 14.665 | Manulife Financial Corp | BNP Paribas | 8.774 | | Shaw Communications Inc 'B' | Merrill Lynch | 1.839 |
| | | Bank of America | 8.351 | 4.054 | Shaw Communications Inc 'B' | BNP Paribas | 3.928 |
| 385 | Manulife Financial Corp | Merrill Lynch | 219 | (138) | Shopify Inc 'A' | Bank of America | (789) |
| 5.820 | Manulife Financial Corp | BNP Paribas | 3.544 | (254) | Shopify Inc 'A' | Merrill Lynch | (1.452) |
| 745 | Manulife Financial Corp | Citibank | 424 | (101) | Shopify Inc 'A' | Goldam Sachs | (2.708) |
| 1.490 | Manulife Financial Corp | Goldam Sachs | (1.544) | (138) | Shopify Inc 'A' | HSBC | (1.932) |
| 2.576 | Manulife Financial Corp | HSBC | (2.669) | (232) | Sun Life Financial Inc | BNP Paribas | (50) |
| (823) | Metro Inc | JP Morgan | 872 | (480) | Sun Life Financial Inc | Citibank | 524 |
| 759 | National Bank of Canada | Goldam Sachs | 3.548 | (1.021) | Sun Life Financial Inc | Goldam Sachs | (218) |
| | | Bank of America | 2.753 | (4.369) | TC Energy Corp | Bank of America | (3.490) |
| 589 | National Bank of Canada | Merrill Lynch | 1.880 | (1.298) | TC Energy Corp | Merrill Lynch | (1.037) |
| 982 | National Bank of Canada | BNP Paribas | 8.704 | (1.400) | TC Energy Corp | BNP Paribas | (1.037) |
| 1.862 | National Bank of Canada | Citibank | 2.028 | (887) | TELUS Corp | Citibank | 642 |
| 345 | National Bank of Canada | Goldam Sachs | 121 | | TELUS Corp | Bank of America | 126 |
| (545) | Northland Power Inc | Merrill Lynch | 1.727 | (3.304) | TELUS Corp | Merrill Lynch | 470 |
| | | BNP Paribas | 740 | (1.599) | TELUS Corp | BNP Paribas | 177 |
| (7.799) | Northland Power Inc | Goldam Sachs | (805) | 1.022 | TFI International Inc | BNP Paribas | (622) |
| (3.342) | Northland Power Inc | HSBC | (313) | (194) | Thomson Reuters Corp | Bank of America | (122) |
| (519) | Nutrien Ltd | JP Morgan | (283) | (637) | Thomson Reuters Corp | Merrill Lynch | (494) |
| (202) | Nutrien Ltd | Bank of America | 278 | 675 | TMX Group Ltd | Goldam Sachs | 486 |
| 285 | Nuvei Corp | Merrill Lynch | 456 | 315 | TMX Group Ltd | BNP Paribas | 227 |
| | | Bank of America | 3.012 | 285 | TMX Group Ltd | Goldam Sachs | 205 |
| 168 | Onex Corp | Citibank | 1.952 | 860 | Toromont Industries Ltd | Bank of America | 340 |
| 157 | Onex Corp | Goldam Sachs | 11.417 | 760 | Toromont Industries Ltd | Merrill Lynch | 301 |
| 1.822 | Onex Corp | BNP Paribas | 2.605 | 457 | Toromont Industries Ltd | BNP Paribas | 846 |
| 786 | Onex Corp | Goldam Sachs | 2.478 | 236 | Toromont Industries Ltd | Goldam Sachs | 93 |
| 5.386 | Open Text Corp | HSBC | 5.892 | 279 | Toromont Industries Ltd | HSBC | 651 |
| | | JP Morgan | (2.923) | (171) | Toronto-Dominion Bank | BNP Paribas | (548) |
| 1.229 | Open Text Corp | Bank of America | (455) | (897) | Tourmaline Oil Corp | BNP Paribas | (6.520) |
| 1.169 | Open Text Corp | Merrill Lynch | 709 | (53) | Tourmaline Oil Corp | Citibank | (150) |
| 1.005 | Open Text Corp | BNP Paribas | 6.579 | 443 | West Fraser Timber Co Ltd | Bank of America | 920 |
| 3.225 | Open Text Corp | Goldam Sachs | 974 | 223 | West Fraser Timber Co Ltd | Merrill Lynch | (186) |
| (9.989) | Pan American Silver Corp | HSBC | 1.568 | 113 | West Fraser Timber Co Ltd | BNP Paribas | 473 |
| | | JP Morgan | (2.589) | 470 | West Fraser Timber Co Ltd | Citibank | (877) |
| (1.555) | Pan American Silver Corp | Bank of America | (2.741) | 134 | West Fraser Timber Co Ltd | HSBC | (250) |
| 1.031 | Parkland Corp | Merrill Lynch | (794) | 1.467 | Wheaton Precious Metals Corp | BNP Paribas | 2.611 |
| 6.990 | Parkland Corp | BNP Paribas | (860) | 772 | Wheaton Precious Metals Corp | BNP Paribas | (812) |
| 405 | Parkland Corp | Citibank | (11) | 2.256 | Wheaton Precious Metals Corp | Citibank | (812) |
| 652 | Parkland Corp | Goldam Sachs | (878) | 675 | Wheaton Precious Metals Corp | Goldam Sachs | 4.015 |
| (2.661) | Pembina Pipeline Corp | HSBC | 274 | | Wheaton Precious Metals Corp | HSBC | (1.009) |
| | | JP Morgan | 416 | | | | |
| (2.818) | Pembina Pipeline Corp | Bank of America | (2.589) | | | | |
| (1.154) | Pembina Pipeline Corp | Merrill Lynch | (2.741) | | | | |
| (2.652) | Quebecor Inc 'B' | BNP Paribas | (794) | | | | |
| (1.421) | Quebecor Inc 'B' | Citibank | (860) | | | | |
| (2.707) | Quebecor Inc 'B' | Goldam Sachs | (11) | | | | |
| (935) | Restaurant Brands International Inc | HSBC | (878) | | | | |
| (1.421) | Restaurant Brands International Inc | Bank of America | 274 | | | | |
| (147) | Restaurant Brands International Inc | Merrill Lynch | 416 | | | | |
| | | BNP Paribas | (207) | | | | |
| | | Citibank | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|------------------------------|-----------------|---|-------------------|-----------------------|-----------------|---|
| Kanada Fortsetzung | | | | Finnland | | | |
| 1.474 | Wheaton Precious Metals Corp | JP Morgan | (2.203) | 570 | Elisa Oyj | Bank of America | |
| 233 | WSP Global Inc | Citibank | 529 | 742 | Elisa Oyj | Merrill Lynch | (659) |
| | | | (50.379) | 1.260 | Elisa Oyj | Barclays Bank | (636) |
| | | | | 232 | Elisa Oyj | BNP Paribas | (1.458) |
| Kaimaninseln | | | | 674 | Elisa Oyj | Goldam Sachs | (268) |
| (70) | Sea Ltd ADR | Barclays Bank | (558) | 410 | Elisa Oyj | HSBC | (375) |
| (2.097) | Sea Ltd ADR | BNP Paribas | (31.224) | 410 | Elisa Oyj | JP Morgan | (228) |
| (282) | Sea Ltd ADR | Goldam Sachs | (4.199) | (4.987) | Fortum Oyj | Barclays Bank | 1.015 |
| (167) | Sea Ltd ADR | HSBC | (3.440) | (4.350) | Fortum Oyj | BNP Paribas | (1.747) |
| | | | (39.421) | (1.625) | Fortum Oyj | Citibank | 331 |
| | | | | (4.863) | Fortum Oyj | Goldam Sachs | (1.954) |
| Dänemark | | | | 1.720 | Kesko Oyj 'B' | Barclays Bank | (2.598) |
| (4.328) | Ambu A/S 'B' | Barclays Bank | (337) | 7.355 | Kesko Oyj 'B' | BNP Paribas | (17.964) |
| (5.119) | Ambu A/S 'B' | BNP Paribas | (6.442) | 969 | Kesko Oyj 'B' | Goldam Sachs | (2.367) |
| (4.353) | Ambu A/S 'B' | Goldam Sachs | (5.478) | (959) | Kone Oyj 'B' | Barclays Bank | (2.209) |
| 49 | AP Moller - Maersk A/S 'B' | BNP Paribas | 1.835 | (1.050) | Kone Oyj 'B' | BNP Paribas | (4.499) |
| 25 | AP Moller - Maersk A/S 'B' | HSBC | 1.728 | (148) | Kone Oyj 'B' | Citibank | (341) |
| (273) | Carlsberg A/S 'B' | Citibank | (1.085) | (136) | Kone Oyj 'B' | Goldam Sachs | (583) |
| (2.904) | Chr Hansen Holding A/S | BNP Paribas | 2.844 | (296) | Kone Oyj 'B' | HSBC | (1.728) |
| 661 | Coloplast A/S 'B' | Barclays Bank | 476 | 2.955 | Neste Oyj | BNP Paribas | 8.800 |
| 2.508 | Coloplast A/S 'B' | BNP Paribas | (9.968) | 198 | Neste Oyj | HSBC | 912 |
| 100 | Coloplast A/S 'B' | Goldam Sachs | (397) | 1.931 | Nokia Oyj | Bank of America | |
| 665 | Danske Bank A/S | Barclays Bank | 177 | 2.336 | Nokia Oyj | Merrill Lynch | 8 |
| 726 | Danske Bank A/S | BNP Paribas | 523 | 1.892 | Nokia Oyj | Barclays Bank | 176 |
| 619 | Danske Bank A/S | Citibank | 165 | 2.110 | Nokia Oyj | Goldam Sachs | 8 |
| 897 | Danske Bank A/S | Goldam Sachs | 646 | 1.784 | Orion Oyj 'B' | HSBC | 340 |
| 2.155 | Danske Bank A/S | HSBC | 2.777 | 88 | Orion Oyj 'B' | BNP Paribas | 2.828 |
| (1.120) | Demant A/S | Bank of America | | (518) | Sampo Oyj 'A' | HSBC | 268 |
| | | Merrill Lynch | (1.758) | (626) | Sampo Oyj 'A' | Bank of America | |
| (1.254) | Demant A/S | Barclays Bank | (3.323) | (756) | Sampo Oyj 'A' | Merrill Lynch | 2.253 |
| (972) | Demant A/S | BNP Paribas | (1.526) | 1.565 | Stora Enso Oyj 'R' | Barclays Bank | (148) |
| (484) | Demant A/S | Goldam Sachs | (760) | 4.053 | Stora Enso Oyj 'R' | BNP Paribas | 3.288 |
| (194) | Demant A/S | HSBC | (782) | 2.609 | Stora Enso Oyj 'R' | Bank of America | |
| (253) | Demant A/S | JP Morgan | (1.020) | 4.011 | Stora Enso Oyj 'R' | Merrill Lynch | 754 |
| 84 | DSV PANALPINA A/S | Bank of America | | 1.719 | Stora Enso Oyj 'R' | Barclays Bank | (1.085) |
| | | Merrill Lynch | 641 | 1.597 | Stora Enso Oyj 'R' | BNP Paribas | 1.258 |
| 515 | DSV PANALPINA A/S | Barclays Bank | 1.112 | (1.752) | UPM-Kymmene Oyj | Goldam Sachs | 1.934 |
| 548 | DSV PANALPINA A/S | BNP Paribas | 4.182 | (3.231) | Wartsila Oyj Abp | HSBC | 856 |
| 63 | DSV PANALPINA A/S | Goldam Sachs | 481 | | | JP Morgan | 796 |
| 57 | DSV PANALPINA A/S | HSBC | 767 | | | Goldam Sachs | (2.290) |
| 470 | Genmab A/S | BNP Paribas | 288 | | | BNP Paribas | (2.049) |
| 102 | Genmab A/S | Goldam Sachs | 147 | | | | (19.361) |
| 67 | Genmab A/S | HSBC | 186 | Frankreich | | | |
| (416) | GN Store Nord A/S | Bank of America | | (2.447) | Accor SA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.881) | (7.933) | Accor SA | Merrill Lynch | 734 |
| (2.256) | GN Store Nord A/S | Barclays Bank | (13.806) | (1.945) | Accor SA | Goldam Sachs | 2.380 |
| (802) | GN Store Nord A/S | BNP Paribas | (3.626) | (1.407) | Aeroports de Paris | HSBC | (3.688) |
| (179) | GN Store Nord A/S | Citibank | (1.095) | (11) | Aeroports de Paris | Barclays Bank | 1.959 |
| (1.107) | GN Store Nord A/S | Goldam Sachs | (5.005) | (35) | Aeroports de Paris | Goldam Sachs | (81) |
| 4.049 | Novo Nordisk A/S 'B' | BNP Paribas | 19.357 | (1.995) | Air Liquide SA | HSBC | (291) |
| 6.212 | Novozymes A/S 'B' | BNP Paribas | 6.262 | (279) | Air Liquide SA | Barclays Bank | 727 |
| (115) | Orsted A/S | Bank of America | | (413) | Air Liquide SA | Goldam Sachs | (765) |
| | | Merrill Lynch | (1.058) | (1.483) | Alstom SA | HSBC | (2.416) |
| (665) | Orsted A/S | Barclays Bank | (910) | (2.462) | Alstom SA | Bank of America | |
| (896) | Orsted A/S | BNP Paribas | (8.245) | (394) | Alstom SA | Merrill Lynch | (3.876) |
| (236) | Orsted A/S | Citibank | (323) | (703) | Alstom SA | Barclays Bank | (2.506) |
| (26) | Orsted A/S | Goldam Sachs | (239) | (3.146) | Alstom SA | Citibank | (401) |
| (358) | Orsted A/S | HSBC | (4.665) | 286 | Amundi SA | Goldam Sachs | (1.838) |
| 935 | Pandora A/S | BNP Paribas | 700 | | | HSBC | (8.493) |
| 205 | Pandora A/S | Goldam Sachs | 153 | | | Bank of America | |
| (348) | ROCKWOOL A/S 'B' | Barclays Bank | (2.781) | | | Merrill Lynch | (184) |
| (163) | ROCKWOOL A/S 'B' | BNP Paribas | (3.345) | 274 | Amundi SA | Barclays Bank | 704 |
| (8.655) | Tryg A/S | BNP Paribas | (6.730) | 288 | Amundi SA | Goldam Sachs | (185) |
| (937) | Tryg A/S | Citibank | (702) | 725 | Amundi SA | HSBC | 738 |
| (1.911) | Vestas Wind Systems A/S | Barclays Bank | (4.254) | 670 | Arkema SA | Bank of America | |
| (7.860) | Vestas Wind Systems A/S | BNP Paribas | (33.909) | 433 | Arkema SA | Merrill Lynch | (3.194) |
| | | | (80.003) | | | Barclays Bank | (348) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|--|-----------------|---|-------------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|
| Frankreich Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | | |
| 321 | Arkema SA | Citibank | (258) | 22 | Hermes International | Bank of America | |
| 87 | Arkema SA | Goldam Sachs | (415) | | | Merrill Lynch | 778 |
| 1.352 | Arkema SA | HSBC | (217) | 101 | Hermes International | Barclays Bank | 6.329 |
| 125 | Arkema SA | JP Morgan | (20) | 15 | Hermes International | Citibank | 940 |
| (6.645) | AXA SA | Goldam Sachs | (2.598) | 7 | Hermes International | Goldam Sachs | 247 |
| 177 | BioMerieux | Bank of America | | 9 | Hermes International | HSBC | 800 |
| | | Merrill Lynch | 1.707 | 1.677 | Ipsen SA | HSBC | 2.335 |
| 579 | BioMerieux | Barclays Bank | 4.391 | 54 | Kering SA | Barclays Bank | 2.817 |
| 600 | BioMerieux | Goldam Sachs | 5.785 | 25 | Kering SA | Citibank | 1.304 |
| 1.102 | BioMerieux | HSBC | 11.215 | 86 | Kering SA | Goldam Sachs | 3.957 |
| 1.091 | BNP Paribas SA | HSBC | 3.985 | 142 | La Francaise des Jeux SAEM | Bank of America | |
| (8.348) | Bollore SE | Barclays Bank | (429) | | | Merrill Lynch | (99) |
| (3.525) | Bollore SE | Citibank | (181) | 71 | La Francaise des Jeux SAEM | Barclays Bank | (36) |
| (5.042) | Bollore SE | Goldam Sachs | (1.037) | 43 | La Francaise des Jeux SAEM | Citibank | (22) |
| (2.342) | Bouygues SA | Goldam Sachs | (1.179) | 258 | La Francaise des Jeux SAEM | Goldam Sachs | (180) |
| (3.572) | Bouygues SA | HSBC | (5.855) | 7.006 | La Francaise des Jeux SAEM | HSBC | 16.962 |
| 2.035 | Bureau Veritas SA | Goldam Sachs | 480 | (65) | Legrand SA | JP Morgan | 4.510 |
| 1.657 | Bureau Veritas SA | HSBC | 2.379 | (270) | Legrand SA | Barclays Bank | (70) |
| 389 | Capgemini SE | HSBC | 1.604 | (362) | L'Oreal SA | HSBC | (914) |
| (623) | Carrefour SA | Citibank | 390 | (163) | L'Oreal SA | Bank of America | |
| (558) | Carrefour SA | Goldam Sachs | 1.432 | (33) | L'Oreal SA | Merrill Lynch | (1.319) |
| (2.753) | Carrefour SA | HSBC | 5.382 | (60) | L'Oreal SA | Barclays Bank | (2.863) |
| 1.730 | Cie de Saint-Gobain | HSBC | 6.449 | (35) | L'Oreal SA | Citibank | (546) |
| (73) | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | Barclays Bank | (285) | (129) | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | Goldam Sachs | (80) |
| (948) | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | Goldam Sachs | (762) | (35) | L'Oreal SA | HSBC | (28) |
| (260) | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | HSBC | (2.200) | (16) | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | Citibank | (5.099) |
| (3.604) | Credit Agricole SA | Citibank | 1.691 | (20) | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | Goldam Sachs | (391) |
| (656) | Danone SA | HSBC | 780 | 7.671 | Orange SA | HSBC | (1.183) |
| 962 | Dassault Systemes SE | Barclays Bank | 881 | | | Bank of America | |
| 1.075 | Dassault Systemes SE | Goldam Sachs | 1.710 | 19.014 | Orange SA | Merrill Lynch | (625) |
| 2.973 | Dassault Systemes SE | HSBC | 5.319 | 3.021 | Orange SA | Barclays Bank | (1.018) |
| 197 | Dassault Systemes SE | JP Morgan | 352 | 12.128 | Orange SA | Citibank | (162) |
| 544 | Edenred | Goldam Sachs | 659 | 15.239 | Orange SA | Goldam Sachs | (987) |
| 228 | Edenred | JP Morgan | 352 | 4.070 | Orange SA | HSBC | 65 |
| 138 | Eiffage SA | Bank of America | | (2.972) | Orpea SA | JP Morgan | 17 |
| | | Merrill Lynch | 151 | 171 | Pernod Ricard SA | HSBC | 15.600 |
| 346 | Eiffage SA | Barclays Bank | 230 | | | Bank of America | |
| 104 | Eiffage SA | Citibank | 69 | 607 | Pernod Ricard SA | Merrill Lynch | (1.493) |
| 754 | Eiffage SA | Goldam Sachs | 824 | 187 | Pernod Ricard SA | Barclays Bank | 415 |
| 104 | Eiffage SA | HSBC | 40 | 128 | Pernod Ricard SA | Citibank | 174 |
| 166 | Eiffage SA | JP Morgan | (256) | 2.589 | Publicis Groupe SA | Goldam Sachs | (5.300) |
| (4.776) | Electricite de France SA | Barclays Bank | 1.044 | 98 | Publicis Groupe SA | HSBC | 1.382 |
| (6.672) | Electricite de France SA | Goldam Sachs | 2.344 | 2.610 | Publicis Groupe SA | JP Morgan | 946 |
| 3.350 | Engie SA | Barclays Bank | (1.557) | 6.253 | Publicis Groupe SA | Barclays Bank | (8.875) |
| 5.263 | Engie SA | Goldam Sachs | 4.499 | 799 | Publicis Groupe SA | Citibank | (336) |
| (118) | EssilorLuxottica SA | Bank of America | | (1.089) | Remy Cointreau SA | Goldam Sachs | (11.240) |
| | | Merrill Lynch | (63) | (40) | Renault SA | HSBC | (9.110) |
| (392) | EssilorLuxottica SA | Barclays Bank | (357) | (4.080) | Renault SA | JP Morgan | (1.164) |
| (176) | EssilorLuxottica SA | Goldam Sachs | (94) | (3.685) | Renault SA | HSBC | (10.266) |
| (71) | EssilorLuxottica SA | HSBC | 156 | 708 | Sanofi | Barclays Bank | (3.603) |
| (550) | EssilorLuxottica SA | JP Morgan | 1.208 | 286 | Sanofi | HSBC | 763 |
| 4.249 | Eurazeo SE | HSBC | 27.310 | (38) | Sartorius Stedim Biotech | Bank of America | |
| (146) | Eurofins Scientific SE | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (957) |
| | | Merrill Lynch | (369) | (241) | Sartorius Stedim Biotech | Goldam Sachs | (6.067) |
| (982) | Eurofins Scientific SE | Barclays Bank | (2.167) | (25) | Sartorius Stedim Biotech | HSBC | (1.050) |
| (141) | Eurofins Scientific SE | Citibank | (311) | (832) | Schneider Electric SE | Bank of America | |
| (195) | Eurofins Scientific SE | Goldam Sachs | (493) | (315) | Schneider Electric SE | Merrill Lynch | (1.426) |
| (1.335) | Eurofins Scientific SE | HSBC | (3.175) | | | Barclays Bank | (567) |
| (1.952) | Euronext NV | Goldam Sachs | (14.721) | | | | |
| (2.786) | Faurecia SE | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (10.565) | | | | |
| (1.673) | Faurecia SE | Barclays Bank | (3.835) | | | | |
| (4.336) | Faurecia SE | HSBC | (26.406) | | | | |
| (2.443) | Getlink SE | Barclays Bank | 916 | | | | |
| (1.638) | Getlink SE | Goldam Sachs | (544) | | | | |
| (21.129) | Getlink SE | HSBC | (21.050) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|------------------------------------|-----------------|---|--------------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|
| Frankreich Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| (917) | Schneider Electric SE | Goldam Sachs | (1.572) | (274) | Bechtle AG | Goldam Sachs | (302) |
| (212) | Schneider Electric SE | HSBC | (1.662) | 161 | Beiersdorf AG | Bank of America | |
| 207 | SEB SA | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (48) |
| | | Merrill Lynch | (1.020) | 533 | Beiersdorf AG | Barclays Bank | 11 |
| 108 | SEB SA | Barclays Bank | (185) | 253 | Beiersdorf AG | BNP Paribas | (76) |
| 33 | SEB SA | Citibank | (57) | 212 | Beiersdorf AG | Citibank | 5 |
| 347 | SEB SA | HSBC | (2.267) | 467 | Beiersdorf AG | Goldam Sachs | (140) |
| 920 | Societe Generale SA | HSBC | 3.016 | 183 | Beiersdorf AG | HSBC | 1.274 |
| (263) | Sodexo SA | HSBC | 621 | 507 | Beiersdorf AG | JP Morgan | 3.530 |
| 363 | STMicroelectronics NV | Bank of America | | 77 | Brenntag SE | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 78 | | | Merrill Lynch | 180 |
| 1.590 | STMicroelectronics NV | Barclays Bank | 852 | 802 | Brenntag SE | Barclays Bank | 687 |
| 444 | STMicroelectronics NV | Citibank | 238 | 644 | Brenntag SE | BNP Paribas | 1.504 |
| 1.041 | STMicroelectronics NV | Goldam Sachs | 223 | 635 | Brenntag SE | Goldam Sachs | 1.483 |
| 1.365 | STMicroelectronics NV | HSBC | 5.769 | 247 | Brenntag SE | HSBC | 1.773 |
| 187 | Teleperformance | Barclays Bank | 581 | 164 | Brenntag SE | JP Morgan | 1.177 |
| 203 | Teleperformance | Goldam Sachs | (413) | 327 | Carl Zeiss Meditec AG | Goldam Sachs | 1.699 |
| 484 | Teleperformance | HSBC | 2.230 | 88 | Carl Zeiss Meditec AG | JP Morgan | 297 |
| (434) | TotalEnergies SE | Goldam Sachs | (1.776) | (11.125) | Commerzbank AG | BNP Paribas | (18.544) |
| (28) | Ubisoft Entertainment SA | Goldam Sachs | (131) | (2.796) | Continental AG | BNP Paribas | (18.630) |
| (1.438) | Ubisoft Entertainment SA | HSBC | (7.024) | 1.969 | Covestro AG | Barclays Bank | 3.101 |
| (12.008) | Universal Music Group BV | BNP Paribas | (8.233) | 2.698 | Covestro AG | BNP Paribas | 8.237 |
| (886) | Universal Music Group BV | Goldam Sachs | (607) | 178 | Covestro AG | Citibank | 280 |
| (1.108) | Universal Music Group BV | HSBC | (1.183) | 272 | Covestro AG | Goldam Sachs | 830 |
| (1.774) | Valeo SA | Bank of America | | (1.140) | Daimler Truck Holding AG | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (4.817) | | | Merrill Lynch | (2.626) |
| (854) | Veolia Environnement SA | Bank of America | | (2.288) | Daimler Truck Holding AG | Barclays Bank | (1.667) |
| | | Merrill Lynch | (549) | (461) | Daimler Truck Holding AG | BNP Paribas | (1.062) |
| (2.166) | Veolia Environnement SA | Barclays Bank | (557) | (703) | Daimler Truck Holding AG | Citibank | (512) |
| (755) | Veolia Environnement SA | Goldam Sachs | (485) | (2.285) | Daimler Truck Holding AG | Goldam Sachs | (5.263) |
| (1.086) | Veolia Environnement SA | HSBC | (1.338) | (798) | Daimler Truck Holding AG | HSBC | (2.752) |
| (709) | Veolia Environnement SA | JP Morgan | (873) | (522) | Delivery Hero SE | Bank of America | |
| (744) | Vinci SA | Barclays Bank | (104) | | | Merrill Lynch | (3.355) |
| (258) | Vinci SA | Citibank | (36) | (1.421) | Delivery Hero SE | BNP Paribas | (9.133) |
| 3.102 | Vivendi SE | Bank of America | | (79) | Delivery Hero SE | Citibank | (506) |
| | | Merrill Lynch | 66 | 2.926 | Deutsche Bank AG Reg | BNP Paribas | 3.896 |
| 7.525 | Vivendi SE | Barclays Bank | (766) | 995 | Deutsche Bank AG Reg | Citibank | 473 |
| 6.031 | Vivendi SE | Citibank | (614) | 1.386 | Deutsche Boerse AG | BNP Paribas | (9.428) |
| 6.645 | Vivendi SE | Goldam Sachs | 142 | (16.152) | Deutsche Lufthansa AG | | |
| 2.544 | Vivendi SE | JP Morgan | 26 | | Reg | Barclays Bank | 1.782 |
| 2.580 | Wendel SE | Barclays Bank | 15.339 | (11.544) | Deutsche Lufthansa AG | | |
| (342) | Worldline SA | Bank of America | | | Reg | BNP Paribas | (1.286) |
| | | Merrill Lynch | (747) | 749 | Deutsche Post AG Reg | Barclays Bank | 132 |
| (935) | Worldline SA | Barclays Bank | (120) | 13.851 | Deutsche Post AG Reg | BNP Paribas | (3.116) |
| (77) | Worldline SA | Citibank | (10) | 4.439 | Deutsche Post AG Reg | Goldam Sachs | (999) |
| (850) | Worldline SA | Goldam Sachs | (1.858) | 1.897 | Deutsche Post AG Reg | HSBC | 4.054 |
| (3.503) | Worldline SA | HSBC | (9.119) | 208 | Deutsche Post AG Reg | JP Morgan | 445 |
| | | | (81.282) | (6.043) | Deutsche Telekom AG Reg | Barclays Bank | (3.923) |
| | | | | (5.847) | Deutsche Telekom AG Reg | BNP Paribas | (6.376) |
| | | | | (2.144) | Deutsche Telekom AG Reg | Citibank | (1.392) |
| | | | | 12.412 | E.ON SE | BNP Paribas | (6.037) |
| | | | | 10.230 | E.ON SE | Goldam Sachs | (4.975) |
| | | | | 950 | Evonik Industries AG | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (570) |
| (300) | adidas AG | Bank of America | | 1.595 | Evonik Industries AG | Barclays Bank | (1.042) |
| | | Merrill Lynch | (1.543) | 3.767 | Evonik Industries AG | BNP Paribas | (2.260) |
| (557) | adidas AG | Barclays Bank | (5.597) | 301 | Evonik Industries AG | Citibank | (197) |
| (329) | adidas AG | BNP Paribas | (1.692) | 292 | Evonik Industries AG | Goldam Sachs | (175) |
| (182) | adidas AG | Goldam Sachs | (936) | 348 | Evonik Industries AG | HSBC | 93 |
| (84) | Adidas AG | Citibank | (844) | 283 | Evonik Industries AG | JP Morgan | 76 |
| 126 | Allianz SE Reg | BNP Paribas | (545) | (282) | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | Bank of America | |
| (3.529) | Aroundtown SA | Barclays Bank | 1.671 | | & Co KGaA | Merrill Lynch | 30 |
| (9.547) | Aroundtown SA | BNP Paribas | 3.477 | (2.895) | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | Barclays Bank | (2.357) |
| (1.795) | Aroundtown SA | HSBC | 219 | (1.725) | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | BNP Paribas | 185 |
| 181 | BASF SE | Goldam Sachs | (80) | (626) | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | Citibank | (510) |
| (188) | Bayerische Motoren Werke AG (Pref) | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (816) | | | | |
| (1.166) | Bayerische Motoren Werke AG (Pref) | BNP Paribas | (5.059) | | | | |
| (143) | Bechtle AG | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (158) | | | | |
| (493) | Bechtle AG | BNP Paribas | (544) | | | | |
| (148) | Bechtle AG | Citibank | (21) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|---|---------------------------|---|-------------------------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Irland Fortsetzung | | | |
| (19.500) | Budweiser Brewing Co | | | (668) | Kingspan Group Plc | Barclays Bank | (2.934) |
| | APAC Ltd | Goldam Sachs | (3.007) | (594) | Kingspan Group Plc | BNP Paribas | (1.120) |
| (5.200) | Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (530) | (109) | Kingspan Group Plc | HSBC | (23) |
| 66.500 | CK Asset Holdings Ltd | HSBC | (29.237) | (170) | Kingspan Group Plc | JP Morgan | (36) |
| (4.000) | CK Hutchison Holdings Ltd | Goldam Sachs | (535) | 245 | Smurfit Kappa Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 178 |
| (1.500) | CK Infrastructure Holdings Ltd | Goldam Sachs | 507 | 579 | Smurfit Kappa Group Plc | Barclays Bank | 980 |
| (9.600) | ESR Cayman Ltd | Goldam Sachs | (367) | 430 | Smurfit Kappa Group Plc | BNP Paribas | 313 |
| (6.000) | Galaxy Entertainment Group Ltd | BNP Paribas | (1.019) | 1.462 | Smurfit Kappa Group Plc | Citibank | 2.475 |
| (7.000) | Galaxy Entertainment Group Ltd | Citibank | (669) | 306 | Smurfit Kappa Group Plc | Goldam Sachs | 223 |
| (28.000) | Galaxy Entertainment Group Ltd | Goldam Sachs | (178) | 309 | Smurfit Kappa Group Plc | JP Morgan | (7) |
| (13.000) | Hang Lung Properties Ltd | Goldam Sachs | (431) | Israel | | | |
| (1.300) | Hang Seng Bank Ltd | HSBC | 447 | 6.662 | Bank Hapoalim BM | Bank of America Merrill Lynch | 1.438 |
| 112.000 | Henderson Land Development Co Ltd | Goldam Sachs | 22.123 | 9.527 | Bank Hapoalim BM | Barclays Bank | (400) |
| (141.000) | HKT Trust & HKT Ltd (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | 8.265 | 6.041 | Bank Hapoalim BM | Goldam Sachs | 887 |
| (258.900) | Hong Kong & China Gas Co Ltd | Barclays Bank | (8.578) | 1.676 | Bank Leumi Le-Israel BM | Barclays Bank | (302) |
| (900) | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | Goldam Sachs | (1.491) | 4.691 | Bank Leumi Le-Israel BM | Goldam Sachs | (183) |
| (102.452) | MTR Corp Ltd | Barclays Bank | 15.014 | 52 | Elbit Systems Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (422) |
| 13.000 | New World Development Co Ltd | Barclays Bank | 828 | (1.298) | Fiverr International Ltd | BNP Paribas | (7.022) |
| 28.000 | New World Development Co Ltd | Goldam Sachs | 3.925 | 50.981 | Israel Discount Bank Ltd 'A' | Goldam Sachs | 764 |
| 15.000 | New World Development Co Ltd | HSBC | 2.581 | 111 | Nice Ltd | Barclays Bank | 799 |
| 2.000 | New World Development Co Ltd | JP Morgan | 344 | Italien | | | |
| (28.800) | Sands China Ltd | Goldam Sachs | 2.496 | (895) | Amplifon SpA | BNP Paribas | 2.301 |
| (1) | Sisram Medical Ltd* | JP Morgan | — | 641 | Assicurazioni Generali SpA | Barclays Bank | (343) |
| 4.000 | SITC International Holdings Co Ltd | Citibank | 994 | 484 | Assicurazioni Generali SpA | Goldam Sachs | (459) |
| 35.500 | Sun Hung Kai Properties Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 7.238 | 456 | Assicurazioni Generali SpA | HSBC | (249) |
| 3.500 | Sun Hung Kai Properties Ltd | Goldam Sachs | 714 | 497 | Assicurazioni Generali SpA | JP Morgan | (272) |
| 2.000 | Sun Hung Kai Properties Ltd | HSBC | 1.440 | (8.512) | Atlantia SpA | Barclays Bank | (547) |
| 77.500 | Swire Pacific Ltd 'A' | HSBC | 38.023 | 2.987 | CNH Industrial NV | Bank of America Merrill Lynch | 304 |
| (104.200) | Swire Properties Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (4.249) | 804 | CNH Industrial NV | BNP Paribas | 82 |
| (44.000) | Swire Properties Ltd | Barclays Bank | 224 | (5.586) | Davide Campari-Milano NV | Citibank | (610) |
| (1.500) | Techtronic Industries Co Ltd | Goldam Sachs | (344) | (96) | DiaSorin SpA | BNP Paribas | (231) |
| (75.000) | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | Citibank | (3.823) | (65) | DiaSorin SpA | Goldam Sachs | (157) |
| (6.000) | Xinyi Glass Holdings Ltd | BNP Paribas | (1.590) | 27.360 | Enel SpA | BNP Paribas | 2.169 |
| (8.000) | Xinyi Glass Holdings Ltd | Goldam Sachs | (2.121) | 4.710 | Enel SpA | Goldam Sachs | 373 |
| (8.000) | Xinyi Glass Holdings Ltd | HSBC | (2.916) | 38.422 | Eni SpA | BNP Paribas | 20.003 |
| | | | 48.614 | 1.744 | EXOR NV | Barclays Bank | 3.811 |
| | | | | 1.355 | EXOR NV | BNP Paribas | 5.226 |
| | | | | 220 | Ferrari NV | BNP Paribas | 271 |
| | | | | 1.138 | FinecoBank Banca Fineco SpA | BNP Paribas | 829 |
| | | | | (1.237) | Infrastrutture Wireless Italiane SpA | Bank of America Merrill Lynch | (311) |
| | | | | (5.075) | Infrastrutture Wireless Italiane SpA | Barclays Bank | (1.033) |
| | | | | (43.427) | Infrastrutture Wireless Italiane SpA | BNP Paribas | (10.933) |
| | | | | (2.309) | Infrastrutture Wireless Italiane SpA | Citibank | (470) |
| | | | | 44.630 | Intesa Sanpaolo SpA | Goldam Sachs | 3.328 |
| | | | | (9.136) | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | BNP Paribas | 3.778 |
| (1.167) | CRH Plc | BNP Paribas | (1.931) | 988 | Moncler SpA | Bank of America Merrill Lynch | 243 |
| (576) | CRH Plc | Goldam Sachs | (953) | 456 | Moncler SpA | Barclays Bank | 1.138 |
| (526) | Flutter Entertainment Plc | Barclays Bank | (2.141) | 1.194 | Moncler SpA | BNP Paribas | 871 |
| (180) | Flutter Entertainment Plc | Citibank | (733) | 422 | Moncler SpA | Citibank | 1.499 |
| (177) | Flutter Entertainment Plc | Goldam Sachs | (1.792) | 905 | Moncler SpA | JP Morgan | 1.920 |
| (165) | Flutter Entertainment Plc | HSBC | (3.647) | (3.900) | Nexi SpA | Bank of America Merrill Lynch | (3.351) |
| 89 | Kerry Group Plc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (728) | (16.073) | Nexi SpA | Barclays Bank | (2.858) |
| 389 | Kerry Group Plc 'A' | BNP Paribas | (3.184) | (7.569) | Nexi SpA | BNP Paribas | (6.503) |
| 100 | Kerry Group Plc 'A' | Goldam Sachs | (818) | (3.386) | Nexi SpA | Goldam Sachs | (2.909) |
| 117 | Kerry Group Plc 'A' | JP Morgan | 105 | 790 | Poste Italiane SpA | Bank of America Merrill Lynch | 466 |
| (393) | Kingspan Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (741) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------------------------|--|-------------------------------|---|--------------------------|---------------------------------|-------------------------------|---|
| Italien Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 1.291 | Poste Italiane SpA | Barclays Bank | 546 | (600) | Brother Industries Ltd | HSBC | (390) |
| 12.181 | Poste Italiane SpA | BNP Paribas | 7.190 | (2.400) | Canon Inc | Barclays Bank | (708) |
| 860 | Poste Italiane SpA | Citibank | 364 | (4.500) | Canon Inc | BNP Paribas | (2.866) |
| 782 | Poste Italiane SpA | HSBC | 1.103 | (600) | Canon Inc | Citibank | (177) |
| 598 | Prysmian SpA | Citibank | 673 | (500) | Canon Inc | HSBC | (757) |
| (627) | Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA | Bank of America Merrill Lynch | — | 700 | Capcom Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.033 |
| (355) | Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA | Barclays Bank | 190 | 100 | Capcom Co Ltd | Barclays Bank | 66 |
| (299) | Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA | BNP Paribas | — | 600 | Capcom Co Ltd | HSBC | 1.281 |
| (222) | Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA | Goldam Sachs | — | (1.200) | Central Japan Railway Co | BNP Paribas | 5.079 |
| 12.336 | Snam SpA | BNP Paribas | 344 | (700) | Central Japan Railway Co | Goldam Sachs | 2.963 |
| 1.613 | Stellantis NV | Bank of America Merrill Lynch | 249 | (100) | Chiba Bank Ltd | Barclays Bank | 7 |
| 1.042 | Stellantis NV | Barclays Bank | 283 | (19.600) | Chiba Bank Ltd | Goldam Sachs | 5.175 |
| 9.562 | Stellantis NV | BNP Paribas | 1.475 | (2.100) | Chubu Electric Power Co Inc | Barclays Bank | 391 |
| 544 | Stellantis NV | Citibank | 148 | (2.500) | Chubu Electric Power Co Inc | BNP Paribas | 485 |
| 2.078 | Stellantis NV | Goldam Sachs | 321 | (2.800) | Chubu Electric Power Co Inc | Citibank | 522 |
| 1.797 | Stellantis NV | HSBC | 2.168 | (10.200) | Chubu Electric Power Co Inc | Goldam Sachs | 1.940 |
| 584 | Stellantis NV | JP Morgan | 704 | (2.100) | Chubu Electric Power Co Inc | HSBC | 538 |
| (8.626) | Terna Rete Elettrica Nazionale SpA | Barclays Bank | 1.072 | (2.900) | Chubu Electric Power Co Inc | JP Morgan | 743 |
| (1.651) | Terna Rete Elettrica Nazionale SpA | HSBC | (71) | 1.300 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (384) |
| (2.312) | UniCredit SpA | BNP Paribas | (2.883) | 8.400 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | Barclays Bank | (5.545) |
| | | | 31.252 | 1.700 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | BNP Paribas | (502) |
| | | | | 800 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | (528) |
| | Japan | | | 1.200 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | Goldam Sachs | (354) |
| 900 | Advantest Corp | Goldam Sachs | 2.237 | 100 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | (130) |
| (1.600) | Aeon Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 422 | 2.700 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | (3.523) |
| (7.300) | Aeon Co Ltd | Barclays Bank | (2.296) | (2.600) | Concordia Financial Group Ltd | Barclays Bank | 40 |
| (3.400) | Aeon Co Ltd | BNP Paribas | 898 | (3.600) | Concordia Financial Group Ltd | BNP Paribas | 252 |
| (3.900) | Aeon Co Ltd | Goldam Sachs | 709 | (300) | Cosmos Pharmaceutical Corp | Barclays Bank | (1.864) |
| (600) | Aeon Co Ltd | HSBC | 147 | (300) | Cosmos Pharmaceutical Corp | BNP Paribas | (2.446) |
| (900) | AGC Inc | Citibank | (245) | (100) | Cosmos Pharmaceutical Corp | Goldam Sachs | (815) |
| (800) | Aisin Corp | Barclays Bank | (1.367) | (100) | Cosmos Pharmaceutical Corp | HSBC | (730) |
| 500 | Ajinomoto Co Inc | Barclays Bank | (206) | (2.200) | CyberAgent Inc | BNP Paribas | (51) |
| 2.100 | Ajinomoto Co Inc | BNP Paribas | (261) | 400 | Dai Nippon Printing Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 106 |
| 1.700 | Ajinomoto Co Inc | Goldam Sachs | (211) | 1.900 | Dai Nippon Printing Co Ltd | Barclays Bank | 44 |
| 2.100 | Ajinomoto Co Inc | HSBC | 587 | 2.300 | Dai Nippon Printing Co Ltd | BNP Paribas | 607 |
| 100 | Ajinomoto Co Inc | JP Morgan | 28 | 900 | Dai Nippon Printing Co Ltd | Citibank | 21 |
| 1.100 | ANA Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 585 | 700 | Dai Nippon Printing Co Ltd | Goldam Sachs | 185 |
| 900 | Asahi Group Holdings Ltd | BNP Paribas | (2.418) | 2.600 | Dai Nippon Printing Co Ltd | HSBC | 3.897 |
| (2.400) | Asahi Intecc Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.305 | 600 | Dai Nippon Printing Co Ltd | JP Morgan | 899 |
| (2.900) | Asahi Intecc Co Ltd | Barclays Bank | 1.036 | (1.100) | Daifuku Co Ltd | BNP Paribas | 171 |
| (500) | Asahi Intecc Co Ltd | Goldam Sachs | 272 | (1.300) | Dai-ichi Life Holdings Inc | Goldam Sachs | (1.561) |
| 1.900 | Asahi Kasei Corp | Bank of America Merrill Lynch | 221 | (1.000) | Daichi Sankyo Co Ltd | BNP Paribas | (606) |
| 14.400 | Asahi Kasei Corp | Barclays Bank | (839) | (300) | Daikin Industries Ltd | Barclays Bank | (2.108) |
| 25.300 | Asahi Kasei Corp | BNP Paribas | 2.947 | (1.200) | Daikin Industries Ltd | BNP Paribas | 233 |
| 15.200 | Asahi Kasei Corp | Goldam Sachs | 1.771 | (100) | Daito Trust Construction Co Ltd | BNP Paribas | (140) |
| 2.800 | Asahi Kasei Corp | HSBC | (652) | (100) | Daito Trust Construction Co Ltd | Goldam Sachs | (140) |
| 3.100 | Asahi Kasei Corp | JP Morgan | (722) | | | | |
| 15.900 | Astellas Pharma Inc | BNP Paribas | 13.151 | | | | |
| (400) | Bandai Namco Holdings Inc | Barclays Bank | (1.218) | | | | |
| (900) | Bandai Namco Holdings Inc | BNP Paribas | (6.158) | | | | |
| (400) | Bandai Namco Holdings Inc | HSBC | (3.389) | | | | |
| (800) | Benefit One Inc | BNP Paribas | (814) | | | | |
| (1.900) | Bridgestone Corp | BNP Paribas | (3.581) | | | | |
| (400) | Bridgestone Corp | Citibank | (326) | | | | |
| (300) | Bridgestone Corp | HSBC | (746) | | | | |
| (600) | Brother Industries Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (666) | | | | |
| (2.500) | Brother Industries Ltd | BNP Paribas | (3.429) | | | | |
| (700) | Brother Industries Ltd | Goldam Sachs | (1.011) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------------|-----------------|---|--------------------------|------------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (200) | Daito Trust Construction Co Ltd | HSBC | 109 | 200 | Hoya Corp | BNP Paribas | 2.009 |
| 1.700 | Daiwa House Industry Co Ltd | BNP Paribas | 106 | 100 | Hoya Corp | Goldam Sachs | 827 |
| 9.200 | Daiwa Securities Group Inc | BNP Paribas | 800 | (12.400) | Hulic Co Ltd | Bank of America | (2.407) |
| 1.900 | Denso Corp | BNP Paribas | 7.215 | (17.800) | Hulic Co Ltd | Merrill Lynch | (553) |
| 3.800 | Dentsu Group Inc | BNP Paribas | (11.952) | 300 | Ibiden Co Ltd | BNP Paribas | 26 |
| 700 | Dentsu Group Inc | Goldam Sachs | (2.202) | 1.300 | Ibiden Co Ltd | HSBC | 375 |
| 300 | Dentsu Group Inc | HSBC | (1.002) | 800 | Idemitsu Kosan Co Ltd | Barclays Bank | 466 |
| 300 | Dentsu Group Inc | JP Morgan | (1.002) | 3.200 | Idemitsu Kosan Co Ltd | BNP Paribas | 2.112 |
| 100 | Disco Corp | HSBC | 3.184 | 2.400 | Idemitsu Kosan Co Ltd | Goldam Sachs | 1.584 |
| (1.400) | East Japan Railway Co | BNP Paribas | 54 | 900 | Idemitsu Kosan Co Ltd | JP Morgan | (804) |
| (2.400) | East Japan Railway Co | Goldam Sachs | 93 | (2.600) | Iida Group Holdings Co Ltd | BNP Paribas | (1.636) |
| 800 | Eisai Co Ltd | BNP Paribas | (1.764) | (1.400) | Iida Group Holdings Co Ltd | Citibank | (511) |
| 200 | Eisai Co Ltd | Goldam Sachs | (441) | (300) | Inpex Corp | Goldam Sachs | (881) |
| 300 | Eisai Co Ltd | JP Morgan | (552) | (7.900) | Inpex Corp | Barclays Bank | (394) |
| 64.300 | ENEOS Holdings Inc | Barclays Bank | 2.597 | (5.600) | Inpex Corp | BNP Paribas | (12.700) |
| (100) | FANUC Corp | BNP Paribas | (858) | (5.600) | Inpex Corp | Goldam Sachs | (9.002) |
| (100) | Fast Retailing Co Ltd | Barclays Bank | (1.165) | 5.100 | Isuzu Motors Ltd | Bank of America | (238) |
| (200) | Fast Retailing Co Ltd | BNP Paribas | (3.293) | 900 | Isuzu Motors Ltd | Merrill Lynch | (91) |
| 7.500 | Fuji Electric Co Ltd | Barclays Bank | 13.397 | 6.400 | Isuzu Motors Ltd | Barclays Bank | (298) |
| (200) | FUJIFILM Holdings Corp | Bank of America | (26) | 5.500 | Isuzu Motors Ltd | BNP Paribas | (256) |
| (800) | FUJIFILM Holdings Corp | Merrill Lynch | (770) | 2.200 | Isuzu Motors Ltd | HSBC | (444) |
| (1.300) | FUJIFILM Holdings Corp | Barclays Bank | (293) | (300) | Ito En Ltd | BNP Paribas | 676 |
| (1.200) | FUJIFILM Holdings Corp | BNP Paribas | (1.156) | 3.000 | ITOCHU Corp | BNP Paribas | 3.774 |
| (1.600) | FUJIFILM Holdings Corp | Citibank | (551) | (1.500) | ITOCHU Techno-Solutions Corp | Bank of America | (1.747) |
| 200 | Fujitsu Ltd | Goldam Sachs | 318 | (700) | Itchu Techno-Solutions Corp | Merrill Lynch | (1.747) |
| (1.800) | GMO Payment Gateway Inc | Goldam Sachs | 318 | (700) | Itchu Techno-Solutions Corp | Barclays Bank | 54 |
| (600) | GMO Payment Gateway Inc | Bank of America | (1.398) | (2.500) | Itchu Techno-Solutions Corp | Barclays Bank | 54 |
| (200) | GMO Payment Gateway Inc | Merrill Lynch | (419) | (900) | Itchu Techno-Solutions Corp | BNP Paribas | (2.912) |
| (100) | GMO Payment Gateway Inc | Barclays Bank | (155) | (400) | Itchu Techno-Solutions Corp | BNP Paribas | (2.912) |
| (200) | GMO Payment Gateway Inc | BNP Paribas | (70) | (400) | Itchu Techno-Solutions Corp | Citibank | 70 |
| (100) | GMO Payment Gateway Inc | Citibank | (155) | (400) | Itchu Techno-Solutions Corp | Citibank | 70 |
| 10.500 | Hakuhodo DY Holdings Inc | Goldam Sachs | (652) | (400) | Itchu Techno-Solutions Corp | Goldam Sachs | (466) |
| (300) | Hamamatsu Photonics KK | JP Morgan | (1.549) | (400) | Itchu Techno-Solutions Corp | Goldam Sachs | (466) |
| (600) | Hamamatsu Photonics KK | Barclays Bank | (722) | (700) | Japan Airlines Co Ltd | HSBC | (749) |
| (200) | Hamamatsu Photonics KK | Merrill Lynch | (513) | (3.200) | Japan Airlines Co Ltd | Barclays Bank | (549) |
| 2.200 | Hankyu Hanshin Holdings Inc | Barclays Bank | (481) | (3.600) | Japan Airlines Co Ltd | Goldam Sachs | (4.622) |
| 400 | Hankyu Hanshin Holdings Inc | Goldam Sachs | (1.538) | (3.600) | Japan Exchange Group Inc | Bank of America | (3.872) |
| 500 | Hankyu Hanshin Holdings Inc | Barclays Bank | 18 | (2.200) | Japan Exchange Group Inc | Merrill Lynch | (3.872) |
| 800 | Hankyu Hanshin Holdings Inc | BNP Paribas | 69 | (2.600) | Japan Exchange Group Inc | Goldam Sachs | (2.366) |
| (700) | Hikari Tsushin Inc | HSBC | (59) | (18.000) | Japan Post Bank Co Ltd | HSBC | (2.877) |
| (400) | Hikari Tsushin Inc | JP Morgan | (1.142) | (10.000) | Japan Post Bank Co Ltd | Bank of America | 2.237 |
| 7.300 | Hino Motors Ltd | Barclays Bank | (3.106) | (700) | Japan Post Bank Co Ltd | BNP Paribas | 1.243 |
| (2.200) | Hitachi Construction Machinery Co Ltd | Goldam Sachs | 2.891 | (3.100) | Japan Post Bank Co Ltd | Goldam Sachs | 87 |
| 700 | Hitachi Ltd | Bank of America | 940 | (3.600) | Japan Post Holdings Co Ltd | HSBC | 24 |
| 100 | Hitachi Ltd | Merrill Lynch | 549 | (8.500) | Japan Post Holdings Co Ltd | Barclays Bank | (590) |
| 100 | Hitachi Ltd | Barclays Bank | 230 | (4.500) | Japan Post Holdings Co Ltd | BNP Paribas | (1.096) |
| 900 | Hitachi Ltd | BNP Paribas | 78 | (1.100) | Japan Post Insurance Co Ltd | Goldam Sachs | (580) |
| (2.700) | Hitachi Metals Ltd | Citibank | 2.069 | (1.500) | JFE Holdings Inc | Goldam Sachs | 145 |
| (3.800) | Hitachi Metals Ltd | Goldam Sachs | (1.573) | (6.700) | JFE Holdings Inc | BNP Paribas | (967) |
| 4.200 | Honda Motor Co Ltd | HSBC | (826) | 2.100 | JSR Corp | Goldam Sachs | (4.319) |
| 4.600 | Honda Motor Co Ltd | Bank of America | 391 | 1.900 | JSR Corp | Bank of America | 6.768 |
| 1.600 | Honda Motor Co Ltd | Merrill Lynch | (643) | 800 | JSR Corp | Merrill Lynch | 6.768 |
| 400 | Honda Motor Co Ltd | Barclays Bank | 149 | 800 | JSR Corp | Barclays Bank | 5.164 |
| 6.100 | Honda Motor Co Ltd | BNP Paribas | (56) | 900 | JSR Corp | BNP Paribas | 2.578 |
| 1.500 | Honda Motor Co Ltd | Citibank | 568 | 800 | JSR Corp | Goldam Sachs | 2.578 |
| 300 | Honda Motor Co Ltd | Goldam Sachs | (2.411) | 900 | JSR Corp | JP Morgan | 4.019 |
| 300 | Hoshizaki Corp | JP Morgan | (140) | 10.200 | Kajima Corp | Bank of America | 951 |
| 1.300 | Hoya Corp | BNP Paribas | 10.752 | 5.700 | Kajima Corp | Merrill Lynch | 951 |
| | | Bank of America | | 5.400 | Kajima Corp | Barclays Bank | 708 |
| | | Merrill Lynch | | 900 | Kajima Corp | Goldam Sachs | 503 |
| | | | | (800) | Kakaku.com Inc | HSBC | (328) |
| | | | | (600) | Kakaku.com Inc | Barclays Bank | 416 |
| | | | | (1.800) | Kakaku.com Inc | BNP Paribas | 606 |
| | | | | (600) | Kansai Paint Co Ltd | Goldam Sachs | 1.817 |
| | | | | 1.100 | Kao Corp | Barclays Bank | (154) |
| | | | | | | Barclays Bank | 384 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------|-----------------|---|--------------------------|------------------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 300 | Kao Corp | HSBC | 58 | (1.700) | Lion Corp | BNP Paribas | (937) |
| (1) | Kawasaki Kisen Kaisha Ltd | BNP Paribas | (14) | (4.400) | Lion Corp | Goldam Sachs | (2.426) |
| 300 | KDDI Corp | Bank of America | | (800) | Lion Corp | HSBC | (547) |
| | | Merrill Lynch | 170 | (600) | Lion Corp | JP Morgan | (410) |
| 9.300 | KDDI Corp | Barclays Bank | (4.478) | 9.700 | Lixil Corp | Bank of America | |
| (5.900) | Keio Corp | JP Morgan | 21.306 | | | Merrill Lynch | (4.445) |
| (1.100) | Keisei Electric Railway Co Ltd | Bank of America | | (600) | M3 Inc | Barclays Bank | 1.198 |
| | | Merrill Lynch | 384 | (3.200) | M3 Inc | BNP Paribas | 2.634 |
| (800) | Keisei Electric Railway Co Ltd | Barclays Bank | 373 | (100) | M3 Inc | HSBC | 117 |
| (800) | Keisei Electric Railway Co Ltd | Goldam Sachs | 280 | (1.400) | Makita Corp | Goldam Sachs | 2.359 |
| (400) | Keisei Electric Railway Co Ltd | JP Morgan | (280) | 7.000 | Marubeni Corp | Barclays Bank | 136 |
| (200) | Keyence Corp | HSBC | (2.097) | 21.900 | Marubeni Corp | BNP Paribas | 6.888 |
| 200 | Kikkoman Corp | Bank of America | | 30.700 | Mazda Motor Corp | Barclays Bank | (5.245) |
| | | Merrill Lynch | (637) | 8.900 | Mazda Motor Corp | BNP Paribas | 1.659 |
| 800 | Kikkoman Corp | Barclays Bank | 373 | 400 | Mazda Motor Corp | HSBC | 379 |
| 200 | Kikkoman Corp | Citibank | 93 | 200 | Mazda Motor Corp | JP Morgan | 190 |
| (4.500) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | Bank of America | | 800 | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | Barclays Bank | (746) |
| | | Merrill Lynch | (2.097) | 900 | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | BNP Paribas | (1.048) |
| (2.000) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | Barclays Bank | (854) | 500 | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | Citibank | (466) |
| (600) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | Goldam Sachs | (280) | 1.000 | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | HSBC | (311) |
| 3.500 | Kirin Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 1.712 | 4.500 | MEIJI Holdings Co Ltd | Goldam Sachs | (9.436) |
| (2.300) | Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd | Goldam Sachs | 5.894 | (1.300) | Mercari Inc | Bank of America | |
| (5.900) | Kobe Bussan Co Ltd | Bank of America | | (900) | Mercari Inc | Merrill Lynch | 767 |
| | | Merrill Lynch | (9.164) | (5.800) | Mercari Inc | Barclays Bank | (475) |
| (700) | Kobe Bussan Co Ltd | Goldam Sachs | (1.087) | (1.100) | Mercari Inc | BNP Paribas | 3.423 |
| (4.510) | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | Barclays Bank | (3.678) | (400) | Mercari Inc | Goldam Sachs | 649 |
| (2.300) | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | Goldam Sachs | (6.073) | 1.400 | MINEBEA MITSUMI Inc | HSBC | 9 |
| (1.000) | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | HSBC | (3.844) | (200) | MISUMI Group Inc | Barclays Bank | — |
| (300) | Koito Manufacturing Co Ltd | Bank of America | | (900) | MISUMI Group Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 268 | (700) | MISUMI Group Inc | Merrill Lynch | (17) |
| (1.000) | Koito Manufacturing Co Ltd | Barclays Bank | 233 | (4.700) | Mitsubishi Chemical Holdings Corp | Barclays Bank | (42) |
| (1.300) | Koito Manufacturing Co Ltd | BNP Paribas | 1.161 | (7.700) | Mitsubishi Corp | Goldam Sachs | (60) |
| (900) | Koito Manufacturing Co Ltd | Goldam Sachs | 804 | (1.800) | Mitsubishi Corp | Barclays Bank | 504 |
| 3.300 | Komatsu Ltd | BNP Paribas | 2.358 | 29.700 | Mitsubishi Electric Corp | Barclays Bank | (2.631) |
| 500 | Komatsu Ltd | Goldam Sachs | 357 | | | HSBC | (1.286) |
| (100) | Konami Holdings Corp | Barclays Bank | (23) | 8.900 | Mitsubishi Electric Corp | Bank of America | |
| (400) | Konami Holdings Corp | BNP Paribas | (2.609) | 17.200 | Mitsubishi Electric Corp | Merrill Lynch | (2.998) |
| (900) | Konami Holdings Corp | Goldam Sachs | (5.871) | 2.600 | Mitsubishi Electric Corp | BNP Paribas | (899) |
| (600) | Kose Corp | Barclays Bank | (513) | (2.600) | Mitsubishi Electric Corp | Citibank | (1.336) |
| (1.500) | Kose Corp | BNP Paribas | (3.029) | (2.600) | Mitsubishi Estate Co Ltd | HSBC | 1.232 |
| (200) | Kose Corp | Citibank | (171) | 1.200 | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | Barclays Bank | (1.504) |
| (300) | Kose Corp | Goldam Sachs | (606) | 4.800 | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | Bank of America | |
| (10.200) | Kubota Corp | Bank of America | | 6.600 | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | Merrill Lynch | 997 |
| | | Merrill Lynch | (7.525) | 2.800 | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | Barclays Bank | 2.498 |
| (10.500) | Kubota Corp | Barclays Bank | (10.886) | 1.500 | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | BNP Paribas | 5.484 |
| (10.600) | Kubota Corp | BNP Paribas | (7.820) | (13.200) | Mitsubishi HC Capital Inc | HSBC | |
| (4.400) | Kubota Corp | Goldam Sachs | (3.246) | (500) | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | Bank of America | (2.665) |
| (2.500) | Kubota Corp | HSBC | (2.407) | (2.100) | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | Merrill Lynch | (920) |
| (400) | Kurita Water Industries Ltd | BNP Paribas | (342) | (500) | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | Barclays Bank | (832) |
| 2.200 | Kyocera Corp | Barclays Bank | 1.589 | (2.700) | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | Citibank | (198) |
| 1.100 | Kyocera Corp | BNP Paribas | 899 | (900) | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | Goldam Sachs | (4.970) |
| 200 | Kyocera Corp | Goldam Sachs | 92 | (5.000) | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | HSBC | (2.293) |
| 200 | Kyocera Corp | JP Morgan | 699 | | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | Barclays Bank | 163 |
| (800) | Kyowa Kirin Co Ltd | Barclays Bank | (31) | | | | |
| (500) | Kyowa Kirin Co Ltd | BNP Paribas | (43) | | | | |
| (400) | Kyowa Kirin Co Ltd | Citibank | (16) | | | | |
| (1.500) | Kyowa Kirin Co Ltd | Goldam Sachs | (128) | | | | |
| (400) | Kyowa Kirin Co Ltd | JP Morgan | (466) | | | | |
| (1.000) | Lasertec Corp | Barclays Bank | (7.688) | | | | |
| (200) | Lasertec Corp | Citibank | (1.987) | | | | |
| (300) | Lasertec Corp | Goldam Sachs | (2.947) | | | | |
| (1.200) | Lion Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (662) | | | | |
| (600) | Lion Corp | Barclays Bank | (294) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|------------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (12.400) | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | BNP Paribas | (77) | 2.500 | Nippon Express Holdings Inc | Barclays Bank | 194 |
| (10.600) | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | HSBC | 2.733 | 800 | Nippon Express Holdings Inc | Goldam Sachs | (1.864) |
| (12.800) | Mitsui & Co Ltd | BNP Paribas | (19.583) | 100 | Nippon Express Holdings Inc | HSBC | 101 |
| 1.300 | Mitsui Chemicals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.010 | 300 | Nippon Express Holdings Inc | JP Morgan | (839) |
| 1.900 | Mitsui Chemicals Inc | Barclays Bank | 1.402 | (12.100) | Nippon Paint Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.128 |
| 2.700 | Mitsui Chemicals Inc | BNP Paribas | 2.097 | (3.800) | Nippon Paint Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 1.003 |
| 3.900 | Mitsui Chemicals Inc | Goldam Sachs | 3.029 | (7.600) | Nippon Paint Holdings Co Ltd | Goldam Sachs | 708 |
| 3.600 | Mitsui Chemicals Inc | HSBC | 3.914 | (1.900) | Nippon Paint Holdings Co Ltd | HSBC | 354 |
| 2.000 | Mitsui Chemicals Inc | JP Morgan | 2.175 | (6.600) | Nippon Sanso Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.128) |
| (1.100) | Mitsui Fudosan Co Ltd | Barclays Bank | (1.200) | (1.000) | Nippon Sanso Holdings Corp | Barclays Bank | (163) |
| (500) | Mitsui Fudosan Co Ltd | BNP Paribas | (480) | (3.300) | Nippon Sanso Holdings Corp | BNP Paribas | (564) |
| (2.300) | Mitsui Fudosan Co Ltd | Goldam Sachs | (2.206) | (3.100) | Nippon Sanso Holdings Corp | Citibank | (506) |
| (300) | Mitsui OSK Lines Ltd | Barclays Bank | 116 | (2.300) | Nippon Sanso Holdings Corp | Goldam Sachs | (393) |
| (1.800) | Mitsui OSK Lines Ltd | Goldam Sachs | (2.446) | (2.900) | Nippon Sanso Holdings Corp | HSBC | (2.072) |
| (600) | Mitsui OSK Lines Ltd | HSBC | (676) | (1.100) | Nippon Shinyaku Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (7.176) |
| (300) | Miura Co Ltd | BNP Paribas | (172) | (200) | Nippon Shinyaku Co Ltd | Barclays Bank | 93 |
| (3.400) | Miura Co Ltd | HSBC | (7.816) | (800) | Nippon Shinyaku Co Ltd | BNP Paribas | (5.219) |
| 6.490 | Mizuho Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.008 | (400) | Nippon Steel Corp | Barclays Bank | (587) |
| 4.900 | Mizuho Financial Group Inc | Barclays Bank | (552) | (400) | Nippon Steel Corp | HSBC | (870) |
| 11.400 | Mizuho Financial Group Inc | BNP Paribas | 1.771 | 5.900 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | Barclays Bank | — |
| 2.700 | Mizuho Financial Group Inc | Goldam Sachs | 419 | 9.300 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | Goldam Sachs | 7.584 |
| (6.700) | MonotaRO Co Ltd | Barclays Bank | 5.307 | 1.900 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | HSBC | 1.018 |
| (400) | MonotaRO Co Ltd | Goldam Sachs | 401 | 600 | Nippon Yusen KK | Goldam Sachs | 4.613 |
| (600) | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.430) | 200 | Nissan Chemical Corp | Bank of America Merrill Lynch | (217) |
| (1.200) | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | Barclays Bank | (867) | 200 | Nissan Chemical Corp | Barclays Bank | (62) |
| (400) | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | Goldam Sachs | (954) | 300 | Nissan Chemical Corp | BNP Paribas | (326) |
| 600 | Murata Manufacturing Co Ltd | Barclays Bank | 247 | 1.400 | Nissan Chemical Corp | Goldam Sachs | (1.522) |
| 100 | Murata Manufacturing Co Ltd | HSBC | 71 | 600 | Nissan Chemical Corp | JP Morgan | 1.212 |
| 1.700 | NEC Corp | Goldam Sachs | (1.452) | (34.500) | Nissan Motor Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.581) |
| 1.000 | NEC Corp | HSBC | (1.631) | (9.900) | Nissan Motor Co Ltd | Barclays Bank | (208) |
| (4.600) | Nexon Co Ltd | Barclays Bank | (3.751) | (11.800) | Nissan Motor Co Ltd | BNP Paribas | (541) |
| (1.400) | Nexon Co Ltd | BNP Paribas | (2.892) | (16.200) | Nissan Motor Co Ltd | Goldam Sachs | (742) |
| (400) | Nexon Co Ltd | Citibank | (326) | (6.700) | Nissan Motor Co Ltd | HSBC | 978 |
| (500) | Nexon Co Ltd | HSBC | (1.192) | 2.300 | Nisshin Seifun Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.465) |
| (700) | Nexon Co Ltd | JP Morgan | (1.669) | 1.100 | Nisshin Seifun Group Inc | Barclays Bank | (367) |
| 3.900 | NGK Insulators Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 3.483 | 2.200 | Nisshin Seifun Group Inc | BNP Paribas | (1.401) |
| 5.800 | NGK Insulators Ltd | Barclays Bank | 3.423 | 1.600 | Nisshin Seifun Group Inc | Citibank | (534) |
| 3.900 | NGK Insulators Ltd | BNP Paribas | 3.483 | 1.200 | Nisshin Seifun Group Inc | Goldam Sachs | (764) |
| 25.200 | NGK Insulators Ltd | Goldam Sachs | 22.506 | 2.700 | Nisshin Seifun Group Inc | HSBC | (4.424) |
| 3.400 | NGK Insulators Ltd | HSBC | 3.749 | 2.400 | Nisshin Seifun Group Inc | JP Morgan | (3.933) |
| 1.400 | NGK Insulators Ltd | JP Morgan | 1.544 | 4.800 | Nissin Foods Holdings Co Ltd | BNP Paribas | 746 |
| (1.300) | Nidec Corp | Bank of America Merrill Lynch | (4.048) | (100) | Nitori Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (12) |
| (1.200) | Nidec Corp | Barclays Bank | (2.544) | (200) | Nitori Holdings Co Ltd | Barclays Bank | (784) |
| (300) | Nidec Corp | BNP Paribas | (900) | (200) | Nitori Holdings Co Ltd | BNP Paribas | (23) |
| (100) | Nidec Corp | Citibank | (212) | (100) | Nitori Holdings Co Ltd | Citibank | (392) |
| (500) | Nidec Corp | Goldam Sachs | (1.557) | (500) | Nitori Holdings Co Ltd | Goldam Sachs | (58) |
| (500) | Nidec Corp | HSBC | (1.806) | (100) | Nitori Holdings Co Ltd | HSBC | (633) |
| (200) | Nidec Corp | JP Morgan | (722) | | | | |
| (1.500) | Nihon M&A Center Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.631) | | | | |
| (1.300) | Nihon M&A Center Holdings Inc | Barclays Bank | (909) | | | | |
| (500) | Nihon M&A Center Holdings Inc | BNP Paribas | (544) | | | | |
| (5.400) | Nihon M&A Center Holdings Inc | HSBC | (4.823) | | | | |
| (100) | Nintendo Co Ltd | BNP Paribas | (839) | | | | |
| 500 | Nippon Express Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.165) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-----------------|---|--------------------------|------------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (100) | Nitori Holdings Co Ltd | JP Morgan | (633) | 800 | Persol Holdings Co Ltd | Bank of America | |
| 2.200 | Nitto Denko Corp | Goldam Sachs | 6.834 | | | Merrill Lynch | 261 |
| 7.600 | Nitto Denko Corp | JP Morgan | 21.838 | 1.400 | Persol Holdings Co Ltd | Citibank | (826) |
| (4.700) | Nomura Holdings Inc | Barclays Bank | (683) | 200 | Persol Holdings Co Ltd | JP Morgan | 120 |
| (19.400) | Nomura Holdings Inc | BNP Paribas | (5.273) | (24.400) | Pola Orbis Holdings Inc | BNP Paribas | (15.159) |
| (2.400) | Nomura Holdings Inc | Goldam Sachs | (652) | (800) | Pola Orbis Holdings Inc | Goldam Sachs | (497) |
| 100 | Nomura Real Estate Holdings Inc | Bank of America | | (1.000) | Pola Orbis Holdings Inc | HSBC | (947) |
| | | Merrill Lynch | 101 | (1.700) | Rakuten Group Inc | Barclays Bank | 502 |
| 3.600 | Nomura Real Estate Holdings Inc | | | (22.500) | Rakuten Group Inc | Goldam Sachs | 13.629 |
| 6.000 | Nomura Real Estate Holdings Inc | Barclays Bank | (699) | 1.200 | Recruit Holdings Co Ltd | BNP Paribas | 391 |
| | | BNP Paribas | 6.058 | 2.100 | Recruit Holdings Co Ltd | Goldam Sachs | 685 |
| 400 | Nomura Real Estate Holdings Inc | | | 400 | Recruit Holdings Co Ltd | HSBC | 817 |
| | | Citibank | (78) | (6.600) | Renesas Electronics Corp | Bank of America | |
| 1.000 | Nomura Real Estate Holdings Inc | | | | | Merrill Lynch | (6.663) |
| | | Goldam Sachs | 1.010 | (4.600) | Renesas Electronics Corp | Barclays Bank | (1.107) |
| 600 | Nomura Real Estate Holdings Inc | | | (7.300) | Renesas Electronics Corp | BNP Paribas | (7.370) |
| | | HSBC | 326 | (1.100) | Renesas Electronics Corp | Citibank | (265) |
| 400 | Nomura Real Estate Holdings Inc | | | (5.100) | Renesas Electronics Corp | Goldam Sachs | (5.149) |
| | | JP Morgan | 217 | (1.400) | Renesas Electronics Corp | HSBC | (1.620) |
| (400) | Nomura Research Institute Ltd | | | 33.700 | Resona Holdings Inc | BNP Paribas | (2.643) |
| | | Barclays Bank | (47) | (1.700) | Ricoh Co Ltd | Citibank | (488) |
| (1.000) | Nomura Research Institute Ltd | | | 100 | Rinnai Corp | BNP Paribas | 116 |
| | | BNP Paribas | (1.864) | (300) | Rohm Co Ltd | Barclays Bank | (1.328) |
| (6.600) | NTT Data Corp | | | (300) | Rohm Co Ltd | BNP Paribas | (2.493) |
| (2.500) | NTT Data Corp | Barclays Bank | 1.076 | (100) | Rohm Co Ltd | Goldam Sachs | (831) |
| (4.000) | NTT Data Corp | | | (600) | Ryohin Keikaku Co Ltd | Bank of America | |
| (2.000) | Obayashi Corp | Goldam Sachs | (311) | | | Merrill Lynch | (643) |
| (3.100) | Obayashi Corp | BNP Paribas | 78 | (3.100) | Ryohin Keikaku Co Ltd | Barclays Bank | (1.083) |
| (4.000) | Obayashi Corp | HSBC | (602) | (8.100) | Ryohin Keikaku Co Ltd | Goldam Sachs | (8.681) |
| (100) | Obic Co Ltd | JP Morgan | (777) | 16.000 | Santen Pharmaceutical Co Ltd | | |
| (17.700) | Odakyu Electric Railway Co Ltd | BNP Paribas | 132 | | | Barclays Bank | 1.118 |
| | | | | (1.400) | SBI Holdings Inc | BNP Paribas | 631 |
| (5.200) | Odakyu Electric Railway Co Ltd | Barclays Bank | 4.536 | (1.900) | SBI Holdings Inc | Goldam Sachs | 856 |
| | | BNP Paribas | 3.675 | (5.700) | SBI Holdings Inc | HSBC | 12.129 |
| (23.500) | Oji Holdings Corp | | | (6.300) | SCSK Corp | Barclays Bank | 1.908 |
| 200 | Olympus Corp | Goldam Sachs | (1.825) | 1.000 | Secom Co Ltd | Bank of America | |
| 2.200 | Olympus Corp | BNP Paribas | 106 | | | Merrill Lynch | 474 |
| (300) | Omron Corp | Goldam Sachs | 1.170 | 500 | Secom Co Ltd | BNP Paribas | 237 |
| (400) | Omron Corp | Barclays Bank | 56 | 300 | Secom Co Ltd | Citibank | 70 |
| (600) | Omron Corp | BNP Paribas | (494) | 700 | Secom Co Ltd | Goldam Sachs | 332 |
| 7.100 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | Goldam Sachs | (741) | 200 | Secom Co Ltd | HSBC | (989) |
| 4.800 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | Barclays Bank | (8.988) | 300 | Secom Co Ltd | JP Morgan | (1.484) |
| (4.000) | Open House Group Co Ltd | BNP Paribas | 2.050 | 13.800 | Seiko Epson Corp | Barclays Bank | 965 |
| (500) | Oracle Corp Japan | BNP Paribas | (12.115) | 34.500 | Sekisui Chemical Co Ltd | BNP Paribas | 47.424 |
| (1.500) | Oracle Corp Japan | Citibank | 1.747 | 600 | Sekisui House Ltd | Bank of America | |
| (500) | Oriental Land Co Ltd | Goldam Sachs | 5.708 | | | Merrill Lynch | 245 |
| (100) | Oriental Land Co Ltd | Goldam Sachs | (4.912) | 5.600 | Sekisui House Ltd | BNP Paribas | 2.283 |
| 2.000 | ORIX Corp | HSBC | (1.045) | 700 | Sekisui House Ltd | Citibank | 313 |
| 23.100 | Osaka Gas Co Ltd | Barclays Bank | 1.406 | 700 | Sekisui House Ltd | HSBC | 315 |
| | | Bank of America | | 1.500 | Sekisui House Ltd | JP Morgan | 676 |
| | | Merrill Lynch | (5.202) | 1.200 | SG Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 242 |
| 3.900 | Osaka Gas Co Ltd | | | 600 | SG Holdings Co Ltd | Citibank | 121 |
| 5.300 | Osaka Gas Co Ltd | Barclays Bank | (1.757) | 600 | SG Holdings Co Ltd | HSBC | (98) |
| (3.800) | Otsuka Corp | HSBC | 123 | (1.300) | Sharp Corp | Bank of America | |
| | | Bank of America | (6.935) | | | Merrill Lynch | 304 |
| (1.700) | Otsuka Corp | Merrill Lynch | (1.980) | (1.900) | Sharp Corp | BNP Paribas | 103 |
| (4.000) | Otsuka Corp | Barclays Bank | (7.300) | (10.600) | Sharp Corp | Goldam Sachs | 557 |
| (5.300) | Otsuka Corp | BNP Paribas | (9.673) | (3.000) | Sharp Corp | HSBC | 199 |
| (1.200) | Otsuka Corp | Goldam Sachs | (652) | 900 | Shimadzu Corp | Barclays Bank | (664) |
| (500) | Otsuka Holdings Co Ltd | HSBC | 571 | 1.300 | Shimadzu Corp | Goldam Sachs | 959 |
| (2.500) | Otsuka Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 2.629 | 100 | Shimadzu Corp | JP Morgan | 299 |
| (7.400) | Pan Pacific International Holdings Corp | BNP Paribas | | (100) | Shimano Inc | Bank of America | |
| | | Barclays Bank | (13.333) | | | Merrill Lynch | (404) |
| (4.500) | Pan Pacific International Holdings Corp | | | (300) | Shimano Inc | Barclays Bank | (582) |
| | | BNP Paribas | (1.363) | (100) | Shimano Inc | Citibank | (194) |
| (2.100) | Pan Pacific International Holdings Corp | | | (27.200) | Shimizu Corp | BNP Paribas | 4.225 |
| | | Goldam Sachs | (636) | (2.300) | Shimizu Corp | Goldam Sachs | 357 |
| 1.300 | Panasonic Holdings Corp | BNP Paribas | 535 | (5.600) | Shimizu Corp | HSBC | (348) |
| 8.400 | Panasonic Holdings Corp | Goldam Sachs | 3.457 | (200) | Shin-Etsu Chemical Co Ltd | Goldam Sachs | (575) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|----------------------------------|-----------------|---|--------------------------|---------------------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (200) | Shionogi & Co Ltd | Bank of America | | (400) | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | Goldam Sachs | (1.354) |
| | | Merrill Lynch | (47) | | | | |
| (900) | Shionogi & Co Ltd | Barclays Bank | 629 | 4.300 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | BNP Paribas | 668 |
| (300) | Shionogi & Co Ltd | Citibank | 210 | | | | |
| (300) | Shionogi & Co Ltd | Goldam Sachs | (70) | 1.200 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | Bank of America | |
| (200) | Shiseido Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (1.389) |
| | | Merrill Lynch | (103) | 500 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | Barclays Bank | 54 |
| (2.200) | Shiseido Co Ltd | Barclays Bank | (2.392) | | | | |
| (3.100) | Shiseido Co Ltd | BNP Paribas | (1.589) | 300 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | BNP Paribas | (347) |
| (100) | Shiseido Co Ltd | HSBC | (92) | | | | |
| 2.500 | Shizuoka Bank Ltd | Bank of America | | 600 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | Goldam Sachs | (694) |
| | | Merrill Lynch | (815) | | | BNP Paribas | (77) |
| 2.500 | Shizuoka Bank Ltd | Barclays Bank | (194) | 1.100 | Sumitomo Pharma Co Ltd | Goldam Sachs | (154) |
| 1.400 | Shizuoka Bank Ltd | Citibank | (109) | 2.200 | Sumitomo Pharma Co Ltd | | |
| 5.900 | Shizuoka Bank Ltd | HSBC | (4.628) | (500) | Sumitomo Realty & Development Co Ltd | Barclays Bank | (687) |
| (200) | SMC Corp | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (5.017) | 1.700 | Suntory Beverage & Food Ltd | Merrill Lynch | (4.027) |
| (4.500) | SoftBank Corp | Barclays Bank | 349 | | | | |
| (8.200) | SoftBank Corp | BNP Paribas | (1.433) | 1.000 | Suzuki Motor Corp | Barclays Bank | 334 |
| (1.900) | SoftBank Corp | HSBC | 413 | 900 | Suzuki Motor Corp | BNP Paribas | 664 |
| (1.100) | SoftBank Group Corp | Barclays Bank | (880) | 400 | Suzuki Motor Corp | Goldam Sachs | 295 |
| (300) | SoftBank Group Corp | BNP Paribas | (627) | 500 | Suzuki Motor Corp | HSBC | (497) |
| (800) | SoftBank Group Corp | Goldam Sachs | (1.671) | 300 | Suzuki Motor Corp | JP Morgan | (298) |
| (2.200) | SoftBank Group Corp | HSBC | (6.663) | 800 | Sysmex Corp | Bank of America | |
| 700 | Sohgo Security Services Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (311) |
| | | Merrill Lynch | (516) | 300 | Sysmex Corp | BNP Paribas | (116) |
| 1.300 | Sohgo Security Services Co Ltd | BNP Paribas | (959) | 300 | Sysmex Corp | Citibank | 410 |
| | | | | 300 | Sysmex Corp | Goldam Sachs | (116) |
| 900 | Sohgo Security Services Co Ltd | Goldam Sachs | (664) | 200 | Sysmex Corp | HSBC | 868 |
| 400 | Sohgo Security Services Co Ltd | HSBC | (248) | 200 | Sysmex Corp | JP Morgan | 868 |
| | | | | (900) | T&D Holdings Inc | Bank of America | |
| 300 | Sohgo Security Services Co Ltd | JP Morgan | (186) | | | Merrill Lynch | 175 |
| 2.000 | Sompo Holdings Inc | BNP Paribas | 13.063 | (4.100) | T&D Holdings Inc | BNP Paribas | 302 |
| 2.700 | Sompo Holdings Inc | Goldam Sachs | 17.634 | (1.400) | T&D Holdings Inc | Citibank | 359 |
| 1.400 | Sompo Holdings Inc | HSBC | 5.795 | (800) | T&D Holdings Inc | Goldam Sachs | 155 |
| 100 | Sony Corp | BNP Paribas | 673 | (1.200) | T&D Holdings Inc | HSBC | 2.097 |
| 300 | Sony Corp | Goldam Sachs | 2.178 | 2.300 | Taisei Corp | Barclays Bank | — |
| 100 | Sony Corp | JP Morgan | 209 | 700 | Taisei Corp | Goldam Sachs | (299) |
| (1.700) | Square Enix Holdings Co Ltd | Barclays Bank | (1.848) | (2.600) | Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd | BNP Paribas | (4.139) |
| | | | | (1.600) | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | Goldam Sachs | (522) |
| (300) | Square Enix Holdings Co Ltd | HSBC | (2.539) | 700 | TDK Corp | Goldam Sachs | 1.386 |
| 3.700 | Stanley Electric Co Ltd | Bank of America | | 1.600 | TDK Corp | HSBC | 5.281 |
| | | Merrill Lynch | 3.190 | 600 | Terumo Corp | Bank of America | |
| 100 | Stanley Electric Co Ltd | JP Morgan | 84 | | | Merrill Lynch | 885 |
| 2.400 | Subaru Corp | Barclays Bank | 2.376 | 4.600 | Terumo Corp | Barclays Bank | 2.429 |
| 2.800 | Subaru Corp | Goldam Sachs | 2.088 | 300 | Terumo Corp | BNP Paribas | 443 |
| (900) | SUMCO Corp | Bank of America | | (4.900) | TIS Inc | HSBC | (14.955) |
| | | Merrill Lynch | (769) | (7.600) | Tobu Railway Co Ltd | Barclays Bank | 2.066 |
| (1.900) | SUMCO Corp | Barclays Bank | (1.535) | (4.500) | Toho Co Ltd | HSBC | (7.514) |
| (6.600) | SUMCO Corp | BNP Paribas | (5.638) | (1.600) | Tokio Marine Holdings Inc | Goldam Sachs | (7.629) |
| (4.200) | SUMCO Corp | Citibank | (3.392) | (3.200) | Tokyo Century Corp | Goldam Sachs | (3.728) |
| (4.800) | SUMCO Corp | Goldam Sachs | (4.100) | 100 | Tokyo Electron Ltd | BNP Paribas | 1.522 |
| 49.300 | Sumitomo Chemical Co Ltd | Barclays Bank | 766 | 100 | Tokyo Electron Ltd | Goldam Sachs | 1.522 |
| 18.200 | Sumitomo Chemical Co Ltd | BNP Paribas | 1.555 | 900 | Tokyo Gas Co Ltd | Bank of America | |
| 200 | Sumitomo Chemical Co Ltd | Citibank | 3 | | | Merrill Lynch | (594) |
| 8.700 | Sumitomo Chemical Co Ltd | Goldam Sachs | 743 | 16.900 | Tokyo Gas Co Ltd | Barclays Bank | (10.500) |
| 3.300 | Sumitomo Chemical Co Ltd | JP Morgan | (1.128) | 7.100 | Tokyo Gas Co Ltd | BNP Paribas | (4.687) |
| (17.600) | Sumitomo Corp | Goldam Sachs | (4.032) | 1.400 | Tokyo Gas Co Ltd | Citibank | (870) |
| (9.200) | Sumitomo Electric Industries Ltd | Barclays Bank | (393) | 1.000 | Tokyo Gas Co Ltd | Goldam Sachs | (660) |
| | | | | 6.200 | Tokyo Gas Co Ltd | HSBC | 193 |
| (29.200) | Sumitomo Electric Industries Ltd | BNP Paribas | (7.143) | 1.000 | Tokyo Gas Co Ltd | JP Morgan | 31 |
| (5.600) | Sumitomo Electric Industries Ltd | Goldam Sachs | (1.370) | (6.300) | Tokyu Corp | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 5.627 |
| (900) | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | BNP Paribas | (3.047) | (7.300) | Tokyu Corp | Barclays Bank | 4.876 |
| | | | | (1.300) | Tokyu Corp | BNP Paribas | 1.161 |
| | | | | (600) | Tokyu Corp | Goldam Sachs | 536 |
| | | | | 7.700 | Toppan Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 3.169 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|------------------------|-----------------|---|--------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 2.100 | Toppan Inc | Barclays Bank | 555 | (25.800) | Z Holdings Corp | HSBC | 3.567 |
| 1.300 | Toppan Inc | Goldam Sachs | 535 | 800 | ZOZO Inc | Barclays Bank | 460 |
| 1.400 | Toppan Inc | JP Morgan | 2.740 | | | | (121.231) |
| 800 | Toray Industries Inc | BNP Paribas | 197 | Niederlande | | | |
| 58.900 | Toray Industries Inc | Goldam Sachs | 14.500 | (18.544) | ABN AMRO Bank NV - CVA | BNP Paribas | 15.991 |
| (400) | Toshiba Corp | BNP Paribas | (1.069) | (1.237) | ABN AMRO Bank NV - CVA | Goldam Sachs | 1.067 |
| 2.500 | Tosoh Corp | Bank of America | | 9 | Adyen NV | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (330) | | | Merrill Lynch | (558) |
| 900 | Tosoh Corp | Barclays Bank | (7) | 7 | Adyen NV | Barclays Bank | (264) |
| 7.400 | Tosoh Corp | BNP Paribas | (977) | (15.555) | Aegon NV | BNP Paribas | (2.121) |
| 3.800 | Tosoh Corp | Goldam Sachs | (502) | (699) | Akzo Nobel NV | Barclays Bank | (150) |
| 2.900 | Tosoh Corp | HSBC | 878 | (641) | Akzo Nobel NV | BNP Paribas | (440) |
| 4.500 | TOTO Ltd | Barclays Bank | 3.145 | (138) | Akzo Nobel NV | Citibank | (30) |
| 300 | TOTO Ltd | Citibank | 210 | (263) | Akzo Nobel NV | Goldam Sachs | (180) |
| 6.400 | Toyo Suisan Kaisha Ltd | Bank of America | | (94) | Akzo Nobel NV | HSBC | (185) |
| | | Merrill Lynch | 14.165 | (438) | Akzo Nobel NV | JP Morgan | (863) |
| (300) | Toyota Industries Corp | Barclays Bank | 23 | (1.572) | ArcelorMittal SA | Barclays Bank | (2.947) |
| (200) | Toyota Industries Corp | BNP Paribas | (233) | (5.683) | ArcelorMittal SA | BNP Paribas | (19.025) |
| (600) | Toyota Industries Corp | Goldam Sachs | (699) | (702) | ArcelorMittal SA | Citibank | (1.316) |
| (200) | Toyota Industries Corp | HSBC | (404) | (786) | ArcelorMittal SA | Goldam Sachs | (2.631) |
| (2.700) | Toyota Motor Corp | Citibank | (1.279) | (611) | ArcelorMittal SA | HSBC | (2.831) |
| (10.800) | Toyota Motor Corp | Goldam Sachs | (6.123) | (120) | ASM International NV | Barclays Bank | (810) |
| 400 | Toyota Tsusho Corp | Bank of America | | (319) | ASM International NV | BNP Paribas | (1.230) |
| | | Merrill Lynch | 1.507 | (35) | ASM International NV | Goldam Sachs | (135) |
| 300 | Toyota Tsusho Corp | BNP Paribas | 1.130 | 222 | ASML Holding NV | BNP Paribas | 6.540 |
| 600 | Toyota Tsusho Corp | Citibank | 1.724 | 78 | ASML Holding NV | Goldam Sachs | 2.298 |
| 700 | Trend Micro Inc | Bank of America | | (368) | Heineken NV | BNP Paribas | 489 |
| | | Merrill Lynch | 2.011 | (249) | IMCD NV | BNP Paribas | (1.267) |
| 600 | Trend Micro Inc | Barclays Bank | 513 | (310) | ING Groep NV | BNP Paribas | (409) |
| (200) | Tsuruha Holdings Inc | Bank of America | | (3.464) | ING Groep NV | Citibank | (2.683) |
| | | Merrill Lynch | (528) | (1.881) | ING Groep NV | HSBC | (3.700) |
| (400) | Tsuruha Holdings Inc | Barclays Bank | (435) | (1.206) | InPost SA | Barclays Bank | 377 |
| (800) | Tsuruha Holdings Inc | BNP Paribas | (2.112) | (2.748) | JDE Peet's NV | Barclays Bank | 1.413 |
| (700) | Tsuruha Holdings Inc | Citibank | (970) | (4.956) | JDE Peet's NV | BNP Paribas | 8.601 |
| (1.300) | Unicharm Corp | Barclays Bank | 242 | (4.291) | JDE Peet's NV | Goldam Sachs | 7.447 |
| 10.900 | USS Co Ltd | BNP Paribas | (13.967) | (4.459) | Just Eat Takeaway.com NV | BNP Paribas | (3.009) |
| (300) | Welcia Holdings Co Ltd | Bank of America | | (145) | Just Eat Takeaway.com NV | Citibank | (188) |
| | | Merrill Lynch | 44 | (92) | Just Eat Takeaway.com NV | Goldam Sachs | (62) |
| (2.000) | Welcia Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 637 | 11.354 | Koninklijke Ahold | | |
| (4.500) | Welcia Holdings Co Ltd | BNP Paribas | 664 | | Delhaize NV | BNP Paribas | (21.893) |
| (500) | Welcia Holdings Co Ltd | Citibank | 159 | (178) | Koninklijke DSM NV | Barclays Bank | (3.175) |
| (1.300) | Welcia Holdings Co Ltd | Goldam Sachs | 192 | 9.399 | Koninklijke KPN NV | Bank of America | |
| (1.400) | Welcia Holdings Co Ltd | HSBC | (468) | | | Merrill Lynch | 725 |
| (1.700) | West Japan Railway Co | Bank of America | | 38.855 | Koninklijke KPN NV | BNP Paribas | 2.997 |
| | | Merrill Lynch | 1.030 | 9.507 | Koninklijke Philips NV | BNP Paribas | 3.514 |
| (1.000) | West Japan Railway Co | Barclays Bank | 505 | 8.341 | NN Group NV | BNP Paribas | (5.719) |
| (1.100) | West Japan Railway Co | BNP Paribas | 666 | 6.742 | NN Group NV | Goldam Sachs | (4.622) |
| (1.400) | West Japan Railway Co | Goldam Sachs | 848 | (6.343) | Prosus NV | BNP Paribas | (26.670) |
| 1.500 | Yakult Honsha Co Ltd | Barclays Bank | 1.398 | (184) | Prosus NV | Goldam Sachs | (774) |
| 800 | Yamaha Corp | BNP Paribas | 932 | 2.516 | Randstad NV | BNP Paribas | 5.498 |
| 1.100 | Yamaha Corp | Goldam Sachs | 1.281 | 2.278 | Wolters Kluwer NV | Barclays Bank | (2.977) |
| 14.400 | Yamaha Motor Co Ltd | Barclays Bank | 8.947 | 1.474 | Wolters Kluwer NV | BNP Paribas | (3.095) |
| 500 | Yamaha Motor Co Ltd | JP Morgan | (590) | | | | (59.002) |
| 200 | Yamato Holdings Co Ltd | Bank of America | | Neuseeland | | | |
| | | Merrill Lynch | (326) | (85.037) | Auckland International | | |
| 800 | Yamato Holdings Co Ltd | Barclays Bank | (565) | | Airport Ltd | HSBC | (6.641) |
| 100 | Yamato Holdings Co Ltd | BNP Paribas | (163) | 689 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | Barclays Bank | 85 |
| 400 | Yamato Holdings Co Ltd | Goldam Sachs | (652) | 19.708 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | Goldam Sachs | (641) |
| (400) | Yaskawa Electric Corp | Bank of America | | (54.097) | Mercury NZ Ltd | HSBC | 5.281 |
| | | Merrill Lynch | (792) | 22.661 | Meridian Energy Ltd | Bank of America | |
| (900) | Yaskawa Electric Corp | Barclays Bank | (1.118) | 14.116 | Meridian Energy Ltd | Merrill Lynch | 2.949 |
| (500) | Yaskawa Electric Corp | BNP Paribas | (990) | (52.599) | Ryman Healthcare Ltd | BNP Paribas | 1.837 |
| (300) | Yaskawa Electric Corp | Citibank | (373) | 8.424 | Spark New Zealand Ltd | HSBC | (57.847) |
| (300) | Yaskawa Electric Corp | Goldam Sachs | (594) | | | Merrill Lynch | 274 |
| 7.900 | Yokogawa Electric Corp | Bank of America | | 24.869 | Spark New Zealand Ltd | Barclays Bank | 2.428 |
| | | Merrill Lynch | 5.215 | | | | |
| (1.200) | Z Holdings Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (57) | | | | |
| (13.400) | Z Holdings Corp | BNP Paribas | (635) | | | | |
| (4.600) | Z Holdings Corp | Goldam Sachs | (218) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|---------------------------|-----------------|---|-----------------------------|--|-----------------|---|
| Neuseeland Fortsetzung | | | | Singapur Fortsetzung | | | |
| 54.495 | Spark New Zealand Ltd | BNP Paribas | 1.773 | (8.600) | Keppel Corp Ltd | Goldam Sachs | (1.694) |
| 10.539 | Spark New Zealand Ltd | Citibank | 1.029 | 2.600 | Singapore Airlines Ltd | Bank of America | |
| 23.437 | Spark New Zealand Ltd | Goldam Sachs | 763 | | | Merrill Lynch | 398 |
| | | | (48.710) | 500 | Singapore Airlines Ltd | Barclays Bank | 22 |
| Norwegen | | | | 9.800 | Singapore Airlines Ltd | BNP Paribas | 1.501 |
| (1.316) | Adevinta ASA | Bank of America | | 2.500 | Singapore Airlines Ltd | Citibank | 109 |
| | | Merrill Lynch | (1.718) | 14.200 | Singapore Airlines Ltd | Goldam Sachs | 2.175 |
| (11.487) | Adevinta ASA | BNP Paribas | (14.997) | 3.200 | Singapore Airlines Ltd | HSBC | 514 |
| (358) | Aker BP ASA | BNP Paribas | (1.699) | (2.200) | Singapore Exchange Ltd | BNP Paribas | 209 |
| (1.062) | Aker BP ASA | Goldam Sachs | (5.039) | (3.600) | Singapore Exchange Ltd | Citibank | 1.024 |
| 2.639 | DNB Bank ASA | Bank of America | | (27.500) | Singapore Exchange Ltd | Goldam Sachs | 2.608 |
| | | Merrill Lynch | (347) | (3.000) | Singapore Exchange Ltd | HSBC | — |
| 581 | DNB Bank ASA | Barclays Bank | 43 | (2.000) | Singapore Exchange Ltd | JP Morgan | — |
| 2.110 | DNB Bank ASA | BNP Paribas | 1.355 | 26.300 | Singapore Technologies Engineering Ltd | Barclays Bank | 1.151 |
| 455 | DNB Bank ASA | Citibank | 34 | 25.000 | Singapore Technologies Engineering Ltd | BNP Paribas | 1.094 |
| 1.121 | DNB Bank ASA | Goldam Sachs | 720 | 6.500 | Singapore Technologies Engineering Ltd | Citibank | 285 |
| 1.032 | Equinor ASA | BNP Paribas | 3.533 | 3.900 | Singapore Technologies Engineering Ltd | Goldam Sachs | 171 |
| 506 | Equinor ASA | Goldam Sachs | 587 | 7.200 | Singapore Technologies Engineering Ltd | HSBC | — |
| (101) | Gjensidige Forsikring ASA | Bank of America | | 26.400 | Singapore Technologies Engineering Ltd | JP Morgan | — |
| | | Merrill Lynch | (41) | 37.200 | Singapore Telecommunications Ltd | Bank of America | (3.799) |
| (501) | Gjensidige Forsikring ASA | Barclays Bank | (32) | 21.900 | Singapore Telecommunications Ltd | Barclays Bank | (1.278) |
| (3.380) | Gjensidige Forsikring ASA | BNP Paribas | (1.363) | 33.800 | Singapore Telecommunications Ltd | BNP Paribas | (3.451) |
| (821) | Gjensidige Forsikring ASA | Goldam Sachs | (331) | 15.000 | Singapore Telecommunications Ltd | Goldam Sachs | (1.532) |
| 829 | Mowi ASA | Bank of America | | 10.800 | Singapore Telecommunications Ltd | HSBC | (1.260) |
| | | Merrill Lynch | 388 | 12.500 | United Overseas Bank Ltd | Barclays Bank | 2.644 |
| 1.527 | Mowi ASA | Barclays Bank | 130 | (17.500) | UOL Group Ltd | Bank of America | |
| 477 | Mowi ASA | BNP Paribas | 38 | (2.700) | Venture Corp Ltd | Merrill Lynch | (4.085) |
| 359 | Mowi ASA | JP Morgan | (88) | (17.400) | Venture Corp Ltd | Barclays Bank | (1.103) |
| 7.705 | Norsk Hydro ASA | Barclays Bank | 114 | (13.000) | Venture Corp Ltd | BNP Paribas | (6.346) |
| 5.998 | Norsk Hydro ASA | BNP Paribas | 3.578 | (2.800) | Venture Corp Ltd | Goldam Sachs | (4.741) |
| 2.680 | Orkla ASA | Barclays Bank | 114 | (3.400) | Wilmar International Ltd | HSBC | (858) |
| 22.571 | Orkla ASA | BNP Paribas | (6.660) | (3.300) | Wilmar International Ltd | Bank of America | — |
| 1.908 | Orkla ASA | Citibank | 81 | (7.600) | Wilmar International Ltd | Merrill Lynch | 48 |
| 1.602 | Orkla ASA | Goldam Sachs | (473) | | | Goldam Sachs | — |
| 2.147 | Orkla ASA | HSBC | (460) | | | | (16.137) |
| 1.191 | Orkla ASA | JP Morgan | (255) | Südkorea | | | |
| (1.401) | Schibsted ASA 'A' | BNP Paribas | (773) | 1 | Doosan Co Ltd | Citibank | 5 |
| 2.618 | Telenor ASA | Bank of America | | 1 | HDC Holdings Co Ltd ^{††} | Goldam Sachs | — |
| | | Merrill Lynch | 681 | 1 | HDC Holdings Co Ltd ^{††} | JP Morgan | — |
| 668 | Telenor ASA | Barclays Bank | 145 | (1) | Lotte Shopping Co Ltd | Bank of America | |
| 1.706 | Telenor ASA | BNP Paribas | 444 | | | Merrill Lynch | (3) |
| 875 | Telenor ASA | Citibank | 190 | | | | 2 |
| 1.338 | Telenor ASA | HSBC | 33 | Spanien | | | |
| (62) | Yara International ASA | Bank of America | | 1.131 | ACS Actividades de Construccion y Servicios SA | HSBC | 3.441 |
| | | Merrill Lynch | (127) | (56) | Aena SME SA | Barclays Bank | (276) |
| (1.406) | Yara International ASA | Barclays Bank | (955) | (1.513) | Aena SME SA | BNP Paribas | (11.751) |
| (854) | Yara International ASA | Goldam Sachs | (1.750) | (1.388) | Amadeus IT Group SA | BNP Paribas | 1.279 |
| (511) | Yara International ASA | HSBC | (1.166) | 7.351 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | Bank of America | |
| | | | (26.066) | | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | Merrill Lynch | 1.701 |
| Portugal | | | | 5.544 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | Barclays Bank | 1.146 |
| (2.676) | Galp Energia SGPS SA | Citibank | (3.526) | 20.816 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | BNP Paribas | 4.817 |
| 789 | Jeronimo Martins SGPS SA | Bank of America | | Singapur | | | |
| | | Merrill Lynch | 211 | 190 | CDL Hospitality Trusts (Unit) | Bank of America | |
| 539 | Jeronimo Martins SGPS SA | Barclays Bank | 202 | | | Merrill Lynch | (6) |
| 854 | Jeronimo Martins SGPS SA | BNP Paribas | 229 | 349 | CDL Hospitality Trusts (Unit) | BNP Paribas | 318 |
| 995 | Jeronimo Martins SGPS SA | Goldam Sachs | 266 | (2.300) | City Developments Ltd | BNP Paribas | (168) |
| 533 | Jeronimo Martins SGPS SA | HSBC | (68) | 1.200 | DBS Group Holdings Ltd | Bank of America | |
| 579 | Jeronimo Martins SGPS SA | JP Morgan | (74) | | | Merrill Lynch | (87) |
| | | | (2.760) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------------------------|------------------------------------|-----------------|---|-----------------------------|------------------------------|-----------------|---|
| Spanien Fortsetzung | | | | Schweden Fortsetzung | | | |
| 1.859 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | Citibank | 384 | 327 | Assa Abloy AB 'B' | JP Morgan | 493 |
| 5.882 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | Goldam Sachs | 1.361 | (21.204) | Atlas Copco AB 'A' | BNP Paribas | (17.661) |
| 3.324 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | HSBC | 1.727 | (5.301) | Atlas Copco AB 'A' | BNP Paribas | (4.302) |
| 3.313 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | JP Morgan | 1.721 | 950 | Boliden AB | Bank of America | |
| 36.805 | Banco Santander SA | Barclays Bank | 6.762 | 5.190 | Boliden AB | Merrill Lynch | 4.314 |
| 51.316 | Banco Santander SA | BNP Paribas | 17.701 | (736) | Electrolux AB 'B' | BNP Paribas | 23.569 |
| 18.251 | Banco Santander SA | Goldam Sachs | 6.296 | (7.515) | Electrolux AB 'B' | Barclays Bank | (520) |
| 4.702 | Banco Santander SA | JP Morgan | 2.123 | (2.514) | Electrolux AB 'B' | BNP Paribas | 811 |
| (1.991) | CaixaBank SA | Barclays Bank | (277) | (5.559) | Electrolux AB 'B' | Citibank | (1.776) |
| (27.403) | CaixaBank SA | BNP Paribas | (13.709) | (1.306) | Electrolux AB 'B' | Goldam Sachs | 600 |
| (21.637) | CaixaBank SA | Goldam Sachs | (10.824) | (4.373) | Electrolux AB 'B' | HSBC | (564) |
| (8.063) | CaixaBank SA | JP Morgan | (3.731) | (20.440) | Embracer Group AB | Barclays Bank | (2.743) |
| (2.801) | Cellnex Telecom SA | Barclays Bank | (6.331) | (2.161) | Embracer Group AB | Goldam Sachs | (33.736) |
| (5.713) | Cellnex Telecom SA | BNP Paribas | (17.626) | 715 | Embracer Group AB | JP Morgan | (4.629) |
| (1.235) | Cellnex Telecom SA | Goldam Sachs | (3.810) | 715 | Epiroc AB 'A' | BNP Paribas | 575 |
| 10.756 | Endesa SA | BNP Paribas | 7.835 | (2.362) | EQT AB | BNP Paribas | (4.497) |
| (5.651) | Ferrovial SA | BNP Paribas | (666) | (843) | Essity AB 'B' | Bank of America | |
| (64) | Ferrovial SA | BNP Paribas | 23 | (207) | Essity AB 'B' | Merrill Lynch | 395 |
| (16.561) | Ferrovial SA | Citibank | (8.161) | (6.182) | Essity AB 'B' | Barclays Bank | (17) |
| (189) | Ferrovial SA | Citibank | (59) | 112 | Evolution AB | BNP Paribas | 2.895 |
| (1.325) | Ferrovial SA | Goldam Sachs | (156) | (4.416) | Fastighets AB Balder 'B' | HSBC | 1.442 |
| (21) | Ferrovial SA | Goldam Sachs | 11 | (9.708) | Fastighets AB Balder 'B' | Bank of America | |
| (1.532) | Ferrovial SA | HSBC | (1.805) | (4.470) | Fastighets AB Balder 'B' | Merrill Lynch | 453 |
| (22) | Ferrovial SA | HSBC | (567) | (1.032) | Fastighets AB Balder 'B' | BNP Paribas | 995 |
| (31) | Ferrovial SA (Right)† | Citibank | — | (897) | Getinge AB 'B' | Goldam Sachs | 458 |
| (2.812) | Grifols SA | Barclays Bank | 783 | (8.612) | Hennes & Mauritz AB 'B' | JP Morgan | (348) |
| (10.403) | Grifols SA | BNP Paribas | 1.003 | (804) | Hexagon AB 'B' | BNP Paribas | 265 |
| (543) | Grifols SA | Goldam Sachs | 52 | (23.946) | Hexagon AB 'B' | Bank of America | (3.332) |
| 19.100 | Grifols SA | HSBC | — | (804) | Hexagon AB 'B' | Merrill Lynch | (422) |
| 19.920 | Iberdrola SA | BNP Paribas | 4.801 | (2.191) | Hexagon AB 'B' | BNP Paribas | (12.557) |
| 5.427 | Iberdrola SA | Goldam Sachs | 1.308 | (4.656) | Hexagon AB 'B' | Goldam Sachs | (1.149) |
| 479 | Industria de Diseno Textil SA | Barclays Bank | 867 | 1.114 | Husqvarna AB 'B' | HSBC | (4.148) |
| 6.282 | Industria de Diseno Textil SA | BNP Paribas | 10.969 | 32.134 | Husqvarna AB 'B' | Bank of America | |
| 1.424 | Industria de Diseno Textil SA | Goldam Sachs | 2.487 | 9.505 | Husqvarna AB 'B' | Merrill Lynch | 43 |
| (787) | Naturgy Energy Group SA | Bank of America | | 300 | Industrivarden AB 'A' | Barclays Bank | 4.908 |
| (1.435) | Naturgy Energy Group SA | Merrill Lynch | (1.475) | 529 | Industrivarden AB 'C' | BNP Paribas | 368 |
| (4.400) | Naturgy Energy Group SA | Barclays Bank | (261) | (15.974) | Investment AB Latour 'B' | Goldam Sachs | 360 |
| (644) | Naturgy Energy Group SA | BNP Paribas | (8.249) | 868 | Investor AB 'B' | BNP Paribas | 641 |
| 10.903 | Repsol SA | HSBC | (442) | 1.093 | Investor AB 'B' | Goldam Sachs | (25.698) |
| (3.886) | Siemens Gamesa Renewable Energy SA | BNP Paribas | 12.322 | 8.132 | Investor AB 'B' | Bank of America | |
| (2.647) | Siemens Gamesa Renewable Energy SA | Barclays Bank | (645) | 241 | Kinnevik AB 'B' | Merrill Lynch | 13.877 |
| (1.534) | Siemens Gamesa Renewable Energy SA | BNP Paribas | (12.888) | 1.264 | Kinnevik AB 'B' | Bank of America | |
| (4.298) | Telefonica SA | Citibank | (255) | 686 | Kinnevik AB 'B' | Merrill Lynch | 599 |
| (5.553) | Telefonica SA | Bank of America | | (886) | L E Lundbergforetagen AB 'B' | BNP Paribas | 3.140 |
| (15.983) | Telefonica SA | Merrill Lynch | (1.386) | (2.462) | L E Lundbergforetagen AB 'B' | Citibank | 1.317 |
| (394) | Telefonica SA | Barclays Bank | (1.547) | (2.462) | L E Lundbergforetagen AB 'B' | Barclays Bank | (2.084) |
| (2.163) | Telefonica SA | BNP Paribas | (5.154) | (1.464) | Lifco AB 'B' | BNP Paribas | (6.242) |
| (6.108) | Telefonica SA | Goldam Sachs | (697) | (415) | Lifco AB 'B' | BNP Paribas | (2.959) |
| | | Citibank | (110) | (262) | Lundin Energy AB | Goldam Sachs | (839) |
| | | Goldam Sachs | (697) | (935) | Lundin Energy AB | HSBC | (1.342) |
| | | HSBC | (2.663) | (2) | NCC AB 'B' | HSBC | (6.931) |
| | | | (22.601) | (641) | Nibe Industrier AB 'B' | BNP Paribas | 1 |
| | | | | (2.187) | Nibe Industrier AB 'B' | Bank of America | |
| 952 | Alfa Laval AB | Bank of America | | (4.178) | Nibe Industrier AB 'B' | Merrill Lynch | 35 |
| | | Merrill Lynch | 1.115 | (2.047) | Nibe Industrier AB 'B' | Barclays Bank | 13 |
| 771 | Alfa Laval AB | Barclays Bank | 958 | (5.527) | Nibe Industrier AB 'B' | BNP Paribas | 230 |
| 3.742 | Alfa Laval AB | BNP Paribas | 4.382 | (2.472) | Nibe Industrier AB 'B' | Citibank | 13 |
| 586 | Alfa Laval AB | HSBC | 1.056 | 17.143 | Nordea Bank Abp | Goldam Sachs | 304 |
| 1.127 | Assa Abloy AB 'B' | Barclays Bank | 1.010 | (365) | Sagax AB 'B' | HSBC | (1.520) |
| 1.995 | Assa Abloy AB 'B' | BNP Paribas | 1.828 | 1.732 | Sandvik AB | BNP Paribas | 2.042 |
| 2.437 | Assa Abloy AB 'B' | Goldam Sachs | 2.233 | 655 | Sandvik AB | Barclays Bank | 104 |
| 328 | Assa Abloy AB 'B' | HSBC | 494 | 688 | Sandvik AB | Barclays Bank | 1.631 |
| | | | | | | Citibank | 617 |
| | | | | | | Goldam Sachs | 935 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--------------------------------------|-----------------|--|----------------------------|-------------------------------|-----------------|--|
| Schweden Fortsetzung | | | | Schweiz Fortsetzung | | | |
| (8.659) | Securitas AB 'B' | BNP Paribas | 1.851 | (12.392) | Clariant AG Reg | Bank of America | |
| (3.082) | Sinch AB | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (12.528) |
| | | Merrill Lynch | (411) | (2.165) | Credit Suisse Group | | |
| (3.300) | Sinch AB | Barclays Bank | (516) | | AG Reg | Barclays Bank | 86 |
| (4.193) | Sinch AB | BNP Paribas | (559) | (15.560) | Credit Suisse Group | | |
| (968) | Sinch AB | Citibank | (151) | | AG Reg | BNP Paribas | (3.551) |
| (4.365) | Sinch AB | Goldam Sachs | (582) | (465) | Credit Suisse Group | | |
| (7.318) | Sinch AB | HSBC | (6.456) | | AG Reg | Citibank | 18 |
| (550) | Sinch AB | JP Morgan | (485) | (4.294) | Credit Suisse Group | | |
| (1.928) | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | | | | AG Reg | Goldam Sachs | (1.083) |
| | | Goldam Sachs | 157 | (9.240) | Credit Suisse Group | | |
| (757) | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | | | | AG Reg | HSBC | (4.680) |
| | | HSBC | (324) | (228) | EMS-Chemie Holding | | |
| 4.190 | Skanska AB 'B' | Barclays Bank | 1.365 | | AG Reg | Barclays Bank | (3.683) |
| 4.021 | Skanska AB 'B' | BNP Paribas | 368 | (100) | EMS-Chemie Holding | | |
| 2.107 | SKF AB 'B' | BNP Paribas | 440 | | AG Reg | BNP Paribas | (990) |
| (4.768) | Svenska Cellulosa AB SCA 'B' | | | (1) | EMS-Chemie Holding | | |
| | | BNP Paribas | (437) | | AG Reg | Citibank | (16) |
| (2.785) | Svenska Cellulosa AB SCA 'B' | | | 254 | Geberit AG Reg | BNP Paribas | 476 |
| | | Goldam Sachs | (255) | 43 | Givaudan SA Reg | BNP Paribas | (5.333) |
| (1.915) | Svenska Handelsbanken AB 'A' | | | 1.327 | Holcim AG | Barclays Bank | 539 |
| | | BNP Paribas | 164 | 290 | Holcim AG | BNP Paribas | 199 |
| (865) | Svenska Handelsbanken AB 'A' | | | 1.672 | Julius Baer Group Ltd | Bank of America | |
| | | Goldam Sachs | 74 | | | Merrill Lynch | 3.694 |
| (107) | Svenska Handelsbanken AB 'A' | | | 176 | Julius Baer Group Ltd | Barclays Bank | 347 |
| | | JP Morgan | (15) | 1.480 | Julius Baer Group Ltd | BNP Paribas | 3.270 |
| 1.062 | Swedbank AB 'A' | BNP Paribas | (389) | 772 | Julius Baer Group Ltd | Goldam Sachs | 1.706 |
| 1.047 | Swedbank AB 'A' | Goldam Sachs | (384) | 31 | Julius Baer Group Ltd | HSBC | 121 |
| 1.560 | Tele2 AB 'B' | Barclays Bank | (1.628) | 376 | Kuehne + Nagel | | |
| 3.139 | Tele2 AB 'B' | BNP Paribas | (4.586) | | International AG Reg | Barclays Bank | (2.978) |
| 861 | Tele2 AB 'B' | Goldam Sachs | (1.258) | 111 | Kuehne + Nagel | | |
| 1.068 | Tele2 AB 'B' | HSBC | (1.044) | | International AG Reg | Citibank | (879) |
| 12.034 | Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | | | 98 | Kuehne + Nagel | | |
| | | BNP Paribas | 1.617 | | International AG Reg | Goldam Sachs | (623) |
| 4.611 | Telia Co AB | Barclays Bank | (249) | 84 | Kuehne + Nagel | | |
| 40.115 | Telia Co AB | BNP Paribas | (2.737) | | International AG Reg | HSBC | 445 |
| 2.936 | Telia Co AB | Citibank | (158) | 244 | Kuehne + Nagel | | |
| 2.451 | Telia Co AB | Goldam Sachs | (167) | | International AG Reg | JP Morgan | 1.748 |
| 10.821 | Telia Co AB | HSBC | 672 | (607) | Logitech International SA Reg | | |
| 7.484 | Telia Co AB | JP Morgan | 465 | | SA Reg | Goldam Sachs | 418 |
| 610 | Volvo AB 'B' | Goldam Sachs | 611 | (28) | Lonza Group AG Reg | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (910) |
| | | | (72.452) | (54) | Lonza Group AG Reg | Barclays Bank | (1.339) |
| | | | | (80) | Lonza Group AG Reg | BNP Paribas | (2.601) |
| | | | | (30) | Lonza Group AG Reg | Citibank | (744) |
| | | | | (133) | Lonza Group AG Reg | Goldam Sachs | (4.325) |
| | | | | 694 | Nestle SA Reg | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (2.796) |
| | | | | 252 | Nestle SA Reg | Barclays Bank | 599 |
| | | | | 336 | Nestle SA Reg | BNP Paribas | (2.234) |
| | | | | 327 | Nestle SA Reg | Citibank | 777 |
| | | | | 786 | Nestle SA Reg | Goldam Sachs | (5.226) |
| | | | | 159 | Nestle SA Reg | HSBC | (570) |
| | | | | 141 | Nestle SA Reg | JP Morgan | (506) |
| | | | | 2.103 | Novartis AG Reg | BNP Paribas | (1.907) |
| | | | | 762 | Novartis AG Reg | Goldam Sachs | (691) |
| | | | | 2.412 | Novartis AG Reg | JP Morgan | 8.245 |
| | | | | (15) | Partners Group Holding AG | Barclays Bank | (109) |
| | | | | (70) | Partners Group Holding AG | BNP Paribas | (1.605) |
| | | | | (11) | Partners Group Holding AG | Citibank | (80) |
| | | | | (19) | Partners Group Holding AG | HSBC | (907) |
| | | | | 325 | Roche Holding AG | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 1.626 |
| | | | | 492 | Roche Holding AG | Barclays Bank | 1.384 |
| | | | | 116 | Roche Holding AG | BNP Paribas | 580 |
| | | | | 419 | Roche Holding AG | HSBC | (8.210) |
| | | | | 88 | Roche Holding AG | JP Morgan | (1.724) |
| | | | | (502) | Schindler Holding AG | Barclays Bank | (3.113) |
| | | | | 29 | SGS SA Reg | BNP Paribas | (1.904) |
| | | | | 19 | SGS SA Reg | Citibank | (693) |
| | | | | 74 | SGS SA Reg | Goldam Sachs | (4.859) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------|---|-----------------------------------|------------------------------|-----------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| (9.202) | Hargreaves Lansdown Plc | BNP Paribas | 1.714 | (3.400) | Ocado Group Plc | Bank of America | |
| (796) | Hargreaves Lansdown Plc | Citibank | 146 | | | Merrill Lynch | (4.760) |
| (6.287) | Hargreaves Lansdown Plc | Goldam Sachs | 1.171 | (978) | Ocado Group Plc | Barclays Bank | (1.716) |
| (10.804) | Hargreaves Lansdown Plc | HSBC | (571) | (10.778) | Ocado Group Plc | BNP Paribas | (15.088) |
| (439) | Hikma Pharmaceuticals Plc | Bank of America | | (1.829) | Ocado Group Plc | Goldam Sachs | (2.560) |
| | | Merrill Lynch | 11 | (5.750) | Ocado Group Plc | HSBC | (10.950) |
| (3.194) | Hikma Pharmaceuticals Plc | Barclays Bank | 1.990 | (1.076) | Pearson Plc | Bank of America | |
| (896) | Hikma Pharmaceuticals Plc | BNP Paribas | 23 | | | Merrill Lynch | 123 |
| (1.940) | Hikma Pharmaceuticals Plc | HSBC | (293) | (1.060) | Pearson Plc | BNP Paribas | 35 |
| (22.389) | HSBC Holdings Plc | BNP Paribas | (9.738) | (1.126) | Pearson Plc | Goldam Sachs | 37 |
| 2.788 | Informa Plc | BNP Paribas | (330) | 81 | Persimmon Plc | Barclays Bank | 25 |
| 78 | InterContinental Hotels Group Plc | Bank of America | | 3.290 | Persimmon Plc | BNP Paribas | 2.717 |
| | | Merrill Lynch | 126 | 553 | Persimmon Plc | Citibank | 171 |
| 3.221 | InterContinental Hotels Group Plc | Barclays Bank | 7.299 | 774 | Persimmon Plc | Goldam Sachs | 639 |
| 1.977 | InterContinental Hotels Group Plc | BNP Paribas | 3.186 | 347 | Persimmon Plc | HSBC | 605 |
| | | | | 227 | Persimmon Plc | JP Morgan | 396 |
| 79 | InterContinental Hotels Group Plc | Goldam Sachs | 127 | (11.504) | Phoenix Group Holdings Plc | Barclays Bank | 1.101 |
| 4 | Intertek Group Plc | Barclays Bank | (1) | (31.371) | Phoenix Group Holdings Plc | BNP Paribas | (1.580) |
| 3.719 | Intertek Group Plc | BNP Paribas | (9.832) | (698) | Phoenix Group Holdings Plc | Citibank | 67 |
| 466 | Intertek Group Plc | Citibank | (94) | (4.874) | Phoenix Group Holdings Plc | Goldam Sachs | (245) |
| 1.270 | Intertek Group Plc | Goldam Sachs | (3.358) | (1.327) | Prudential Plc | Barclays Bank | (501) |
| 903 | Intertek Group Plc | HSBC | (2.342) | (4.464) | Prudential Plc | Goldam Sachs | (4.574) |
| 344 | Intertek Group Plc | JP Morgan | (892) | (1.414) | Reckitt Benckiser Group Plc | Goldam Sachs | 5.945 |
| 8.344 | J Sainsbury Plc | Bank of America | | (231) | Reckitt Benckiser Group Plc | HSBC | 663 |
| | | Merrill Lynch | (1.712) | 1.236 | RELX Plc | Barclays Bank | (420) |
| 9.076 | J Sainsbury Plc | Barclays Bank | (571) | 802 | RELX Plc | BNP Paribas | (343) |
| 21.036 | J Sainsbury Plc | BNP Paribas | (4.317) | 2.134 | RELX Plc | Goldam Sachs | (913) |
| 15.811 | J Sainsbury Plc | Goldam Sachs | (3.244) | 1.104 | RELX Plc | HSBC | (347) |
| 6.545 | J Sainsbury Plc | JP Morgan | (387) | (1.738) | Rentokil Initial Plc | Barclays Bank | (243) |
| 8.218 | JD Sports Fashion Plc | Bank of America | | (7.322) | Rentokil Initial Plc | BNP Paribas | 756 |
| | | Merrill Lynch | (828) | (2.948) | Rentokil Initial Plc | Citibank | (412) |
| 27.090 | JD Sports Fashion Plc | Barclays Bank | (341) | (3.056) | Rentokil Initial Plc | Goldam Sachs | 315 |
| 22.745 | JD Sports Fashion Plc | BNP Paribas | (1.707) | (2.863) | Rentokil Initial Plc | HSBC | 368 |
| 16.424 | JD Sports Fashion Plc | Citibank | (207) | (1.462) | Rentokil Initial Plc | JP Morgan | 188 |
| 12.920 | JD Sports Fashion Plc | Goldam Sachs | (1.301) | 730 | Rio Tinto Plc | BNP Paribas | 4.328 |
| 10.486 | JD Sports Fashion Plc | HSBC | 673 | 210 | Rio Tinto Plc | Citibank | 656 |
| 28.610 | JD Sports Fashion Plc | JP Morgan | 1.837 | 362 | Rio Tinto Plc | JP Morgan | 2.525 |
| 41.321 | Kingfisher Plc | BNP Paribas | 4.318 | (9.508) | Rolls-Royce Holdings Plc | Bank of America | |
| 14.041 | Legal & General Group Plc | Bank of America | | (56.999) | Rolls-Royce Holdings Plc | Merrill Lynch | (390) |
| | | Merrill Lynch | 1.626 | (54.233) | Rolls-Royce Holdings Plc | BNP Paribas | (4.298) |
| 10.141 | Legal & General Group Plc | Barclays Bank | 472 | (35.470) | Rolls-Royce Holdings Plc | Goldam Sachs | (4.090) |
| 62.728 | Legal & General Group Plc | BNP Paribas | 7.265 | (620) | Rolls-Royce Holdings Plc | HSBC | (3.648) |
| 6.785 | Legal & General Group Plc | Citibank | 316 | 1.526 | Rolls-Royce Holdings Plc | JP Morgan | (64) |
| 7.699 | Legal & General Group Plc | Goldam Sachs | 892 | | Sage Group Plc | Bank of America | |
| 2.077 | Legal & General Group Plc | HSBC | 688 | 3.089 | Sage Group Plc | Merrill Lynch | (292) |
| 6.971 | Legal & General Group Plc | JP Morgan | 2.308 | 9.780 | Sage Group Plc | Barclays Bank | (211) |
| (709) | London Stock Exchange Group Plc | Bank of America | | 7.662 | Sage Group Plc | BNP Paribas | (1.509) |
| | | Merrill Lynch | (2.624) | 3.707 | Sage Group Plc | Citibank | (752) |
| (5) | London Stock Exchange Group Plc | BNP Paribas | (19) | 3.707 | Sage Group Plc | Goldam Sachs | (709) |
| | | | | 1.933 | Sage Group Plc | HSBC | (151) |
| (3) | London Stock Exchange Group Plc | Citibank | (5) | 1.720 | Sage Group Plc | JP Morgan | (134) |
| 6.707 | M&G Plc | Citibank | 68 | (327) | Schroders Plc | Goldam Sachs | (296) |
| 3.806 | M&G Plc | Goldam Sachs | 187 | (2.130) | Severn Trent Plc | BNP Paribas | 5.175 |
| (22.872) | Melrose Industries Plc | Barclays Bank | (3.945) | (264) | Severn Trent Plc | Goldam Sachs | 641 |
| (31.901) | Melrose Industries Plc | Citibank | (5.502) | (1.610) | Smith & Nephew Plc | BNP Paribas | (91) |
| (2.311) | Melrose Industries Plc | Goldam Sachs | (550) | (527) | Smith & Nephew Plc | Citibank | (70) |
| 1.191 | Mondi Plc | Barclays Bank | 600 | (1.060) | Smith & Nephew Plc | Goldam Sachs | (60) |
| 1.121 | Mondi Plc | BNP Paribas | 85 | 1.112 | Smiths Group Plc | BNP Paribas | 805 |
| 1.071 | Mondi Plc | HSBC | (276) | 2.211 | Smiths Group Plc | Goldam Sachs | 1.600 |
| 513 | Mondi Plc | JP Morgan | (132) | 2.306 | Smiths Group Plc | HSBC | 3.382 |
| (28.969) | National Grid Plc | BNP Paribas | 22.064 | 173 | Spirax-Sarco Engineering Plc | BNP Paribas | 410 |
| (36.138) | Natwest Group Plc | Barclays Bank | (4.959) | (2.084) | SSE Plc | Barclays Bank | 3.948 |
| (400) | Natwest Group Plc | BNP Paribas | (90) | (11.531) | SSE Plc | BNP Paribas | 14.952 |
| (9.125) | Natwest Group Plc | Goldam Sachs | (2.045) | (4.338) | SSE Plc | Goldam Sachs | 5.625 |
| 399 | Next Plc | Citibank | 1.617 | (2.270) | St James's Place Plc | Barclays Bank | (914) |
| 181 | Next Plc | Goldam Sachs | (178) | (869) | St James's Place Plc | Goldam Sachs | (498) |
| | | | | (395) | Standard Chartered Plc | Barclays Bank | (125) |
| | | | | (6.286) | Standard Chartered Plc | BNP Paribas | (3.134) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|---|---|------------------------------------|-----------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 3.715 | Standard Life Aberdeen Plc | Citibank | 200 | 160 | Advanced Micro Devices Inc | Goldam Sachs | 1.149 |
| 3.472 | Standard Life Aberdeen Plc | Goldam Sachs | 316 | 62 | Advanced Micro Devices Inc | HSBC | 934 |
| 17.629 | Standard Life Aberdeen Plc | HSBC | 3.667 | 292 | Advanced Micro Devices Inc | JP Morgan | 4.398 |
| 6.287 | Taylor Wimpey Plc | Bank of America | | (262) | AerCap Holdings NV | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 290 | | | Merrill Lynch | (747) |
| 10.699 | Taylor Wimpey Plc | Barclays Bank | 269 | (199) | AerCap Holdings NV | Barclays Bank | (109) |
| 28.306 | Taylor Wimpey Plc | BNP Paribas | 1.586 | (2.047) | AerCap Holdings NV | BNP Paribas | (5.834) |
| 24.622 | Taylor Wimpey Plc | Citibank | 620 | (512) | AerCap Holdings NV | Citibank | (282) |
| 1.126 | Taylor Wimpey Plc | HSBC | 133 | (203) | AerCap Holdings NV | Goldam Sachs | (579) |
| 12.437 | Taylor Wimpey Plc | JP Morgan | 1.464 | (413) | AerCap Holdings NV | HSBC | (2.664) |
| (419) | Unilever Plc | BNP Paribas | (219) | (2.482) | Affirm Holdings Inc | Barclays Bank | (12.733) |
| (5.262) | Unilever Plc | HSBC | (9.654) | (1.303) | Affirm Holdings Inc | BNP Paribas | (8.730) |
| 8.022 | United Utilities Group Plc | BNP Paribas | (7.221) | (366) | Aflac Inc | Barclays Bank | (1.171) |
| 4.278 | United Utilities Group Plc | Goldam Sachs | (3.851) | (595) | Aflac Inc | BNP Paribas | (2.106) |
| (5.994) | Vodafone Group Plc | Citibank | (395) | (431) | Aflac Inc | Citibank | (1.379) |
| (33.998) | Vodafone Group Plc | Goldam Sachs | (4.828) | (1.434) | Aflac Inc | Goldam Sachs | (5.076) |
| 898 | Whitbread Plc | Bank of America | | 387 | Agilent Technologies Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (441) | | | Merrill Lynch | 3.421 |
| 1.453 | Whitbread Plc | BNP Paribas | 689 | 1.169 | Agilent Technologies Inc | Barclays Bank | 3.694 |
| 475 | Whitbread Plc | Citibank | 281 | 122 | Agilent Technologies Inc | BNP Paribas | 1.078 |
| 2.373 | Whitbread Plc | Goldam Sachs | 2.091 | 1.073 | Agilent Technologies Inc | Goldam Sachs | 9.485 |
| 1.882 | Whitbread Plc | HSBC | 3.696 | 1.264 | Agilent Technologies Inc | HSBC | 20.262 |
| 12.883 | WPP Plc | BNP Paribas | (10.769) | (338) | Air Products & Chemicals Inc | BNP Paribas | (4.820) |
| | | | 53.721 | (922) | Air Products & Chemicals Inc | Goldam Sachs | (13.148) |
| | | | | 132 | Airbnb Inc 'A' | Barclays Bank | 657 |
| (175) | 10X Genomics Inc 'A' | Bank of America | | 568 | Airbnb Inc 'A' | BNP Paribas | 2.170 |
| | | Merrill Lynch | (945) | 374 | Airbnb Inc 'A' | Citibank | 1.863 |
| (122) | 10X Genomics Inc 'A' | Barclays Bank | (237) | 529 | Airbnb Inc 'A' | Goldam Sachs | 2.021 |
| (67) | 10X Genomics Inc 'A' | BNP Paribas | (362) | 183 | Airbnb Inc 'A' | HSBC | (203) |
| (407) | 10X Genomics Inc 'A' | Goldam Sachs | (2.198) | 374 | Airbnb Inc 'A' | JP Morgan | (432) |
| (205) | 10X Genomics Inc 'A' | HSBC | (882) | 162 | Akamai Technologies Inc | Barclays Bank | 267 |
| 613 | 3M Co | Barclays Bank | 1.410 | 85 | Akamai Technologies Inc | BNP Paribas | 137 |
| 256 | 3M Co | BNP Paribas | (978) | 117 | Akamai Technologies Inc | Citibank | 193 |
| 242 | 3M Co | Goldam Sachs | (924) | 84 | Akamai Technologies Inc | HSBC | 423 |
| 44 | 3M Co | HSBC | (251) | (225) | Albermarle Corp | Barclays Bank | (3.787) |
| 237 | A O Smith Corp | Bank of America | | (153) | Albermarle Corp | BNP Paribas | (5.118) |
| | | Merrill Lynch | 199 | (54) | Albermarle Corp | Goldam Sachs | (1.806) |
| 542 | A O Smith Corp | Barclays Bank | 786 | 17 | Align Technology Inc | BNP Paribas | 60 |
| 1.102 | A O Smith Corp | BNP Paribas | 926 | 173 | Align Technology Inc | Goldam Sachs | 606 |
| 184 | A O Smith Corp | Citibank | 267 | (584) | Allegion Plc | BNP Paribas | 228 |
| 363 | A O Smith Corp | Goldam Sachs | 305 | (111) | Allegion Plc | Goldam Sachs | 43 |
| 1.157 | A O Smith Corp | HSBC | 35 | (1.004) | Allstate Corp | BNP Paribas | (7.731) |
| 192 | Abbott Laboratories | HSBC | 1.513 | (389) | Allstate Corp | Citibank | (3.614) |
| (123) | AbbVie Inc | Bank of America | | (423) | Allstate Corp | Goldam Sachs | (3.257) |
| | | Merrill Lynch | 970 | 3.855 | Ally Financial Inc | Barclays Bank | 11.064 |
| (66) | AbbVie Inc | Barclays Bank | 100 | 2.166 | Ally Financial Inc | BNP Paribas | 9.812 |
| (83) | AbbVie Inc | BNP Paribas | 137 | 469 | Ally Financial Inc | HSBC | 1.248 |
| (148) | AbbVie Inc | Citibank | 182 | (38) | Alnylam Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 211 |
| (84) | AbbVie Inc | HSBC | 284 | (134) | Alnylam Pharmaceuticals Inc | BNP Paribas | 113 |
| 538 | ABIOMED Inc | Barclays Bank | 5.751 | 67 | Alphabet Inc 'A' | Barclays Bank | 1.365 |
| 37 | ABIOMED Inc | BNP Paribas | 226 | 41 | Alphabet Inc 'A' | HSBC | (4) |
| 90 | ABIOMED Inc | Citibank | 962 | (7) | Amazon.com Inc | BNP Paribas | (1.263) |
| 277 | ABIOMED Inc | Goldam Sachs | 1.695 | (30) | Amazon.com Inc | Goldam Sachs | (3.598) |
| 347 | Accenture Plc 'A' | Barclays Bank | 5.823 | (15) | Amazon.com Inc | HSBC | (2.376) |
| 129 | Accenture Plc 'A' | BNP Paribas | 1.806 | (3.020) | AMC Entertainment Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (8.547) |
| 116 | Accenture Plc 'A' | Citibank | 2.148 | 195 | AMERCO | Barclays Bank | (4.368) |
| 129 | Accenture Plc 'A' | HSBC | 2.355 | 47 | AMERCO | BNP Paribas | (1.377) |
| 307 | Accenture Plc 'A' | JP Morgan | 4.485 | 38 | AMERCO | Goldam Sachs | (1.113) |
| 284 | Adobe Inc | Bank of America | | 19 | AMERCO | HSBC | (695) |
| | | Merrill Lynch | 5.033 | 23 | AMERCO | JP Morgan | (841) |
| 877 | Adobe Inc | Barclays Bank | 9.033 | 93 | American Express Co | Bank of America | |
| 26 | Adobe Inc | BNP Paribas | 221 | | | Merrill Lynch | 1.574 |
| 25 | Adobe Inc | Goldam Sachs | 375 | 53 | American Express Co | Barclays Bank | 542 |
| 42 | Adobe Inc | HSBC | 519 | 66 | American Express Co | BNP Paribas | 45 |
| 126 | Advance Auto Parts Inc | Barclays Bank | 937 | | | | |
| 101 | Advance Auto Parts Inc | BNP Paribas | (2.324) | | | | |
| 231 | Advanced Micro Devices Inc | Barclays Bank | 1.467 | | | | |
| 1.326 | Advanced Micro Devices Inc | BNP Paribas | 9.521 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 66 | American Express Co | Goldam Sachs | 847 | 20 | Apple Inc | Barclays Bank | 96 |
| 107 | American Financial Group Inc | Barclays Bank | 540 | 715 | Apple Inc | BNP Paribas | 1.695 |
| 89 | American Financial Group Inc | Citibank | 449 | 99 | Apple Inc | Citibank | 475 |
| 86 | American Financial Group Inc | Goldam Sachs | (570) | 1.002 | Apple Inc | Goldam Sachs | 2.375 |
| 410 | American Financial Group Inc | HSBC | (2.382) | 354 | Apple Inc | HSBC | (1.469) |
| 171 | American International Group Inc | Barclays Bank | 280 | 35 | Apple Inc | JP Morgan | (145) |
| 352 | American International Group Inc | BNP Paribas | (25) | 173 | Applied Materials Inc | Barclays Bank | 1.227 |
| 991 | American International Group Inc | Goldam Sachs | (69) | 464 | Applied Materials Inc | BNP Paribas | 3.787 |
| 796 | American Water Works Co Inc | BNP Paribas | 2.484 | 3.067 | Applied Materials Inc | Goldam Sachs | 20.074 |
| 105 | Ameriprise Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.608 | 87 | Applied Materials Inc | HSBC | 981 |
| 219 | Ameriprise Financial Inc | BNP Paribas | 3.353 | 153 | Applied Materials Inc | JP Morgan | 1.479 |
| 148 | Ameriprise Financial Inc | Goldam Sachs | 2.266 | (506) | Aptiv Plc | BNP Paribas | (4.169) |
| 357 | Ameriprise Financial Inc | JP Morgan | 5.794 | (79) | Aptiv Plc | Goldam Sachs | (651) |
| 143 | AmerisourceBergen Corp | Goldam Sachs | 832 | (572) | Aramark | Bank of America | (378) |
| (240) | AMETEK Inc | Bank of America Merrill Lynch | 46 | (2.134) | Aramark | Barclays Bank | (3.500) |
| (135) | AMETEK Inc | Barclays Bank | (127) | (965) | Aramark | BNP Paribas | (637) |
| (50) | AMETEK Inc | BNP Paribas | 10 | (269) | Aramark | Citibank | (441) |
| (122) | AMETEK Inc | Goldam Sachs | 23 | (333) | Aramark | HSBC | (7) |
| (105) | Amgen Inc | Bank of America Merrill Lynch | (557) | 1.006 | Arch Capital Group Ltd | BNP Paribas | 946 |
| (119) | Amgen Inc | BNP Paribas | (888) | 3.692 | Archer-Daniels-Midland Co | Barclays Bank | 12.331 |
| (291) | Amgen Inc | HSBC | (3.094) | 1.643 | Arista Networks Inc | Barclays Bank | 986 |
| (1.492) | Amphenol Corp 'A' | Barclays Bank | (1.582) | 823 | Arista Networks Inc | BNP Paribas | (1.728) |
| (3.146) | Amphenol Corp 'A' | BNP Paribas | (2.894) | 322 | Arista Networks Inc | Goldam Sachs | (676) |
| (522) | Amphenol Corp 'A' | Citibank | (553) | 214 | Arista Networks Inc | HSBC | (89) |
| (746) | Amphenol Corp 'A' | Goldam Sachs | (686) | (271) | Arrow Electronics Inc | Bank of America | 1.222 |
| (973) | Analog Devices Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.599) | (88) | Arrow Electronics Inc | Goldam Sachs | 397 |
| (446) | Analog Devices Inc | Barclays Bank | (1.650) | (409) | Arthur J Gallagher & Co | Bank of America | (755) |
| (626) | Analog Devices Inc | BNP Paribas | (4.889) | (1.237) | Arthur J Gallagher & Co | Barclays Bank | (5.511) |
| (366) | Analog Devices Inc | Goldam Sachs | (2.858) | (284) | Arthur J Gallagher & Co | BNP Paribas | (524) |
| (28) | Analog Devices Inc | HSBC | (364) | (133) | Arthur J Gallagher & Co | Goldam Sachs | (245) |
| 226 | ANSYS Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.007 | 720 | Asana Inc 'A' | BNP Paribas | (238) |
| 156 | ANSYS Inc | Barclays Bank | 359 | 150 | Assurant Inc | Barclays Bank | 80 |
| 120 | ANSYS Inc | BNP Paribas | 1.066 | 315 | Assurant Inc | Citibank | 167 |
| 93 | ANSYS Inc | Citibank | 214 | 117 | Assurant Inc | Goldam Sachs | (171) |
| 117 | ANSYS Inc | Goldam Sachs | 1.039 | (3.366) | AT&T Inc | BNP Paribas | (3.147) |
| 41 | ANSYS Inc | JP Morgan | 310 | (1.830) | AT&T Inc | Goldam Sachs | (1.711) |
| (195) | Anthem Inc | Goldam Sachs | (4.618) | (773) | Atmos Energy Corp | Barclays Bank | (1.739) |
| (91) | Anthem Inc | HSBC | (2.401) | (90) | Atmos Energy Corp | BNP Paribas | (248) |
| (313) | Aon Plc 'A' | Barclays Bank | (2.883) | 1.160 | Autodesk Inc | Barclays Bank | 26.309 |
| (73) | Aon Plc 'A' | BNP Paribas | 155 | 313 | Autodesk Inc | BNP Paribas | 4.260 |
| (28) | Aon Plc 'A' | Citibank | (258) | 52 | Autodesk Inc | HSBC | 1.033 |
| (307) | Aon Plc 'A' | Goldam Sachs | 654 | 305 | Autodesk Inc | JP Morgan | 6.060 |
| 1 | Apartment Income Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1 | 176 | Automatic Data Processing Inc | Bank of America | 2.520 |
| 1 | Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT) ¹ | Bank of America Merrill Lynch | — | 54 | Automatic Data Processing Inc | Barclays Bank | 538 |
| (1.802) | Apollo Global Management Inc | Barclays Bank | (6.649) | 150 | Automatic Data Processing Inc | BNP Paribas | 2.148 |
| (1.673) | Apollo Global Management Inc | BNP Paribas | (9.034) | 336 | Automatic Data Processing Inc | Goldam Sachs | 4.812 |
| (199) | Apollo Global Management Inc | Citibank | (734) | 47 | Automatic Data Processing Inc | JP Morgan | 455 |
| (249) | Apollo Global Management Inc | Goldam Sachs | (1.345) | 6 | AutoZone Inc | BNP Paribas | 277 |
| 503 | Apple Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.747 | 16 | AutoZone Inc | Goldam Sachs | 738 |
| | | | | (996) | Avalara Inc | Bank of America | (8.337) |
| | | | | (1.602) | Avalara Inc | Merrill Lynch | (6.120) |
| | | | | (507) | Avalara Inc | Barclays Bank | (4.244) |
| | | | | (991) | Avantor Inc | Goldam Sachs | (4.777) |
| | | | | (903) | Avantor Inc | Barclays Bank | (623) |
| | | | | (2.614) | Avantor Inc | BNP Paribas | (4.130) |
| | | | | (302) | Avantor Inc | Goldam Sachs | (477) |
| | | | | 1.537 | Avery Dennison Corp | Barclays Bank | 5.994 |
| | | | | 704 | Avery Dennison Corp | Goldam Sachs | (2.020) |
| | | | | 1.527 | Baker Hughes Co | Goldam Sachs | 3.543 |
| | | | | 3.275 | Baker Hughes Co | HSBC | 23.580 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-------------------------------|---|---|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (536) | Ball Corp | BNP Paribas | 182 | 9 | Booking Holdings Inc | BNP Paribas | (276) |
| (626) | Ball Corp | Goldam Sachs | 213 | 8 | Booking Holdings Inc | Goldam Sachs | 1.204 |
| 789 | Bank of America Corp | Goldam Sachs | 1.878 | 14 | Booking Holdings Inc | JP Morgan | 2.792 |
| 230 | Bank of New York Mellon Corp | Bank of America Merrill Lynch | 662 | 138 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | 426 |
| 259 | Bank of New York Mellon Corp | Barclays Bank | 373 | 277 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | BNP Paribas | 856 |
| 700 | Bank of New York Mellon Corp | BNP Paribas | 2.016 | 186 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Goldam Sachs | 575 |
| 687 | Bank of New York Mellon Corp | Citibank | 989 | 420 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | JP Morgan | 1.638 |
| 821 | Bank of New York Mellon Corp | JP Morgan | 2.389 | 256 | BorgWarner Inc | Bank of America Merrill Lynch | 563 |
| (17.184) | Bank OZK | JP Morgan | (24.917) | 824 | BorgWarner Inc | HSBC | 2.332 |
| (352) | Baxter International Inc | BNP Paribas | (641) | (4.192) | Boston Scientific Corp | Barclays Bank | (4.695) |
| (1.538) | Baxter International Inc | Citibank | (3.291) | (1.364) | Boston Scientific Corp | BNP Paribas | (1.623) |
| (663) | Baxter International Inc | Goldam Sachs | (1.207) | (213) | Boston Scientific Corp | HSBC | (579) |
| (203) | Becton Dickinson and Co | Bank of America Merrill Lynch | (4) | (165) | Bristol-Myers Squibb Co | Barclays Bank | 411 |
| (809) | Becton Dickinson and Co | BNP Paribas | (16) | (824) | Bristol-Myers Squibb Co | BNP Paribas | 2.225 |
| (583) | Becton Dickinson and Co | Citibank | 2.384 | (777) | Bristol-Myers Squibb Co | Goldam Sachs | 2.098 |
| (297) | Becton Dickinson and Co | Goldam Sachs | (6) | (367) | Broadcom Inc | Barclays Bank | (19.425) |
| (813) | Bentley Systems Inc 'B' | Barclays Bank | (1.415) | (256) | Broadcom Inc | BNP Paribas | (743) |
| (2.774) | Bentley Systems Inc 'B' | BNP Paribas | (7.240) | (226) | Broadcom Inc | Goldam Sachs | 764 |
| (352) | Bentley Systems Inc 'B' | Goldam Sachs | (919) | 161 | Broadridge Financial Solutions Inc | BNP Paribas | 1.055 |
| (252) | Berkshire Hathaway Inc 'B' | BNP Paribas | (1.686) | 90 | Broadridge Financial Solutions Inc | Goldam Sachs | 590 |
| (42) | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Goldam Sachs | (281) | (413) | Brown & Brown Inc | Bank of America Merrill Lynch | (578) |
| (22) | Berkshire Hathaway Inc 'B' | JP Morgan | (66) | (1.366) | Brown & Brown Inc | Barclays Bank | (3.948) |
| 127 | Best Buy Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (279) | (2.168) | Brown & Brown Inc | BNP Paribas | (3.035) |
| 228 | Best Buy Co Inc | Barclays Bank | 2.275 | (314) | Brown & Brown Inc | Citibank | (907) |
| 316 | Best Buy Co Inc | BNP Paribas | (695) | (101) | Brown & Brown Inc | Goldam Sachs | (141) |
| 144 | Best Buy Co Inc | Citibank | 1.437 | (202) | Brown & Brown Inc | HSBC | (461) |
| 204 | Best Buy Co Inc | Goldam Sachs | 2.399 | (730) | Brown-Forman Corp 'B' | BNP Paribas | 942 |
| (423) | Bill.com Holdings Inc | BNP Paribas | (4.890) | 912 | Bunge Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 4.241 |
| 70 | Biogen Inc | Bank of America Merrill Lynch | 270 | 504 | Bunge Ltd | BNP Paribas | 2.344 |
| 37 | Biogen Inc | Barclays Bank | 105 | 1.146 | Bunge Ltd | Goldam Sachs | 5.329 |
| 69 | Biogen Inc | BNP Paribas | 266 | (480) | Burlington Stores Inc | Barclays Bank | (4.522) |
| 100 | Biogen Inc | Citibank | 284 | (93) | Burlington Stores Inc | BNP Paribas | 706 |
| 216 | Biogen Inc | Goldam Sachs | 834 | (235) | Burlington Stores Inc | Goldam Sachs | 1.784 |
| 43 | Biogen Inc | JP Morgan | 632 | (24) | Cable One Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.872) |
| (134) | BioMarin Pharmaceutical Inc | Barclays Bank | 470 | (35) | Cable One Inc | Barclays Bank | (2.410) |
| (347) | BioMarin Pharmaceutical Inc | BNP Paribas | 463 | (24) | Cable One Inc | BNP Paribas | (3.872) |
| (206) | BioMarin Pharmaceutical Inc | Citibank | 723 | (13) | Cable One Inc | Goldam Sachs | (2.097) |
| (1.593) | BioMarin Pharmaceutical Inc | Goldam Sachs | 749 | (10) | Cable One Inc | HSBC | (1.745) |
| (260) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Barclays Bank | (2.636) | 171 | Cadence Design Systems Inc | Barclays Bank | 941 |
| (82) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | BNP Paribas | (2.608) | 5.620 | Cadence Design Systems Inc | Citibank | 30.910 |
| (57) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Goldam Sachs | (1.813) | 391 | Cadence Design Systems Inc | HSBC | 6.467 |
| (34) | Bio-Techne Corp | Bank of America Merrill Lynch | (483) | 3 | Cadence Design Systems Inc | JP Morgan | 48 |
| (85) | Bio-Techne Corp | Barclays Bank | (1.005) | (916) | Caesars Entertainment Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.292 |
| (121) | Bio-Techne Corp | BNP Paribas | (1.718) | (260) | Caesars Entertainment Inc | Barclays Bank | (606) |
| (40) | Bio-Techne Corp | Goldam Sachs | (568) | (2.699) | Caesars Entertainment Inc | BNP Paribas | 3.806 |
| (85) | Blackstone Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.116) | (986) | Caesars Entertainment Inc | Goldam Sachs | 1.390 |
| (178) | Blackstone Group Inc 'A' | BNP Paribas | (2.337) | (369) | Caesars Entertainment Inc | HSBC | 875 |
| (254) | Blackstone Group Inc 'A' | Goldam Sachs | (3.335) | (4.550) | Campbell Soup Co | BNP Paribas | 15.743 |
| (258) | Block Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.077) | (138) | Campbell Soup Co | Citibank | (144) |
| (553) | Block Inc | Barclays Bank | (2.406) | (3.989) | Campbell Soup Co | Goldam Sachs | 13.802 |
| (814) | Block Inc | BNP Paribas | (6.553) | 871 | Capital One Financial Corp | Barclays Bank | 7.282 |
| (48) | Block Inc | Citibank | (209) | 112 | Capital One Financial Corp | BNP Paribas | 1.477 |
| (391) | Block Inc | Goldam Sachs | (3.148) | 1.591 | Cardinal Health Inc | BNP Paribas | 175 |
| (412) | Block Inc | HSBC | (1.603) | 247 | Carlyle Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 264 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 886 | Carlyle Group Inc | Barclays Bank | 1.728 | (290) | Chevron Corp | BNP Paribas | (2.126) |
| 1.014 | Carlyle Group Inc | BNP Paribas | 1.085 | (138) | Chevron Corp | Citibank | (1.190) |
| 170 | Carlyle Group Inc | JP Morgan | 529 | (250) | Chevron Corp | Goldam Sachs | (1.833) |
| (19) | CarMax Inc | Bank of America | | (509) | Chevron Corp | HSBC | (10.735) |
| | | Merrill Lynch | (100) | (1.206) | Chevy Inc 'A' | Bank of America | |
| (1.607) | CarMax Inc | Barclays Bank | (11.265) | | | Merrill Lynch | 302 |
| (582) | CarMax Inc | BNP Paribas | (3.050) | (1.366) | Chevy Inc 'A' | Barclays Bank | (1.940) |
| (303) | CarMax Inc | Citibank | (2.124) | (1.130) | Chevy Inc 'A' | BNP Paribas | 283 |
| (785) | CarMax Inc | Goldam Sachs | (4.113) | (1.661) | Chevy Inc 'A' | Citibank | (2.359) |
| (271) | CarMax Inc | HSBC | (1.379) | 20 | Chipotle Mexican Grill Inc | Barclays Bank | 2.023 |
| (2.113) | Carnival Corp | Barclays Bank | (1.944) | 26 | Chipotle Mexican Grill Inc | BNP Paribas | 2.389 |
| (13.499) | Carnival Corp | BNP Paribas | 810 | 11 | Chipotle Mexican Grill Inc | Citibank | 1.113 |
| (10.496) | Carnival Corp | Goldam Sachs | (3.986) | 19 | Chipotle Mexican Grill Inc | Goldam Sachs | 1.746 |
| 1.069 | Carrier Global Corp | BNP Paribas | (941) | (1.885) | Church & Dwight Co Inc | Barclays Bank | 1.093 |
| (2.176) | Carvana Co | Barclays Bank | (2.773) | (1.347) | Church & Dwight Co Inc | Goldam Sachs | 13.160 |
| (2.035) | Carvana Co | BNP Paribas | 13.940 | 194 | Cigna Corp | Bank of America | |
| (626) | Carvana Co | Goldam Sachs | 2.010 | | | Merrill Lynch | 735 |
| (287) | Carvana Co | HSBC | 2.072 | 121 | Cigna Corp | Goldam Sachs | 459 |
| (1.723) | Catalent Inc | Bank of America | | (845) | Cincinnati Financial Corp | HSBC | (1.251) |
| | | Merrill Lynch | (8.839) | (85) | Cintas Corp | Goldam Sachs | (1.360) |
| (178) | Catalent Inc | Goldam Sachs | (913) | (1.513) | Cisco Systems Inc | HSBC | (2.295) |
| (269) | Caterpillar Inc | Goldam Sachs | (2.617) | 882 | Citigroup Inc | BNP Paribas | 5.389 |
| 161 | Cboe Global Markets Inc | Bank of America | | 570 | Citigroup Inc | Goldam Sachs | 3.483 |
| | | Merrill Lynch | 340 | (1.559) | Citizens Financial Group Inc | BNP Paribas | (4.163) |
| 88 | Cboe Global Markets Inc | Barclays Bank | 330 | (544) | Clarivate Plc | Barclays Bank | — |
| 79 | Cboe Global Markets Inc | HSBC | 332 | (1.879) | Clarivate Plc | BNP Paribas | (714) |
| 230 | Cboe Global Markets Inc | JP Morgan | 966 | (7.587) | Clarivate Plc | Goldam Sachs | (2.883) |
| 441 | CBRE Group Inc 'A' | Barclays Bank | 1.261 | (424) | Clarivate Plc | HSBC | (72) |
| 476 | CBRE Group Inc 'A' | BNP Paribas | 1.571 | (20) | Clorox Co | BNP Paribas | 235 |
| 2 | CBRE Group Inc 'A' | Citibank | 6 | (1.663) | Clorox Co | Goldam Sachs | 19.507 |
| 506 | CBRE Group Inc 'A' | Goldam Sachs | 1.670 | (36) | Cloudflare Inc 'A' | Bank of America | |
| 756 | CBRE Group Inc 'A' | HSBC | 2.737 | | | Merrill Lynch | 35 |
| 231 | CBRE Group Inc 'A' | JP Morgan | 836 | (652) | Cloudflare Inc 'A' | Barclays Bank | 241 |
| 75 | CDW Corp | Barclays Bank | 563 | (247) | Cloudflare Inc 'A' | BNP Paribas | 242 |
| 238 | CDW Corp | BNP Paribas | (99) | (559) | Cloudflare Inc 'A' | Goldam Sachs | 548 |
| 505 | CDW Corp | Goldam Sachs | (210) | (1) | Cloudflare Inc 'A' | HSBC | — |
| (1.090) | Centene Corp | BNP Paribas | 1.177 | (35) | CME Group Inc | Bank of America | |
| (76) | Centene Corp | Goldam Sachs | 82 | | | Merrill Lynch | (77) |
| (2.282) | Ceridian HCM Holding Inc | Barclays Bank | (1.940) | (606) | CME Group Inc | Citibank | (4.109) |
| (4.373) | Ceridian HCM Holding Inc | HSBC | (19.722) | 268 | Coca-Cola Co | BNP Paribas | (748) |
| (405) | CF Industries Holdings Inc | Goldam Sachs | 2.770 | 262 | Coca-Cola Co | Goldam Sachs | (731) |
| (71) | CF Industries Holdings Inc | HSBC | (660) | 497 | Coca-Cola Co | HSBC | (716) |
| (114) | CH Robinson Worldwide Inc | Bank of America | | 355 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Barclays Bank | (202) |
| | | Merrill Lynch | 119 | 779 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Citibank | (444) |
| (103) | CH Robinson Worldwide Inc | BNP Paribas | 107 | 161 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | JP Morgan | 705 |
| (324) | CH Robinson Worldwide Inc | HSBC | 690 | 425 | Cognex Corp | Bank of America | |
| (126) | Charles River Laboratories International Inc | Barclays Bank | (879) | | | Merrill Lynch | (26) |
| (168) | Charles River Laboratories International Inc | BNP Paribas | (1.179) | 1.119 | Cognex Corp | BNP Paribas | (67) |
| (50) | Charles River Laboratories International Inc | HSBC | (469) | 129 | Cognex Corp | Goldam Sachs | (8) |
| (1.675) | Charles Schwab Corp | Goldam Sachs | (10.435) | 1.640 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | BNP Paribas | 2.444 |
| (69) | Charter Communications Inc 'A' | Bank of America | | (56) | Coinbase Global Inc 'A' | Bank of America | |
| (136) | Charter Communications Inc 'A' | Merrill Lynch | (2.989) | | | Merrill Lynch | (946) |
| | | Barclays Bank | (4.487) | (214) | Coinbase Global Inc 'A' | Barclays Bank | (2.673) |
| (105) | Charter Communications Inc 'A' | BNP Paribas | (4.549) | (671) | Coinbase Global Inc 'A' | BNP Paribas | (11.333) |
| (116) | Charter Communications Inc 'A' | Citibank | (3.827) | (461) | Coinbase Global Inc 'A' | Citibank | (5.758) |
| (138) | Charter Communications Inc 'A' | Goldam Sachs | (5.978) | (694) | Coinbase Global Inc 'A' | Goldam Sachs | (11.722) |
| (17) | Charter Communications Inc 'A' | HSBC | (731) | (232) | Colgate-Palmolive Co | Bank of America | |
| (174) | Check Point Software Technologies Ltd | BNP Paribas | (482) | | | Merrill Lynch | (760) |
| (117) | Check Point Software Technologies Ltd | Goldam Sachs | (324) | 757 | Comcast Corp 'A' | Barclays Bank | 689 |
| (995) | Cheniere Energy Inc | Goldam Sachs | (2.935) | 211 | Comcast Corp 'A' | Citibank | 192 |
| | | | | 250 | Comcast Corp 'A' | HSBC | 1.008 |
| | | | | (1.075) | Conagra Brands Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 3.462 |
| | | | | (4.734) | Conagra Brands Inc | BNP Paribas | 15.243 |
| | | | | (287) | Conagra Brands Inc | Citibank | (23) |
| | | | | (1.169) | Conagra Brands Inc | Goldam Sachs | 3.764 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (731) | Conagra Brands Inc | HSBC | 2.829 | (98) | DaVita Inc | Goldam Sachs | 289 |
| 1.061 | ConocoPhillips | BNP Paribas | 12.117 | (210) | DaVita Inc | HSBC | 1.537 |
| 2.002 | ConocoPhillips | Goldam Sachs | 22.863 | 27 | Deere & Co | HSBC | (378) |
| (14.613) | ConocoPhillips | JP Morgan | (288.168) | (171) | Dell Technologies Inc 'C' | Barclays Bank | (1.289) |
| 231 | Consolidated Edison Inc | Bank of America | | (719) | Dell Technologies Inc 'C' | BNP Paribas | (2.682) |
| | | Merrill Lynch | 1.042 | (99) | Dell Technologies Inc 'C' | Citibank | (746) |
| 232 | Consolidated Edison Inc | Barclays Bank | 434 | (180) | Dell Technologies Inc 'C' | Goldam Sachs | (671) |
| 858 | Consolidated Edison Inc | BNP Paribas | 3.870 | (799) | DENTSPLY SIRONA Inc | Barclays Bank | (767) |
| 222 | Consolidated Edison Inc | Citibank | 415 | (803) | DENTSPLY SIRONA Inc | BNP Paribas | (964) |
| 1.274 | Consolidated Edison Inc | Goldam Sachs | 5.746 | (301) | DENTSPLY SIRONA Inc | Goldam Sachs | (361) |
| 194 | Consolidated Edison Inc | HSBC | 1.003 | 1.058 | Devon Energy Corp | BNP Paribas | 7.194 |
| 171 | Consolidated Edison Inc | JP Morgan | 884 | 304 | Devon Energy Corp | Goldam Sachs | 2.067 |
| (607) | Constellation Brands Inc 'A' | BNP Paribas | 3.721 | 32 | Dexcom Inc | Bank of America | |
| (317) | Constellation Brands Inc 'A' | Goldam Sachs | 1.943 | | | Merrill Lynch | (238) |
| (604) | Constellation Energy Corp | Goldam Sachs | (3.890) | 116 | Dexcom Inc | Barclays Bank | (783) |
| (40) | Cooper Cos Inc | Barclays Bank | (417) | 120 | Dexcom Inc | BNP Paribas | (892) |
| (375) | Cooper Cos Inc | BNP Paribas | (7.965) | 20 | Dexcom Inc | Citibank | (135) |
| (27) | Cooper Cos Inc | Citibank | (282) | 205 | Dexcom Inc | Goldam Sachs | (1.523) |
| (32) | Cooper Cos Inc | Goldam Sachs | (680) | 137 | Dexcom Inc | HSBC | (1.145) |
| 290 | Copart Inc | Bank of America | | 8 | Dexcom Inc | JP Morgan | (103) |
| | | Merrill Lynch | 1.076 | 168 | Diamondback Energy Inc | Bank of America | |
| 1.187 | Copart Inc | Barclays Bank | 4.071 | | | Merrill Lynch | 4.465 |
| 859 | Copart Inc | BNP Paribas | 3.187 | 81 | Diamondback Energy Inc | Barclays Bank | 1.763 |
| 1.032 | Copart Inc | Goldam Sachs | 3.829 | 319 | Diamondback Energy Inc | BNP Paribas | 8.191 |
| 575 | Copart Inc | HSBC | 3.007 | 138 | Diamondback Energy Inc | Goldam Sachs | 3.668 |
| 71 | Copart Inc | JP Morgan | 371 | 87 | Diamondback Energy Inc | HSBC | 2.428 |
| (979) | Corning Inc | Barclays Bank | (1.576) | (166) | Discover Financial Services | Barclays Bank | (676) |
| (799) | Corning Inc | BNP Paribas | (136) | (52) | Discover Financial Services | Goldam Sachs | (477) |
| (1.463) | Corning Inc | Citibank | (2.355) | (11) | Discover Financial Services | HSBC | (54) |
| 573 | Corteva Inc | Bank of America | | (605) | Discovery Inc | Barclays Bank | 42 |
| | | Merrill Lynch | 3.902 | (4.024) | Discovery Inc | BNP Paribas | (4.064) |
| 4.089 | Corteva Inc | Barclays Bank | 9.977 | (844) | Discovery Inc | Citibank | 59 |
| 644 | Corteva Inc | BNP Paribas | 4.386 | (915) | Discovery Inc | Goldam Sachs | (924) |
| 348 | Corteva Inc | JP Morgan | 3.574 | (914) | DISH Network Corp 'A' | Bank of America | |
| (777) | CoStar Group Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (1.910) |
| | | Merrill Lynch | (3.155) | (4.329) | DISH Network Corp 'A' | Barclays Bank | (8.312) |
| (282) | CoStar Group Inc | Barclays Bank | (905) | (1.779) | DISH Network Corp 'A' | BNP Paribas | (3.718) |
| (2.215) | CoStar Group Inc | BNP Paribas | (8.993) | (277) | DISH Network Corp 'A' | Citibank | (532) |
| (20) | CoStar Group Inc | Citibank | (64) | (696) | DISH Network Corp 'A' | HSBC | (891) |
| (1.235) | CoStar Group Inc | Goldam Sachs | (5.014) | 242 | DocuSign Inc | Bank of America | |
| (1.933) | Coterra Energy Inc | BNP Paribas | (9.646) | | | Merrill Lynch | 2.301 |
| (1.269) | Coupa Software Inc | Barclays Bank | 723 | 318 | DocuSign Inc | Barclays Bank | 1.822 |
| (127) | Coupa Software Inc | BNP Paribas | (163) | 597 | DocuSign Inc | BNP Paribas | 5.677 |
| (347) | Coupa Software Inc | Goldam Sachs | (444) | 119 | DocuSign Inc | Citibank | 682 |
| (91) | Crown Holdings Inc | Bank of America | | 117 | DocuSign Inc | JP Morgan | 1.798 |
| | | Merrill Lynch | (11) | (25) | Dollar General Corp | Barclays Bank | (683) |
| (193) | Crown Holdings Inc | Barclays Bank | (647) | (166) | Dollar General Corp | BNP Paribas | 2.063 |
| (527) | Crown Holdings Inc | BNP Paribas | (63) | (350) | Dollar General Corp | Goldam Sachs | 4.351 |
| (657) | Crown Holdings Inc | Goldam Sachs | (79) | (124) | Dollar General Corp | HSBC | 1.194 |
| (80) | Crown Holdings Inc | HSBC | (302) | (169) | Dollar Tree Inc | Barclays Bank | (5.594) |
| 3.513 | CSX Corp | BNP Paribas | (4.988) | (629) | Dollar Tree Inc | Goldam Sachs | (1.032) |
| 36 | Cummins Inc | Bank of America | | (13) | Dollar Tree Inc | HSBC | (20) |
| | | Merrill Lynch | 162 | 305 | Domino's Pizza Inc | Barclays Bank | 5.941 |
| 251 | Cummins Inc | Barclays Bank | 2.118 | 21 | Domino's Pizza Inc | BNP Paribas | 547 |
| 1.296 | Cummins Inc | BNP Paribas | 5.819 | 6 | Domino's Pizza Inc | Goldam Sachs | 156 |
| 331 | Cummins Inc | Goldam Sachs | 1.486 | (402) | DoorDash Inc 'A' | BNP Paribas | (4.892) |
| 460 | CVS Health Corp | Barclays Bank | 768 | (50) | DoorDash Inc 'A' | Citibank | (508) |
| 486 | CVS Health Corp | BNP Paribas | (637) | 2.081 | Dover Corp | Bank of America | |
| 936 | CVS Health Corp | Goldam Sachs | (1.226) | | | Merrill Lynch | (1.415) |
| (631) | CyberArk Software Ltd | Bank of America | | 717 | Dow Inc | BNP Paribas | 380 |
| | | Merrill Lynch | (6.367) | 260 | Dow Inc | Citibank | 265 |
| (83) | Danaher Corp | BNP Paribas | (1.296) | 407 | Dow Inc | JP Morgan | (283) |
| (868) | Danaher Corp | Goldam Sachs | (13.558) | 330 | DR Horton Inc | Barclays Bank | 2.026 |
| 766 | Darden Restaurants Inc | Barclays Bank | 6.166 | 306 | DR Horton Inc | BNP Paribas | 1.594 |
| 420 | Darden Restaurants Inc | BNP Paribas | (806) | 175 | DR Horton Inc | Citibank | 1.075 |
| (224) | DaVita Inc | Bank of America | | 132 | DR Horton Inc | JP Morgan | 482 |
| | | Merrill Lynch | 661 | (3.689) | DraftKings Inc 'A' | BNP Paribas | 2.786 |
| (122) | DaVita Inc | Barclays Bank | (329) | (1.174) | DraftKings Inc 'A' | BNP Paribas | 2.430 |
| (677) | DaVita Inc | BNP Paribas | 1.997 | (393) | DraftKings Inc 'A' | Citibank | 12 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3.063) | DraftKings Inc 'A' | Goldam Sachs | (4.380) | 59 | Estee Lauder Cos Inc 'A' | JP Morgan | 1.277 |
| 2.905 | Dropbox Inc 'A' | Bank of America | | (47) | Etsy Inc | Barclays Bank | (280) |
| | | Merrill Lynch | 1.685 | (111) | Etsy Inc | BNP Paribas | 511 |
| 6.723 | Dropbox Inc 'A' | Barclays Bank | 2.756 | (258) | Etsy Inc | Goldam Sachs | 1.187 |
| 9.450 | Dropbox Inc 'A' | BNP Paribas | 5.481 | (219) | Etsy Inc | HSBC | 906 |
| 10.687 | Dropbox Inc 'A' | Goldam Sachs | 6.198 | 85 | Everest Re Group Ltd | Barclays Bank | 643 |
| 2.923 | Dropbox Inc 'A' | HSBC | 1.082 | 20 | Everest Re Group Ltd | BNP Paribas | (8) |
| 802 | Dropbox Inc 'A' | JP Morgan | 297 | 413 | Eversource Energy | Bank of America | |
| 112 | DuPont de Nemours Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.222 |
| | | Merrill Lynch | 503 | 864 | Eversource Energy | Barclays Bank | 812 |
| 1.143 | DuPont de Nemours Inc | BNP Paribas | 3.342 | 1.818 | Eversource Energy | BNP Paribas | 5.381 |
| 487 | DuPont de Nemours Inc | Citibank | 1.193 | 694 | Eversource Energy | Citibank | 652 |
| 86 | DuPont de Nemours Inc | JP Morgan | 309 | 463 | Eversource Energy | Goldam Sachs | 1.370 |
| 347 | Eaton Corp Plc | JP Morgan | (3.678) | 450 | Eversource Energy | HSBC | 761 |
| 2.491 | eBay Inc | BNP Paribas | 6.850 | 164 | Eversource Energy | JP Morgan | 277 |
| 1.340 | eBay Inc | Goldam Sachs | 3.685 | (2.822) | Exact Sciences Corp | Barclays Bank | 1.637 |
| 2.304 | eBay Inc | HSBC | (3.272) | (306) | Exact Sciences Corp | BNP Paribas | (266) |
| 186 | eBay Inc | JP Morgan | (264) | (1.651) | Exact Sciences Corp | Goldam Sachs | (1.436) |
| 95 | Ecolab Inc | Goldam Sachs | 297 | 1.254 | Exelon Corp | BNP Paribas | 2.859 |
| 939 | Edison International | Barclays Bank | 2.601 | 146 | Expedia Group Inc | Bank of America | |
| 362 | Edwards Lifesciences Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 656 |
| | | Merrill Lynch | 1.430 | 447 | Expedia Group Inc | Barclays Bank | 2.999 |
| 2.653 | Edwards Lifesciences Corp | Barclays Bank | 9.977 | 78 | Expedia Group Inc | BNP Paribas | 350 |
| 1.107 | Edwards Lifesciences Corp | BNP Paribas | 4.154 | 548 | Expedia Group Inc | Goldam Sachs | 2.461 |
| 2.950 | Edwards Lifesciences Corp | Goldam Sachs | 11.653 | 241 | Expedia Group Inc | HSBC | 133 |
| 29 | Edwards Lifesciences Corp | HSBC | 199 | 5.509 | Expeditors International of Washington Inc | JP Morgan | (10.577) |
| 382 | Edwards Lifesciences Corp | JP Morgan | 2.170 | (126) | Exxon Mobil Corp | Bank of America | |
| (3.264) | Elanco Animal Health Inc | Barclays Bank | (947) | | | Merrill Lynch | (933) |
| (813) | Elanco Animal Health Inc | Goldam Sachs | (545) | (271) | Exxon Mobil Corp | Barclays Bank | (1.401) |
| 969 | Electronic Arts Inc | BNP Paribas | 5.402 | (78) | Exxon Mobil Corp | BNP Paribas | (633) |
| 218 | Electronic Arts Inc | Goldam Sachs | 2.235 | (238) | Exxon Mobil Corp | Goldam Sachs | (1.930) |
| 241 | Electronic Arts Inc | HSBC | 6.170 | (237) | Exxon Mobil Corp | HSBC | (3.460) |
| 411 | Eli Lilly & Co | BNP Paribas | 5.421 | (289) | F5 Inc | Bank of America | |
| 186 | Eli Lilly & Co | Goldam Sachs | 2.453 | | | Merrill Lynch | 1.130 |
| 1.484 | Emerson Electric Co | BNP Paribas | 4.630 | (219) | F5 Inc | Barclays Bank | (1.053) |
| (240) | Enphase Energy Inc | Goldam Sachs | (8.671) | (351) | F5 Inc | BNP Paribas | 1.372 |
| (4) | Entegris Inc | Barclays Bank | (18) | (61) | F5 Inc | Goldam Sachs | 239 |
| (1.714) | Entegris Inc | BNP Paribas | (7.147) | (104) | F5 Inc | HSBC | 337 |
| (79) | Entegris Inc | Goldam Sachs | (329) | 43 | FactSet Research Systems Inc | Barclays Bank | 444 |
| 295 | Entergy Corp | BNP Paribas | 519 | 251 | FactSet Research Systems Inc | BNP Paribas | 2.535 |
| 126 | Entergy Corp | Goldam Sachs | 222 | 120 | FactSet Research Systems Inc | Goldam Sachs | 1.212 |
| 129 | Entergy Corp | HSBC | 37 | 9 | FactSet Research Systems Inc | HSBC | 168 |
| 499 | EOG Resources Inc | Barclays Bank | 5.943 | 62 | FactSet Research Systems Inc | JP Morgan | 1.160 |
| 36 | EOG Resources Inc | BNP Paribas | 490 | 28 | Fair Isaac Corp | Barclays Bank | 52 |
| 4 | EOG Resources Inc | Goldam Sachs | 54 | 4 | Fair Isaac Corp | BNP Paribas | 145 |
| 190 | EOG Resources Inc | JP Morgan | 4.188 | 278 | Fair Isaac Corp | Goldam Sachs | 10.055 |
| (35) | EPAM Systems Inc | Goldam Sachs | (446) | 1.000 | Fastenal Co | BNP Paribas | 370 |
| 162 | Equifax Inc | BNP Paribas | 804 | 484 | Fastenal Co | Citibank | 557 |
| 76 | Equifax Inc | Goldam Sachs | 377 | 346 | FedEx Corp | Barclays Bank | 5.238 |
| 1.063 | Equitable Holdings Inc | Bank of America | | 276 | FedEx Corp | BNP Paribas | 2.790 |
| | | Merrill Lynch | 2.955 | 100 | FedEx Corp | Goldam Sachs | 1.011 |
| 416 | Equitable Holdings Inc | Barclays Bank | 666 | (462) | Fidelity National Information Services Inc | BNP Paribas | (3.710) |
| 4.849 | Equitable Holdings Inc | BNP Paribas | 13.480 | (1) | Fidelity National Information Services Inc | Goldam Sachs | (8) |
| 509 | Equitable Holdings Inc | Citibank | 814 | (182) | Fidelity National Information Services Inc | HSBC | (1.782) |
| 1.822 | Equitable Holdings Inc | Goldam Sachs | 5.065 | (751) | Fifth Third Bancorp | BNP Paribas | (2.478) |
| 2.469 | Equitable Holdings Inc | HSBC | 5.111 | (215) | Fifth Third Bancorp | Citibank | (469) |
| (744) | Erie Indemnity Co 'A' | Bank of America | | (364) | First Citizens BancShares Inc 'A' | BNP Paribas | (15.117) |
| | | Merrill Lynch | (2.306) | (11) | First Citizens BancShares Inc 'A' | Goldam Sachs | (457) |
| (900) | Erie Indemnity Co 'A' | Barclays Bank | (3.240) | | | | |
| (365) | Erie Indemnity Co 'A' | Goldam Sachs | (1.132) | | | | |
| (4.097) | Essential Utilities Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (1.639) | | | | |
| (474) | Essential Utilities Inc | Barclays Bank | 90 | | | | |
| 38 | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 754 | | | | |
| 122 | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Barclays Bank | 2.272 | | | | |
| 317 | Estee Lauder Cos Inc 'A' | BNP Paribas | 6.289 | | | | |
| 160 | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Citibank | 2.979 | | | | |
| 366 | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Goldam Sachs | 7.261 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (11) | First Citizens BancShares Inc 'A' | HSBC | (505) | (316) | Global Payments Inc | Goldam Sachs | (3.340) |
| 99 | First Republic Bank | Bank of America | | 822 | GoDaddy Inc 'A' | Barclays Bank | 2.302 |
| | | Merrill Lynch | 1.670 | (7.646) | Grab Holdings Ltd 'A' | Barclays Bank | 1.682 |
| 465 | First Republic Bank | Barclays Bank | 3.171 | (536) | Guidewire Software Inc | Barclays Bank | (1.415) |
| 391 | First Republic Bank | BNP Paribas | 6.596 | 452 | Halliburton Co | BNP Paribas | 2.500 |
| 74 | First Republic Bank | Goldam Sachs | 1.248 | 759 | Halliburton Co | Goldam Sachs | 2.998 |
| 59 | First Republic Bank | HSBC | 680 | 264 | Halliburton Co | HSBC | 1.398 |
| (3.346) | Fiserv Inc | Barclays Bank | (5.153) | 73 | Hartford Financial Services Group Inc | Bank of America | |
| (333) | Fiserv Inc | BNP Paribas | (1.372) | 13 | Hartford Financial Services Group Inc | Merrill Lynch | 194 |
| (265) | FleetCor Technologies Inc | Barclays Bank | (2.337) | | | Barclays Bank | 43 |
| (370) | FleetCor Technologies Inc | BNP Paribas | (7.629) | 1.522 | Hartford Financial Services Group Inc | BNP Paribas | 4.049 |
| (65) | FleetCor Technologies Inc | Citibank | (573) | 200 | Hartford Financial Services Group Inc | Goldam Sachs | 532 |
| (216) | FleetCor Technologies Inc | Goldam Sachs | (4.454) | 524 | Hartford Financial Services Group Inc | HSBC | 587 |
| (80) | FleetCor Technologies Inc | HSBC | (2.478) | (942) | Hasbro Inc | Bank of America | |
| (79) | FleetCor Technologies Inc | JP Morgan | (2.447) | | | Merrill Lynch | 3.815 |
| 9 | FMC Corp | Bank of America | | (364) | HCA Healthcare Inc | BNP Paribas | (692) |
| | | Merrill Lynch | 60 | (320) | HCA Healthcare Inc | Citibank | (2.720) |
| 680 | FMC Corp | Barclays Bank | 88 | (107) | HCA Healthcare Inc | Goldam Sachs | (835) |
| 196 | FMC Corp | BNP Paribas | 1.298 | (551) | HCA Healthcare Inc | HSBC | 5.819 |
| 316 | FMC Corp | Goldam Sachs | 2.092 | (590) | HEICO Corp | BNP Paribas | (3.752) |
| (4.481) | Ford Motor Co | BNP Paribas | (1.837) | (1.066) | HEICO Corp | Goldam Sachs | (6.780) |
| (4.663) | Ford Motor Co | Goldam Sachs | (1.912) | (170) | Henry Schein Inc | Bank of America | |
| (541) | Ford Motor Co | HSBC | (49) | | | Merrill Lynch | (117) |
| 674 | Fortinet Inc | Bank of America | | 21 | Hershey Co | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 11.283 | | | Merrill Lynch | (407) |
| 263 | Fortinet Inc | BNP Paribas | 4.403 | 1.449 | Hershey Co | Barclays Bank | 1.000 |
| 8 | Fortinet Inc | Goldam Sachs | 134 | 461 | Hershey Co | BNP Paribas | (8.934) |
| 2.466 | Fortive Corp | BNP Paribas | 7.102 | 628 | Hershey Co | Goldam Sachs | (12.171) |
| 304 | Fortive Corp | Goldam Sachs | 876 | 180 | Hershey Co | HSBC | (2.387) |
| 124 | Fortive Corp | HSBC | 219 | 6 | Hershey Co | JP Morgan | (80) |
| 1.357 | Fortune Brands Home & Security Inc | Barclays Bank | 2.130 | (260) | Hess Corp | Barclays Bank | (2.694) |
| 360 | Fortune Brands Home & Security Inc | BNP Paribas | 144 | (551) | Hess Corp | BNP Paribas | (5.365) |
| (1.663) | Fox Corp 'A' | BNP Paribas | (2.844) | (186) | Hess Corp | Goldam Sachs | (1.927) |
| (89) | Fox Corp 'A' | Goldam Sachs | (152) | 6.313 | Hewlett Packard Enterprise Co | Barclays Bank | 6.881 |
| 389 | Franklin Resources Inc | Barclays Bank | 521 | 1.914 | Hewlett Packard Enterprise Co | BNP Paribas | (708) |
| 613 | Franklin Resources Inc | BNP Paribas | 1.477 | 2.396 | Hewlett Packard Enterprise Co | HSBC | (575) |
| 654 | Franklin Resources Inc | Goldam Sachs | 1.576 | 816 | Hewlett Packard Enterprise Co | JP Morgan | (196) |
| (1.154) | Futu Holdings Ltd ADR | Barclays Bank | (2.493) | (358) | Hilton Worldwide Holdings Inc | Barclays Bank | (2.903) |
| (1.114) | Futu Holdings Ltd ADR | BNP Paribas | (5.793) | (333) | Hilton Worldwide Holdings Inc | BNP Paribas | (2.534) |
| (112) | Futu Holdings Ltd ADR | HSBC | (913) | (595) | Hilton Worldwide Holdings Inc | Goldam Sachs | (4.528) |
| 711 | Garmin Ltd | Barclays Bank | 2.019 | (330) | Hilton Worldwide Holdings Inc | HSBC | (2.359) |
| 724 | Garmin Ltd | BNP Paribas | 2.129 | 452 | Hologic Inc | Bank of America | |
| 1.660 | Garmin Ltd | Goldam Sachs | 4.880 | | | Merrill Lynch | (773) |
| (34) | Gartner Inc | Goldam Sachs | (295) | 1.258 | Hologic Inc | Barclays Bank | (4.151) |
| (184) | Gartner Inc | HSBC | (4.195) | 196 | Hologic Inc | BNP Paribas | (335) |
| (100) | Generac Holdings Inc | Barclays Bank | (1.685) | 727 | Hologic Inc | Goldam Sachs | (1.243) |
| (32) | Generac Holdings Inc | BNP Paribas | (886) | 289 | Hologic Inc | HSBC | 795 |
| (202) | Generac Holdings Inc | Goldam Sachs | (5.591) | 108 | Home Depot Inc | Bank of America | |
| (1.288) | General Electric Co | BNP Paribas | (5.397) | | | Merrill Lynch | 696 |
| 37 | General Mills Inc | Bank of America | | 77 | Home Depot Inc | Barclays Bank | 1.263 |
| | | Merrill Lynch | (165) | 71 | Home Depot Inc | BNP Paribas | 457 |
| 760 | General Mills Inc | HSBC | (3.420) | 35 | Home Depot Inc | Citibank | 574 |
| 268 | General Motors Co | Barclays Bank | 611 | 46 | Home Depot Inc | Goldam Sachs | 296 |
| 518 | General Motors Co | Goldam Sachs | 611 | 127 | Home Depot Inc | HSBC | 686 |
| 513 | General Motors Co | HSBC | (54) | 82 | Home Depot Inc | JP Morgan | 443 |
| 360 | Genuine Parts Co | Bank of America | | 108 | Horizon Therapeutics Plc | Goldam Sachs | 326 |
| | | Merrill Lynch | 238 | (972) | Hormel Foods Corp | Barclays Bank | 350 |
| 68 | Genuine Parts Co | Barclays Bank | 496 | (920) | Hormel Foods Corp | BNP Paribas | 4.839 |
| 119 | Genuine Parts Co | Citibank | 868 | | | | |
| 1.877 | Genuine Parts Co | Goldam Sachs | 1.239 | | | | |
| 409 | Genuine Parts Co | HSBC | 2.041 | | | | |
| 201 | Genuine Parts Co | JP Morgan | 1.003 | | | | |
| 2.170 | Gilead Sciences Inc | BNP Paribas | 3.167 | | | | |
| 165 | Gilead Sciences Inc | Citibank | 40 | | | | |
| 282 | Gilead Sciences Inc | Goldam Sachs | (211) | | | | |
| 998 | Gilead Sciences Inc | HSBC | 1.850 | | | | |
| (772) | Global Payments Inc | Barclays Bank | (4.238) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-----------------|---|---|------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3.254) | Howmet Aerospace Inc | Barclays Bank | (3.872) | 92 | Intuit Inc | HSBC | 5.132 |
| (262) | Howmet Aerospace Inc | BNP Paribas | (375) | (27) | Intuitive Surgical Inc | Citibank | (147) |
| (2.319) | Howmet Aerospace Inc | Goldam Sachs | (3.316) | (66) | Intuitive Surgical Inc | HSBC | (1.211) |
| 519 | HP Inc | Barclays Bank | 1.842 | 415 | Invesco Ltd | Bank of America | |
| 25 | HubSpot Inc | Goldam Sachs | 103 | | | Merrill Lynch | 656 |
| 42 | HubSpot Inc | HSBC | 331 | 377 | Invesco Ltd | Barclays Bank | 215 |
| (183) | Humana Inc | Barclays Bank | (2.963) | 2.006 | Invesco Ltd | BNP Paribas | 3.169 |
| (70) | Humana Inc | Goldam Sachs | (1.162) | 1.421 | Invesco Ltd | Goldam Sachs | 2.245 |
| (11) | Humana Inc | HSBC | (364) | 1.208 | Invesco Ltd | HSBC | 1.884 |
| (5.058) | Huntington Bancshares Inc | Barclays Bank | (1.416) | (214) | IPG Photonics Corp | Bank of America | |
| (2.192) | IAC Holdings Inc | Barclays Bank | (4.296) | | | Merrill Lynch | (1.367) |
| (374) | IAC Holdings Inc | BNP Paribas | (1.743) | (772) | IPG Photonics Corp | Barclays Bank | (3.103) |
| (1.663) | IAC Holdings Inc | Citibank | (3.259) | (461) | IPG Photonics Corp | BNP Paribas | (2.946) |
| (1.584) | IAC Holdings Inc | Goldam Sachs | (7.381) | (516) | IPG Photonics Corp | Goldam Sachs | (3.297) |
| (304) | IAC Holdings Inc | HSBC | (3.666) | (427) | IQVIA Holdings Inc | Barclays Bank | (5.145) |
| 52 | IDEX Corp | Barclays Bank | 160 | (174) | IQVIA Holdings Inc | BNP Paribas | (1.540) |
| 348 | IDEX Corp | BNP Paribas | 1.082 | (42) | IQVIA Holdings Inc | Goldam Sachs | (378) |
| 57 | IDEX Corp | Goldam Sachs | 177 | (783) | J M Smucker Co | Barclays Bank | (1.292) |
| 68 | IDEX Corp | HSBC | (29) | (507) | J M Smucker Co | BNP Paribas | 10.094 |
| 402 | IDEX Laboratories Inc | Goldam Sachs | 13.262 | (886) | J M Smucker Co | Goldam Sachs | 17.640 |
| 2.873 | Illinois Tool Works Inc | BNP Paribas | (9.165) | (88) | Jack Henry & Associates Inc | Barclays Bank | (356) |
| 39 | Illinois Tool Works Inc | HSBC | (217) | (639) | Jack Henry & Associates Inc | BNP Paribas | (5.955) |
| 91 | Illinois Tool Works Inc | JP Morgan | (506) | (594) | Jack Henry & Associates Inc | Goldam Sachs | (5.536) |
| 140 | Illumina Inc | BNP Paribas | 1.357 | (46) | Jack Henry & Associates Inc | HSBC | (417) |
| 134 | Illumina Inc | Citibank | (220) | (236) | Jazz Pharmaceuticals Plc | Barclays Bank | (637) |
| 117 | Incyte Corp | Barclays Bank | (158) | 683 | JB Hunt Transport Services Inc | Barclays Bank | 3.982 |
| 1.309 | Incyte Corp | BNP Paribas | 1.374 | 804 | JB Hunt Transport Services Inc | BNP Paribas | (1.391) |
| 2.317 | Incyte Corp | Goldam Sachs | 2.433 | 346 | Johnson & Johnson | BNP Paribas | (702) |
| (3.245) | Ingersoll Rand Inc | Bank of America | | 68 | Johnson & Johnson | HSBC | (87) |
| | | Merrill Lynch | (12.396) | 1.638 | Johnson Controls International Plc | Bank of America | |
| (194) | Ingersoll Rand Inc | Barclays Bank | (371) | 128 | JPMorgan Chase & Co | Merrill Lynch | 3.898 |
| 288 | Inmode Ltd | Barclays Bank | 878 | 103 | JPMorgan Chase & Co | Merrill Lynch | 1.688 |
| 461 | Inmode Ltd | JP Morgan | 1.443 | 554 | JPMorgan Chase & Co | Barclays Bank | 706 |
| 426 | Intel Corp | Barclays Bank | 807 | 99 | JPMorgan Chase & Co | BNP Paribas | 5.849 |
| 5.929 | Intel Corp | BNP Paribas | 4.832 | 191 | JPMorgan Chase & Co | Citibank | 496 |
| 391 | Intel Corp | Citibank | 741 | 4.559 | Juniper Networks Inc | HSBC | 1.832 |
| 446 | Intel Corp | HSBC | 368 | 2.000 | Juniper Networks Inc | Barclays Bank | 4.696 |
| (102) | Intercontinental Exchange Inc ^{tr} | Bank of America | | 4.082 | Juniper Networks Inc | BNP Paribas | 740 |
| (107) | Intercontinental Exchange Inc | Merrill Lynch | — | (609) | Kellogg Co | Goldam Sachs | 1.510 |
| (265) | Intercontinental Exchange Inc | Barclays Bank | (429) | (2.564) | Keurig Dr Pepper Inc | BNP Paribas | 2.887 |
| (157) | International Business Machines Corp | HSBC | (1.359) | (723) | Keurig Dr Pepper Inc | HSBC | 6.077 |
| (908) | International Business Machines Corp | Barclays Bank | (1.080) | 4.974 | KeyCorp | HSBC | 1.829 |
| (1.080) | International Business Machines Corp | BNP Paribas | (2.742) | 154 | Keysight Technologies Inc | Barclays Bank | 3.731 |
| (103) | International Business Machines Corp | Goldam Sachs | (3.262) | 1.447 | Keysight Technologies Inc | Bank of America | |
| (103) | International Business Machines Corp | HSBC | (372) | 1.636 | Keysight Technologies Inc | Merrill Lynch | 1.542 |
| (67) | International Flavors & Fragrances Inc | BNP Paribas | (179) | 1.990 | Keysight Technologies Inc | Barclays Bank | 7.278 |
| (198) | International Flavors & Fragrances Inc | Goldam Sachs | (529) | 134 | Keysight Technologies Inc | BNP Paribas | 16.376 |
| (49) | International Flavors & Fragrances Inc | HSBC | (546) | (471) | Kimberly-Clark Corp | Goldam Sachs | 19.920 |
| (560) | International Paper Co | BNP Paribas | (437) | (1.104) | Kimberly-Clark Corp | HSBC | 1.741 |
| (1.280) | International Paper Co | Goldam Sachs | (998) | (296) | Kimberly-Clark Corp | Barclays Bank | (890) |
| (1.355) | International Paper Co | HSBC | (1.165) | (289) | Kimberly-Clark Corp | BNP Paribas | 8.424 |
| 6.365 | Interpublic Group of Cos Inc | Barclays Bank | 4.965 | (3.713) | Kinder Morgan Inc | Citibank | (559) |
| 1.847 | Interpublic Group of Cos Inc | BNP Paribas | 185 | (2.968) | Kinder Morgan Inc | Goldam Sachs | 2.205 |
| 465 | Interpublic Group of Cos Inc | Goldam Sachs | 47 | (1.472) | Kinder Morgan Inc | BNP Paribas | (2.154) |
| 363 | Interpublic Group of Cos Inc | HSBC | (174) | 170 | KKR & Co Inc | Citibank | (2.404) |
| 270 | Interpublic Group of Cos Inc | JP Morgan | (130) | 6 | KLA Corp | Goldam Sachs | (854) |
| 64 | Intuit Inc | Bank of America | | | | Barclays Bank | 462 |
| | | Merrill Lynch | 3.930 | 42 | KLA Corp | Bank of America | |
| 1.181 | Intuit Inc | Barclays Bank | 58.613 | 753 | KLA Corp | Merrill Lynch | 182 |
| 202 | Intuit Inc | Citibank | 10.025 | 236 | KLA Corp | Barclays Bank | 827 |
| 103 | Intuit Inc | Goldam Sachs | 6.325 | 15 | KLA Corp | BNP Paribas | 22.831 |
| | | | | | | Goldam Sachs | 7.156 |
| | | | | | | HSBC | 630 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 5.497 | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Barclays Bank | 2.584 | (1.291) | Lucid Group Inc | BNP Paribas | (3.034) |
| 341 | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | BNP Paribas | 341 | 69 | Lululemon Athletica Inc | Barclays Bank | 1.440 |
| (328) | Kornit Digital Ltd | Goldam Sachs | (1.364) | 67 | Lululemon Athletica Inc | Citibank | 1.398 |
| (320) | Kraft Heinz Co | BNP Paribas | 2.163 | 103 | Lululemon Athletica Inc | Goldam Sachs | (1.075) |
| 1.101 | Kroger Co | BNP Paribas | (694) | 32 | Lululemon Athletica Inc | JP Morgan | (335) |
| 472 | L Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.431) | (7.050) | Lumen Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.076) |
| 289 | L Brands Inc | Barclays Bank | 754 | 2.155 | Lyft Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (3.340) |
| 348 | L Brands Inc | Goldam Sachs | (2.530) | 842 | Lyft Inc 'A' | Barclays Bank | (2.206) |
| 431 | Laboratory Corp of America Holdings | Goldam Sachs | 3.069 | 2.029 | Lyft Inc 'A' | BNP Paribas | (3.145) |
| 230 | Lam Research Corp | BNP Paribas | 7.475 | 407 | Lyft Inc 'A' | JP Morgan | (415) |
| 281 | Lam Research Corp | Goldam Sachs | 9.133 | 366 | LyondellBasell Industries NV 'A' | Citibank | 3.481 |
| (1.551) | Las Vegas Sands Corp | Barclays Bank | (4.265) | (1.067) | M&T Bank Corp | BNP Paribas | (14.725) |
| (782) | Las Vegas Sands Corp | BNP Paribas | (1.853) | (1) | M&T Bank Corp | Citibank | (9) |
| (5.359) | Las Vegas Sands Corp | Goldam Sachs | (12.701) | (50) | M&T Bank Corp | Goldam Sachs | (690) |
| (152) | Lear Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.637) | 8 | Marathon Petroleum Corp | Bank of America Merrill Lynch | 63 |
| (563) | Lear Corp | BNP Paribas | (6.064) | 228 | Marathon Petroleum Corp | Barclays Bank | 1.699 |
| (239) | Lear Corp | Citibank | (1.479) | 140 | Marathon Petroleum Corp | BNP Paribas | 1.147 |
| (226) | Lear Corp | Goldam Sachs | (2.434) | 490 | Marathon Petroleum Corp | Goldam Sachs | 3.866 |
| 321 | Lennar Corp 'A' | HSBC | 876 | 385 | Marathon Petroleum Corp | HSBC | 5.198 |
| 38 | Lennox International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (361) | 315 | Marathon Petroleum Corp | JP Morgan | 4.253 |
| 199 | Lennox International Inc | Barclays Bank | 147 | (12) | Markel Corp | Barclays Bank | (311) |
| 398 | Lennox International Inc | BNP Paribas | (3.785) | (174) | MarketAxess Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.216) |
| 26 | Lennox International Inc | Goldam Sachs | (247) | (207) | MarketAxess Holdings Inc | Barclays Bank | 1.339 |
| (1.446) | Liberty Broadband Corp 'C' | Barclays Bank | (9.009) | (135) | MarketAxess Holdings Inc | Goldam Sachs | (2.495) |
| (899) | Liberty Broadband Corp 'C' | Goldam Sachs | (7.821) | (42) | MarketAxess Holdings Inc | HSBC | (814) |
| (3.087) | Liberty Global Plc 'A' | Barclays Bank | (5.248) | (233) | Marriott International Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (3.234) |
| (1.581) | Liberty Global Plc 'C' | Barclays Bank | (2.909) | (1.572) | Marriott International Inc 'A' | Barclays Bank | (19.414) |
| (945) | Liberty Global Plc 'C' | BNP Paribas | (1.814) | (221) | Marriott International Inc 'A' | BNP Paribas | (1.757) |
| (346) | Liberty Global Plc 'C' | Citibank | (637) | (580) | Marriott International Inc 'A' | Goldam Sachs | (4.611) |
| (1.083) | Liberty Global Plc 'C' | Goldam Sachs | (2.079) | (171) | Marsh & McLennan Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12 |
| (4.660) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Bank of America Merrill Lynch | (10.625) | (83) | Marsh & McLennan Cos Inc | Barclays Bank | (551) |
| (1.674) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Barclays Bank | (2.176) | (477) | Marsh & McLennan Cos Inc | BNP Paribas | 33 |
| (352) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | BNP Paribas | (803) | (241) | Marsh & McLennan Cos Inc | Goldam Sachs | 17 |
| (13) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Citibank | (17) | (62) | Marsh & McLennan Cos Inc | HSBC | (118) |
| (817) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Goldam Sachs | (1.863) | (284) | Martin Marietta Materials Inc | Barclays Bank | (1.329) |
| (1.025) | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | Barclays Bank | (892) | (170) | Martin Marietta Materials Inc | BNP Paribas | (2.496) |
| (220) | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | Goldam Sachs | (486) | (293) | Martin Marietta Materials Inc | Citibank | (1.371) |
| (645) | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | HSBC | (1.742) | (277) | Martin Marietta Materials Inc | Goldam Sachs | (4.066) |
| 573 | Lincoln National Corp | Goldam Sachs | 2.515 | 210 | Marvell Technology Inc | Goldam Sachs | 839 |
| 783 | Lincoln National Corp | JP Morgan | 1.597 | 145 | Masco Corp | Bank of America Merrill Lynch | 162 |
| (50) | Linde Plc | Bank of America Merrill Lynch | (570) | 464 | Masco Corp | BNP Paribas | 520 |
| (50) | Linde Plc | Barclays Bank | (184) | 311 | Masimo Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.650 |
| (95) | Linde Plc | BNP Paribas | (1.392) | 258 | Masimo Corp | Barclays Bank | 294 |
| (477) | Linde Plc | Goldam Sachs | (6.988) | 102 | Masimo Corp | BNP Paribas | 869 |
| (17) | Live Nation Entertainment Inc | Bank of America Merrill Lynch | (124) | 29 | Masimo Corp | Citibank | 33 |
| (119) | Live Nation Entertainment Inc | BNP Paribas | (865) | 302 | Masimo Corp | Goldam Sachs | 2.573 |
| (395) | Live Nation Entertainment Inc | Goldam Sachs | (2.872) | 693 | Masimo Corp | HSBC | 15.897 |
| 504 | LKQ Corp | Barclays Bank | 1.109 | 66 | Masimo Corp | JP Morgan | 1.514 |
| 656 | LKQ Corp | BNP Paribas | 367 | (669) | Match Group Inc | Barclays Bank | (2.576) |
| 2.326 | LKQ Corp | Goldam Sachs | 1.303 | (494) | Match Group Inc | BNP Paribas | (1.591) |
| 2.604 | Loews Corp | Barclays Bank | 3.437 | (261) | Match Group Inc | Goldam Sachs | (840) |
| 235 | Lowe's Cos Inc | BNP Paribas | 200 | (121) | McCormick & Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.193 |
| | | | | (667) | McCormick & Co Inc | BNP Paribas | 6.577 |
| | | | | (835) | McCormick & Co Inc | HSBC | 6.212 |
| | | | | 20 | McDonald's Corp | BNP Paribas | 122 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 61 | McDonald's Corp | HSBC | 161 | (315) | Mondelez International | | |
| (145) | McKesson Corp | Bank of America | | | Inc 'A' | Citibank | (258) |
| | | Merrill Lynch | 183 | (1.054) | Mondelez International | | |
| (98) | McKesson Corp | Barclays Bank | (70) | | Inc 'A' | Goldam Sachs | 3.447 |
| (126) | McKesson Corp | BNP Paribas | 298 | (233) | Mondelez International | | |
| (91) | McKesson Corp | Goldam Sachs | (46) | | Inc 'A' | HSBC | 797 |
| (1.944) | Medtronic Plc | BNP Paribas | 7.776 | (176) | Mondelez International | | |
| (8.787) | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | Bank of America | | | Inc 'A' | JP Morgan | 602 |
| | | Merrill Lynch | (2.285) | (32) | MongoDB Inc | Goldam Sachs | 263 |
| (9.488) | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | Barclays Bank | (1.518) | 157 | Monolithic Power Systems Inc | Barclays Bank | 4.363 |
| (1.857) | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | BNP Paribas | (483) | 38 | Monolithic Power Systems Inc | BNP Paribas | 1.123 |
| (848) | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | Citibank | (136) | 489 | Monster Beverage Corp | Barclays Bank | 655 |
| (3.244) | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | HSBC | (3.049) | 526 | Monster Beverage Corp | BNP Paribas | (379) |
| | | BNP Paribas | (329) | 161 | Monster Beverage Corp | Goldam Sachs | (116) |
| 13 | MercadoLibre Inc | BNP Paribas | (1.545) | 753 | Monster Beverage Corp | HSBC | 3.629 |
| 1.207 | Merck & Co Inc | JP Morgan | 830 | 85 | Moody's Corp | Barclays Bank | 577 |
| 244 | Merck & Co Inc | Citibank | 678 | 1 | Moody's Corp | BNP Paribas | 14 |
| (280) | Meta Platforms Inc 'A' | Barclays Bank | 13.450 | (236) | Morgan Stanley | Barclays Bank | (911) |
| 4.164 | MetLife Inc | Goldam Sachs | 10.174 | (545) | Morgan Stanley | BNP Paribas | (3.417) |
| 2.858 | MetLife Inc | HSBC | 1.101 | (187) | Morgan Stanley | Citibank | (722) |
| 715 | Mettler-Toledo International Inc | Bank of America | 11.004 | (715) | Morgan Stanley | HSBC | (3.589) |
| 150 | Mettler-Toledo International Inc | Merrill Lynch | 8.315 | (140) | Mosaic Co | BNP Paribas | 113 |
| 140 | Mettler-Toledo International Inc | Barclays Bank | 6.896 | (353) | Mosaic Co | Citibank | (448) |
| 94 | Mettler-Toledo International Inc | Goldam Sachs | (4.705) | (132) | Mosaic Co | Goldam Sachs | 107 |
| (2.544) | MGM Resorts International | Barclays Bank | (244) | (96) | Motorola Solutions Inc | Bank of America | |
| (2.711) | MGM Resorts International | BNP Paribas | (489) | | Motorola Solutions Inc | Merrill Lynch | (896) |
| (368) | MGM Resorts International | Goldam Sachs | (2) | (173) | Motorola Solutions Inc | Barclays Bank | (1.045) |
| (109) | MGM Resorts International | JP Morgan | (10.078) | (281) | Motorola Solutions Inc | BNP Paribas | (2.622) |
| (1.829) | Microchip Technology Inc | Bank of America | (3.419) | (53) | Motorola Solutions Inc | Citibank | (320) |
| | | Merrill Lynch | (105) | (601) | Motorola Solutions Inc | Goldam Sachs | (5.607) |
| (770) | Microchip Technology Inc | Barclays Bank | 931 | (59) | Motorola Solutions Inc | HSBC | (988) |
| (19) | Microchip Technology Inc | Goldam Sachs | 387 | (117) | Motorola Solutions Inc | JP Morgan | (1.960) |
| 439 | Micron Technology Inc | Bank of America | 74 | 54 | MSCI Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 459 | | MSCI Inc | Merrill Lynch | 2.320 |
| 129 | Micron Technology Inc | Barclays Bank | 2.365 | 94 | MSCI Inc | Barclays Bank | 2.376 |
| 35 | Micron Technology Inc | BNP Paribas | 6.769 | 90 | MSCI Inc | BNP Paribas | 3.866 |
| 153 | Micron Technology Inc | Citibank | 6.701 | 21 | MSCI Inc | HSBC | 1.341 |
| 707 | Micron Technology Inc | Goldam Sachs | 561 | (292) | Nasdaq Inc | BNP Paribas | (2.610) |
| 355 | Microsoft Corp | Bank of America | 5.021 | (53) | Nasdaq Inc | Goldam Sachs | (474) |
| | | Merrill Lynch | 310 | 166 | NetApp Inc | Bank of America | |
| 657 | Microsoft Corp | Barclays Bank | 11.969 | | NetApp Inc | Merrill Lynch | 71 |
| 49 | Microsoft Corp | BNP Paribas | (890) | 1.394 | NetApp Inc | Barclays Bank | 4.767 |
| 537 | Microsoft Corp | Goldam Sachs | (832) | 2.664 | NetApp Inc | BNP Paribas | 1.146 |
| 123 | Microsoft Corp | HSBC | (239) | 1.557 | NetApp Inc | Goldam Sachs | 670 |
| 1.909 | Microsoft Corp | JP Morgan | (291) | 659 | NetApp Inc | HSBC | 1.168 |
| (84) | Moderna Inc | BNP Paribas | 864 | (44) | Netflix Inc | Bank of America | |
| (90) | Moderna Inc | Citibank | (1.083) | | Netflix Inc | Merrill Lynch | (293) |
| (67) | Mohawk Industries Inc | Barclays Bank | (515) | (126) | Netflix Inc | Barclays Bank | (723) |
| (93) | Mohawk Industries Inc | BNP Paribas | (502) | (152) | Netflix Inc | HSBC | (3.052) |
| (102) | Mohawk Industries Inc | HSBC | (4.396) | 131 | Neurocrine Biosciences Inc | Barclays Bank | 791 |
| 250 | Molina Healthcare Inc | Bank of America | (572) | 135 | Neurocrine Biosciences Inc | Goldam Sachs | 1.033 |
| | | Merrill Lynch | (1.548) | 647 | Neurocrine Biosciences Inc | JP Morgan | 10.831 |
| 41 | Molina Healthcare Inc | Barclays Bank | (1.083) | (1.220) | Newell Brands Inc | Bank of America | |
| 116 | Molina Healthcare Inc | BNP Paribas | (515) | | Newell Brands Inc | Merrill Lynch | 1.415 |
| 350 | Molina Healthcare Inc | Citibank | (502) | (4.040) | Newell Brands Inc | BNP Paribas | 4.686 |
| 132 | Molina Healthcare Inc | Goldam Sachs | (4.396) | (381) | Newell Brands Inc | Citibank | (701) |
| 737 | Molson Coors Beverage Co 'B' | BNP Paribas | (336) | (4.800) | Newell Brands Inc | Goldam Sachs | 5.568 |
| 160 | Molson Coors Beverage Co 'B' | Goldam Sachs | (1.113) | (432) | Newell Brands Inc | HSBC | 1.223 |
| (1.357) | Mondelez International Inc 'A' | Barclays Bank | 6.586 | (205) | Newmont Corp | Barclays Bank | (50) |
| (2.014) | Mondelez International Inc 'A' | BNP Paribas | | (144) | Newmont Corp | BNP Paribas | 1 |
| | | | | (146) | Newmont Corp | Goldam Sachs | (101) |
| | | | | (364) | Newmont Corp | HSBC | (36) |
| | | | | 870 | News Corp 'A' | Barclays Bank | (70) |
| | | | | 1.705 | News Corp 'A' | BNP Paribas | (494) |
| | | | | 2.117 | News Corp 'A' | Goldam Sachs | (614) |
| | | | | 1.150 | News Corp 'A' | HSBC | (184) |
| | | | | (100) | NextEra Energy Inc | BNP Paribas | (622) |
| | | | | (384) | NextEra Energy Inc | Goldam Sachs | (2.387) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 101 | NIKE Inc 'B' | Barclays Bank | 764 | 386 | ON Semiconductor Corp | Bank of America | |
| 90 | NIKE Inc 'B' | BNP Paribas | 323 | | | Merrill Lynch | 1.872 |
| 78 | NIKE Inc 'B' | Citibank | 590 | 237 | ON Semiconductor Corp | Citibank | 974 |
| 74 | NIKE Inc 'B' | Goldam Sachs | 266 | 261 | ON Semiconductor Corp | Goldam Sachs | 855 |
| 100 | NIKE Inc 'B' | HSBC | 498 | 641 | ONEOK Inc | Bank of America | |
| 92 | NIKE Inc 'B' | JP Morgan | 458 | | | Merrill Lynch | 1.051 |
| 524 | Nordson Corp | Bank of America | | 7.414 | ONEOK Inc | BNP Paribas | 12.159 |
| | | Merrill Lynch | 2.672 | 492 | ONEOK Inc | Citibank | 1.609 |
| 298 | Nordson Corp | Barclays Bank | 2.944 | 387 | ONEOK Inc | Goldam Sachs | 635 |
| 83 | Nordson Corp | BNP Paribas | 423 | 265 | ONEOK Inc | HSBC | 1.357 |
| 48 | Nordson Corp | Citibank | 474 | (800) | Oracle Corp | Bank of America | |
| 1.153 | Nordson Corp | Goldam Sachs | 5.880 | | | Merrill Lynch | (2.098) |
| 64 | Nordson Corp | HSBC | 451 | (851) | Oracle Corp | BNP Paribas | (2.059) |
| (42) | Norfolk Southern Corp | BNP Paribas | (3) | (857) | Oracle Corp | Goldam Sachs | (2.074) |
| 294 | Northern Trust Corp | Bank of America | | (1.235) | Oracle Corp | HSBC | (1.035) |
| | | Merrill Lynch | 2.390 | (25) | O'Reilly Automotive Inc | Citibank | (1.597) |
| 739 | Northern Trust Corp | Barclays Bank | 3.939 | 1.514 | Otis Worldwide Corp | BNP Paribas | (257) |
| 583 | Northern Trust Corp | BNP Paribas | 4.740 | 1.526 | Otis Worldwide Corp | Goldam Sachs | (259) |
| 175 | Northern Trust Corp | Citibank | 933 | 575 | Owens Corning | Barclays Bank | 1.369 |
| 660 | Northern Trust Corp | Goldam Sachs | 5.366 | 213 | Owens Corning | Goldam Sachs | 337 |
| (437) | NortonLifeLock Inc | Bank of America | | 363 | Owens Corning | HSBC | 1.263 |
| | | Merrill Lynch | (359) | (403) | PACCAR Inc | Bank of America | |
| (1.184) | NortonLifeLock Inc | Barclays Bank | (36) | | | Merrill Lynch | (830) |
| (579) | NortonLifeLock Inc | BNP Paribas | (434) | (593) | PACCAR Inc | Goldam Sachs | (1.222) |
| (63) | Novavax Inc | Bank of America | | (366) | PACCAR Inc | HSBC | 4 |
| | | Merrill Lynch | (571) | (339) | Packaging Corp of America | Goldam Sachs | (485) |
| (64) | Novavax Inc | Barclays Bank | (362) | (3.931) | Palantir Technologies Inc 'A' | Barclays Bank | (2.929) |
| (27) | Novavax Inc | BNP Paribas | (245) | (3.167) | Palantir Technologies Inc 'A' | Citibank | (2.359) |
| (116) | Novavax Inc | Goldam Sachs | (1.051) | 29 | Palo Alto Networks Inc | Barclays Bank | 88 |
| (78) | Novocure Ltd | Bank of America | | 125 | Palo Alto Networks Inc | BNP Paribas | 4.393 |
| | | Merrill Lynch | (1.143) | 112 | Palo Alto Networks Inc | Goldam Sachs | 2.974 |
| (67) | Novocure Ltd | Barclays Bank | (287) | 72 | Palo Alto Networks Inc | HSBC | 1.767 |
| (441) | Novocure Ltd | BNP Paribas | (6.465) | 85 | Palo Alto Networks Inc | JP Morgan | 3.724 |
| 323 | Nucor Corp | Bank of America | | 339 | Parker-Hannifin Corp | BNP Paribas | 1.692 |
| | | Merrill Lynch | 4.963 | 130 | Parker-Hannifin Corp | HSBC | (104) |
| 235 | Nucor Corp | BNP Paribas | 2.487 | 199 | Paychex Inc | Bank of America | |
| 101 | Nucor Corp | HSBC | 975 | | | Merrill Lynch | 686 |
| 271 | NVIDIA Corp | Bank of America | | 373 | Paychex Inc | BNP Paribas | 951 |
| | | Merrill Lynch | 3.515 | 99 | Paychex Inc | Citibank | 436 |
| 153 | NVIDIA Corp | Barclays Bank | 2.544 | 181 | Paychex Inc | Goldam Sachs | 791 |
| 704 | NVIDIA Corp | BNP Paribas | 9.131 | 80 | Paychex Inc | HSBC | 187 |
| 304 | NVIDIA Corp | Goldam Sachs | 5.902 | 35 | Paycom Software Inc | Goldam Sachs | 234 |
| 442 | NVIDIA Corp | HSBC | 7.093 | 48 | Paycom Software Inc | HSBC | 303 |
| 2 | NVR Inc | Bank of America | | (143) | PayPal Holdings Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 302 | | | Merrill Lynch | (909) |
| 10 | NVR Inc | Barclays Bank | 1.712 | (243) | PayPal Holdings Inc | Barclays Bank | (688) |
| 3 | NVR Inc | BNP Paribas | 452 | (1.273) | PayPal Holdings Inc | Goldam Sachs | (8.096) |
| 5 | NVR Inc | Goldam Sachs | 754 | (397) | PayPal Holdings Inc | HSBC | (1.779) |
| 3 | NVR Inc | JP Morgan | 37 | 1 | Pebblebrook Hotel Trust (REIT) ^{††} | BNP Paribas | — |
| (56) | NXP Semiconductors NV | Bank of America | | (3.877) | Peloton Interactive Inc 'A' | BNP Paribas | 4.963 |
| | | Merrill Lynch | (786) | (3.542) | Peloton Interactive Inc 'A' | Goldam Sachs | 2.075 |
| (246) | NXP Semiconductors NV | Barclays Bank | (2.544) | (412) | Peloton Interactive Inc 'A' | HSBC | (29) |
| (197) | NXP Semiconductors NV | BNP Paribas | (2.766) | 1.440 | Pentair Plc | Barclays Bank | 619 |
| (298) | NXP Semiconductors NV | Citibank | (3.081) | 1.332 | Pentair Plc | BNP Paribas | (107) |
| (143) | NXP Semiconductors NV | Goldam Sachs | (2.008) | 2.445 | PepsiCo Inc | Bank of America | |
| (1.463) | Occidental Petroleum Corp | Goldam Sachs | (7.139) | | | Merrill Lynch | (24.132) |
| (11) | Okta Inc | BNP Paribas | 50 | 723 | PepsiCo Inc | Barclays Bank | — |
| (711) | Okta Inc | Goldam Sachs | 3.214 | 755 | PepsiCo Inc | Goldam Sachs | (7.452) |
| (118) | Okta Inc | HSBC | 470 | 188 | PepsiCo Inc | HSBC | (941) |
| 421 | Old Dominion Freight Line Inc | Goldam Sachs | (2.884) | (1.211) | PerkinElmer Inc | Barclays Bank | (5.680) |
| 583 | Old Dominion Freight Line Inc | HSBC | (9.077) | (542) | PerkinElmer Inc | BNP Paribas | (2.374) |
| (142) | Omnicom Group Inc | Bank of America | | (204) | PerkinElmer Inc | Goldam Sachs | (894) |
| | | Merrill Lynch | 376 | (2.046) | Pfizer Inc | BNP Paribas | (2.864) |
| (1.151) | Omnicom Group Inc | Barclays Bank | 1.738 | (211) | Pfizer Inc | Goldam Sachs | (295) |
| (396) | Omnicom Group Inc | BNP Paribas | 1.049 | 187 | Phillips 66 | BNP Paribas | 1.161 |
| (1.588) | Omnicom Group Inc | Goldam Sachs | 4.208 | 166 | Phillips 66 | Citibank | 1.363 |
| (129) | Omnicom Group Inc | HSBC | 192 | 55 | Phillips 66 | Goldam Sachs | 342 |
| | | | | 620 | Phillips 66 | HSBC | 8.562 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|-----------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 517 | Phillips 66 | JP Morgan | 7.140 | (584) | Qorvo Inc | Barclays Bank | (2.071) |
| 1.073 | Pinterest Inc 'A' | Bank of America | | (323) | Qorvo Inc | BNP Paribas | (1.381) |
| | | Merrill Lynch | (1.717) | (111) | Qorvo Inc | Goldam Sachs | (886) |
| 1.319 | Pinterest Inc 'A' | Barclays Bank | (3.561) | 57 | QUALCOMM Inc | Bank of America | |
| 1.952 | Pinterest Inc 'A' | BNP Paribas | (3.123) | | | Merrill Lynch | 255 |
| 168 | Pinterest Inc 'A' | Citibank | (454) | 1.299 | QUALCOMM Inc | BNP Paribas | 6.532 |
| 1.775 | Pinterest Inc 'A' | Goldam Sachs | (2.840) | 1.254 | QUALCOMM Inc | Goldam Sachs | 5.605 |
| 122 | Pinterest Inc 'A' | HSBC | (145) | 240 | QUALCOMM Inc | JP Morgan | 830 |
| 136 | Pioneer Natural Resources Co | | | (485) | Quest Diagnostics Inc | BNP Paribas | (2.343) |
| 307 | Pioneer Natural Resources Co | Barclays Bank | 1.738 | (193) | Quest Diagnostics Inc | HSBC | (774) |
| 19 | Pioneer Natural Resources Co | BNP Paribas | 4.912 | (609) | Raymond James Financial Inc | BNP Paribas | (3.118) |
| | | | | 74 | Regeneron | | |
| (3.710) | Plug Power Inc | Goldam Sachs | 304 | | Pharmaceuticals Inc | BNP Paribas | 1.805 |
| (1.556) | Plug Power Inc | Barclays Bank | (6.771) | 31 | Regeneron | | |
| (145) | Plug Power Inc | BNP Paribas | (6.170) | | Pharmaceuticals Inc | Citibank | (78) |
| (588) | Plug Power Inc | Citibank | (265) | 4 | Regeneron | | |
| (2) | PNC Financial Services Group Inc | Goldam Sachs | (2.331) | | Pharmaceuticals Inc | Goldam Sachs | 98 |
| (801) | PNC Financial Services Group Inc | Barclays Bank | (24) | 1.006 | Regions Financial Corp | Barclays Bank | 1.076 |
| (254) | PNC Financial Services Group Inc | BNP Paribas | (15.195) | 1.475 | Regions Financial Corp | Goldam Sachs | 3.053 |
| (75) | PNC Financial Services Group Inc | Goldam Sachs | (4.818) | 5.025 | Regions Financial Corp | HSBC | 6.131 |
| (103) | PNC Financial Services Group Inc | HSBC | (793) | 1.126 | Regions Financial Corp | JP Morgan | 1.374 |
| 414 | Pool Corp | JP Morgan | (1.089) | (2.442) | Republic Services Inc | Bank of America | |
| 110 | Pool Corp | Barclays Bank | (2.256) | (3.871) | Republic Services Inc | Merrill Lynch | (9.499) |
| (121) | PPG Industries Inc | BNP Paribas | (206) | (92) | ResMed Inc | Goldam Sachs | (15.058) |
| (586) | PPG Industries Inc | Bank of America | | (47) | ResMed Inc | Bank of America | |
| (92) | PPG Industries Inc | Merrill Lynch | (640) | (85) | ResMed Inc | Merrill Lynch | (628) |
| (80) | PPG Industries Inc | Barclays Bank | (1.729) | 81 | RingCentral Inc 'A' | Barclays Bank | (248) |
| (129) | PPG Industries Inc | BNP Paribas | (487) | | | BNP Paribas | (581) |
| (65) | PPG Industries Inc | Citibank | (236) | 117 | RingCentral Inc 'A' | Bank of America | |
| (927) | Principal Financial Group Inc | Goldam Sachs | (682) | 187 | RingCentral Inc 'A' | Merrill Lynch | 148 |
| 260 | Procter & Gamble Co | HSBC | 90 | 83 | RingCentral Inc 'A' | Barclays Bank | 267 |
| | | BNP Paribas | (2.197) | 87 | RingCentral Inc 'A' | BNP Paribas | 342 |
| 972 | Procter & Gamble Co | Bank of America | | (271) | Rivian Automotive Inc 'A' | Citibank | 420 |
| 395 | Procter & Gamble Co | Merrill Lynch | (2.254) | (552) | Rivian Automotive Inc 'A' | JP Morgan | (370) |
| 1.187 | Procter & Gamble Co | BNP Paribas | (8.427) | 2.747 | Robert Half International Inc | Citibank | (797) |
| 134 | Procter & Gamble Co | Citibank | 553 | | | Goldam Sachs | (3.351) |
| (632) | Progressive Corp | Goldam Sachs | (10.291) | 342 | Robert Half International Inc | Barclays Bank | (769) |
| (645) | Progressive Corp | JP Morgan | (1.227) | 487 | Robert Half International Inc | BNP Paribas | (1.327) |
| (1.539) | Progressive Corp | Bank of America | (5.663) | | | Goldam Sachs | (1.890) |
| (624) | Progressive Corp | Merrill Lynch | (3.722) | (2.037) | Robinhood Markets Inc 'A' | Barclays Bank | (509) |
| (629) | Prudential Financial Inc | Barclays Bank | (13.789) | (876) | Robinhood Markets Inc 'A' | BNP Paribas | (175) |
| (440) | PTC Inc | BNP Paribas | (5.591) | (3.155) | Robinhood Markets Inc 'A' | Goldam Sachs | (631) |
| (86) | PTC Inc | Goldam Sachs | (2.579) | (262) | Rockwell Automation Inc | Barclays Bank | (1.522) |
| (114) | PTC Inc | Citibank | (1.681) | (77) | Rockwell Automation Inc | BNP Paribas | (468) |
| (104) | PTC Inc | Barclays Bank | (671) | (155) | Rockwell Automation Inc | Goldam Sachs | (1.240) |
| 1.483 | Public Service Enterprise Group Inc | HSBC | (889) | (128) | Rockwell Automation Inc | HSBC | (562) |
| 1.139 | Public Service Enterprise Group Inc | BNP Paribas | (1.064) | 157 | Roku Inc | Barclays Bank | 491 |
| 1.165 | Public Service Enterprise Group Inc | Bank of America | | (1.783) | Rollins Inc | Bank of America | |
| 600 | Public Service Enterprise Group Inc | Merrill Lynch | 311 | | | Merrill Lynch | (1.765) |
| 176 | Public Service Enterprise Group Inc | Barclays Bank | (11) | (400) | Rollins Inc | Barclays Bank | (236) |
| 298 | Public Service Enterprise Group Inc | BNP Paribas | 245 | (714) | Rollins Inc | BNP Paribas | (707) |
| 543 | Public Service Enterprise Group Inc | Citibank | (6) | (203) | Rollins Inc | Goldam Sachs | (201) |
| 695 | PulteGroup Inc | Goldam Sachs | 37 | (2.475) | Rollins Inc | HSBC | (5.420) |
| | | HSBC | (235) | (532) | Rollins Inc | JP Morgan | (1.165) |
| | | JP Morgan | (429) | (37) | Roper Technologies Inc | Bank of America | |
| | | BNP Paribas | 1.453 | | | Merrill Lynch | (374) |
| | | | | (44) | Roper Technologies Inc | Barclays Bank | (707) |
| | | | | (528) | Roper Technologies Inc | BNP Paribas | (5.479) |
| | | | | (216) | Roper Technologies Inc | Citibank | (3.469) |
| | | | | (101) | Roper Technologies Inc | Goldam Sachs | (1.021) |
| | | | | (79) | Roper Technologies Inc | HSBC | (557) |
| | | | | (216) | Roper Technologies Inc | JP Morgan | (1.523) |
| | | | | (106) | Ross Stores Inc | Barclays Bank | (666) |
| | | | | (560) | Ross Stores Inc | BNP Paribas | (1.514) |
| | | | | (856) | Ross Stores Inc | Citibank | (5.376) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (123) | Ross Stores Inc | HSBC | 1.031 | (181) | Sensata Technologies Holding Plc | HSBC | (445) |
| (98) | Ross Stores Inc | JP Morgan | 821 | 122 | ServiceNow Inc | Bank of America | |
| (615) | Royal Caribbean Cruises Ltd | Barclays Bank | (2.698) | | | Merrill Lynch | 4.911 |
| (1.610) | Royal Caribbean Cruises Ltd | BNP Paribas | 3.839 | 751 | ServiceNow Inc | Barclays Bank | 30.303 |
| (386) | Royal Caribbean Cruises Ltd | Citibank | (1.127) | 64 | ServiceNow Inc | BNP Paribas | 2.403 |
| (2.417) | Royal Caribbean Cruises Ltd | Goldam Sachs | 6.362 | 446 | ServiceNow Inc | Goldam Sachs | 16.495 |
| (942) | Royalty Pharma Plc 'A' | BNP Paribas | (377) | 76 | ServiceNow Inc | HSBC | 3.294 |
| (3.516) | Royalty Pharma Plc 'A' | Goldam Sachs | (1.406) | (17) | Sherwin-Williams Co | Barclays Bank | (125) |
| (791) | RPM International Inc | Bank of America | | (1.379) | Sherwin-Williams Co | BNP Paribas | 6.550 |
| | | Merrill Lynch | (4.232) | (163) | Signature Bank | BNP Paribas | (3.720) |
| (2.690) | RPM International Inc | Barclays Bank | (9.818) | (3.350) | Sirius XM Holdings Inc | Barclays Bank | (436) |
| (1.687) | RPM International Inc | BNP Paribas | (9.025) | (8.911) | Sirius XM Holdings Inc | BNP Paribas | (2.050) |
| (269) | RPM International Inc | Citibank | (982) | 111 | Skyworks Solutions Inc | Bank of America | |
| (1.047) | RPM International Inc | Goldam Sachs | (5.601) | | | Merrill Lynch | 609 |
| (579) | RPM International Inc | HSBC | (2.565) | 78 | Skyworks Solutions Inc | Barclays Bank | 406 |
| (32) | S&P Global Inc | Bank of America | | 481 | Skyworks Solutions Inc | BNP Paribas | 2.641 |
| | | Merrill Lynch | (601) | 13 | Skyworks Solutions Inc | JP Morgan | 69 |
| (344) | S&P Global Inc | Barclays Bank | (1.249) | (552) | Snap Inc 'A' | Bank of America | |
| (170) | S&P Global Inc | BNP Paribas | (3.194) | | | Merrill Lynch | 4.990 |
| (417) | salesforce.com Inc | Barclays Bank | (100) | (1.808) | Snap Inc 'A' | BNP Paribas | 16.344 |
| (135) | salesforce.com Inc | BNP Paribas | 481 | (297) | Snap-on Inc | Bank of America | |
| (622) | salesforce.com Inc | Citibank | (149) | | | Merrill Lynch | (1.108) |
| (204) | salesforce.com Inc | Goldam Sachs | 726 | (45) | Snap-on Inc | Barclays Bank | (371) |
| (124) | salesforce.com Inc | HSBC | 377 | (136) | Snap-on Inc | Goldam Sachs | (507) |
| (351) | salesforce.com Inc | JP Morgan | 1.067 | 140 | Snowflake Inc 'A' | HSBC | (2.156) |
| 6.419 | Schlumberger NV | BNP Paribas | 36.396 | (1.065) | SoFi Technologies Inc | Bank of America | |
| 1.955 | Schlumberger NV | Goldam Sachs | 11.085 | | | Merrill Lynch | (671) |
| 1.219 | Schlumberger NV | HSBC | 11.946 | (4.368) | SoFi Technologies Inc | Barclays Bank | (1.179) |
| | | Bank of America | | (13.065) | SoFi Technologies Inc | BNP Paribas | (8.231) |
| 65 | Seagate Technology Holdings Plc | Merrill Lynch | (34) | (864) | SoFi Technologies Inc | Goldam Sachs | (544) |
| 133 | Seagate Technology Holdings Plc | Barclays Bank | 49 | (228) | SolarEdge Technologies Inc | Barclays Bank | (5.100) |
| 799 | Seagate Technology Holdings Plc | BNP Paribas | (423) | (321) | SolarEdge Technologies Inc | BNP Paribas | (17.722) |
| 126 | Seagate Technology Holdings Plc | Citibank | 47 | 826 | Southwest Airlines Co | Barclays Bank | 1.611 |
| 127 | Seagate Technology Holdings Plc | Goldam Sachs | (67) | (38.622) | Spectrum Brands Holdings Inc | JP Morgan | (54.843) |
| 289 | Seagate Technology Holdings Plc | HSBC | 561 | | | BNP Paribas | 6.105 |
| 123 | Seagate Technology Holdings Plc | JP Morgan | 239 | 77 | Splunk Inc | Goldam Sachs | 658 |
| (225) | Seagen Inc | Barclays Bank | 95 | (1.292) | SS&C Technologies Holdings Inc | Bank of America | |
| (95) | Seagen Inc | BNP Paribas | 344 | | | Merrill Lynch | (5.866) |
| (260) | Seagen Inc | Goldam Sachs | 941 | (2.055) | SS&C Technologies Holdings Inc | Barclays Bank | (4.172) |
| 39 | Sealed Air Corp | Barclays Bank | 60 | (1.463) | SS&C Technologies Holdings Inc | BNP Paribas | (6.642) |
| 3.042 | Sealed Air Corp | Goldam Sachs | 213 | (267) | SS&C Technologies Holdings Inc | Citibank | (542) |
| (927) | SEI Investments Co | Bank of America | | (764) | SS&C Technologies Holdings Inc | Goldam Sachs | (3.469) |
| | | Merrill Lynch | (3.059) | (523) | SS&C Technologies Holdings Inc | HSBC | (1.919) |
| (1.021) | SEI Investments Co | Barclays Bank | (2.532) | (137) | Stanley Black & Decker Inc | Bank of America | |
| (719) | SEI Investments Co | BNP Paribas | (2.373) | | | Merrill Lynch | 137 |
| (1.112) | SEI Investments Co | Goldam Sachs | (3.670) | (659) | Stanley Black & Decker Inc | Barclays Bank | 185 |
| (452) | SEI Investments Co | JP Morgan | (1.383) | (1.213) | Stanley Black & Decker Inc | BNP Paribas | 1.213 |
| 66 | Sempra Energy | Barclays Bank | (114) | (143) | Stanley Black & Decker Inc | Citibank | 40 |
| 1.544 | Sempra Energy | BNP Paribas | 4.633 | (353) | Stanley Black & Decker Inc | Goldam Sachs | 263 |
| 608 | Sempra Energy | Goldam Sachs | 2.278 | (122) | Stanley Black & Decker Inc | JP Morgan | 1.003 |
| 178 | Sempra Energy | HSBC | 301 | 143 | Starbucks Corp | Barclays Bank | 521 |
| (1.264) | Sensata Technologies Holding Plc | Bank of America | | 1.803 | Starbucks Corp | Citibank | 6.563 |
| | | Merrill Lynch | (3.451) | 128 | Starbucks Corp | HSBC | 457 |
| (1.265) | Sensata Technologies Holding Plc | Barclays Bank | (1.708) | 495 | State Street Corp | Barclays Bank | 1.143 |
| (425) | Sensata Technologies Holding Plc | BNP Paribas | (1.160) | 233 | State Street Corp | HSBC | 650 |
| (559) | Sensata Technologies Holding Plc | Goldam Sachs | (1.526) | 241 | Steel Dynamics Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 2.449 |
| | | | | 167 | Steel Dynamics Inc | Barclays Bank | 1.192 |
| | | | | 2.352 | Steel Dynamics Inc | BNP Paribas | 23.896 |
| | | | | 407 | Steel Dynamics Inc | Goldam Sachs | 4.097 |
| | | | | 144 | Steel Dynamics Inc | HSBC | 1.491 |
| | | | | (587) | STERIS Plc | Barclays Bank | (1.057) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (431) | STERIS Plc | BNP Paribas | (4.913) | (4.122) | Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR | BNP Paribas | (4.163) |
| (49) | STERIS Plc | Goldam Sachs | (559) | | | | |
| (36) | STERIS Plc | HSBC | (582) | (1.050) | Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR | Goldam Sachs | (1.061) |
| (276) | Stryker Corp | Barclays Bank | 36 | 268 | Texas Instruments Inc | BNP Paribas | 1.576 |
| (133) | Stryker Corp | BNP Paribas | 124 | 60 | Texas Instruments Inc | Citibank | 308 |
| (44) | Stryker Corp | Goldam Sachs | 41 | 549 | Texas Instruments Inc | Goldam Sachs | 3.228 |
| (2.378) | Sunrun Inc | Barclays Bank | (7.086) | 160 | Texas Instruments Inc | HSBC | 1.510 |
| (2.575) | Sunrun Inc | BNP Paribas | (14.600) | (366) | Thermo Fisher Scientific Inc | Barclays Bank | (5.940) |
| (781) | Sunrun Inc | Citibank | (2.327) | (186) | Thermo Fisher Scientific Inc | BNP Paribas | (5.963) |
| (414) | Sunrun Inc | Goldam Sachs | (2.347) | (83) | Thermo Fisher Scientific Inc | Citibank | (1.347) |
| (763) | Sunrun Inc | HSBC | (3.968) | (33) | Thermo Fisher Scientific Inc | Goldam Sachs | (1.058) |
| 53 | SVB Financial Group | Barclays Bank | 1.961 | (503) | TJX Cos Inc | Bank of America | |
| 98 | SVB Financial Group | BNP Paribas | 5.179 | | | Merrill Lynch | (2.755) |
| 20 | SVB Financial Group | Citibank | 740 | (943) | TJX Cos Inc | BNP Paribas | (6.535) |
| 119 | SVB Financial Group | Goldam Sachs | 6.289 | (1.037) | TJX Cos Inc | Citibank | (2.841) |
| 33 | SVB Financial Group | HSBC | 501 | (1.239) | TJX Cos Inc | Goldam Sachs | (8.586) |
| 307 | Synchrony Financial | Bank of America | | (166) | TJX Cos Inc | HSBC | (649) |
| | | Merrill Lynch | 1.273 | (261) | TJX Cos Inc | JP Morgan | (1.021) |
| 273 | Synchrony Financial | Barclays Bank | 614 | (1.377) | T-Mobile US Inc | Barclays Bank | (4.461) |
| 213 | Synchrony Financial | BNP Paribas | 679 | (1.013) | T-Mobile US Inc | Goldam Sachs | (6.666) |
| 563 | Synchrony Financial | Citibank | 1.267 | (4) | Torchmark Corp | Bank of America | |
| 232 | Synchrony Financial | Goldam Sachs | 740 | | | Merrill Lynch | (5) |
| 84 | Synopsys Inc | Bank of America | | (587) | Torchmark Corp | Barclays Bank | (1.039) |
| | | Merrill Lynch | 3.722 | (2.483) | Torchmark Corp | BNP Paribas | (2.880) |
| 1.877 | Synopsys Inc | Citibank | 20.760 | (697) | Torchmark Corp | Goldam Sachs | (809) |
| 113 | Synopsys Inc | JP Morgan | 6.286 | (241) | Torchmark Corp | HSBC | 268 |
| (699) | Sysco Corp | BNP Paribas | 671 | 501 | Tractor Supply Co | Barclays Bank | 6.172 |
| (797) | Sysco Corp | Goldam Sachs | 765 | (86) | Trade Desk Inc 'A' | Bank of America | |
| (127) | Sysco Corp | HSBC | (318) | | | Merrill Lynch | (30) |
| (225) | T Rowe Price Group Inc | BNP Paribas | (1.292) | (1.505) | Trade Desk Inc 'A' | Barclays Bank | 1.776 |
| (199) | T Rowe Price Group Inc | Goldam Sachs | (1.142) | (163) | Trade Desk Inc 'A' | Goldam Sachs | (57) |
| (415) | T Rowe Price Group Inc | HSBC | (1.822) | (1.195) | Traneweb Markets Inc 'A' | Goldam Sachs | (3.716) |
| (114) | Take-Two Interactive Software Inc | Bank of America | | 738 | Trane Technologies Plc | Barclays Bank | 4.303 |
| | | Merrill Lynch | (870) | 15 | Trane Technologies Plc | HSBC | 42 |
| (1.150) | Take-Two Interactive Software Inc | Barclays Bank | (2.576) | (273) | TransUnion | Barclays Bank | (1.136) |
| (630) | Take-Two Interactive Software Inc | BNP Paribas | (8.567) | (857) | TransUnion | BNP Paribas | (4.088) |
| (122) | Take-Two Interactive Software Inc | Citibank | (273) | (94) | TransUnion | Citibank | (391) |
| (276) | Take-Two Interactive Software Inc | Goldam Sachs | (4.347) | (308) | TransUnion | Goldam Sachs | (1.469) |
| (86) | Take-Two Interactive Software Inc | HSBC | (369) | 315 | Travelers Cos Inc | Barclays Bank | 1.408 |
| 196 | Target Corp | Barclays Bank | 1.903 | 45 | Trimble Inc | Bank of America | |
| (67) | TE Connectivity Ltd | Bank of America | | 972 | Trimble Inc | Merrill Lynch | 124 |
| | | Merrill Lynch | (336) | 2.478 | Trimble Inc | Barclays Bank | 1.030 |
| (2.165) | TE Connectivity Ltd | Barclays Bank | (11.063) | 645 | Trimble Inc | BNP Paribas | 6.839 |
| (65) | TE Connectivity Ltd | BNP Paribas | (326) | 633 | Trimble Inc | Goldam Sachs | 1.780 |
| (228) | TE Connectivity Ltd | Goldam Sachs | (1.142) | 499 | Trimble Inc | HSBC | 3.861 |
| (1.554) | Teladoc Health Inc | Barclays Bank | (1.756) | (733) | Truist Financial Corp | JP Morgan | 3.044 |
| (906) | Teladoc Health Inc | BNP Paribas | (2.165) | (159) | Twilio Inc 'A' | BNP Paribas | (2.045) |
| (408) | Teladoc Health Inc | Citibank | (461) | (141) | Twilio Inc 'A' | Bank of America | |
| (1.219) | Teladoc Health Inc | Goldam Sachs | (2.913) | (683) | Twilio Inc 'A' | Merrill Lynch | (987) |
| (628) | Teladoc Health Inc | HSBC | (2.559) | (599) | Twilio Inc 'A' | Barclays Bank | (808) |
| (320) | Teledyne Technologies Inc | Barclays Bank | (262) | (167) | Twilio Inc 'A' | BNP Paribas | (4.241) |
| (401) | Teleflex Inc | Bank of America | | (44) | Tyler Technologies Inc | Goldam Sachs | (3.720) |
| | | Merrill Lynch | (1.841) | (578) | Tyler Technologies Inc | HSBC | (858) |
| (137) | Teleflex Inc | Barclays Bank | 470 | (178) | Tyler Technologies Inc | Bank of America | |
| (40) | Teleflex Inc | Goldam Sachs | (184) | (185) | Tyler Technologies Inc | Merrill Lynch | (431) |
| (108) | Teleflex Inc | HSBC | (2.833) | 153 | Tyson Foods Inc 'A' | Barclays Bank | (6.844) |
| (8.823) | Tenaris SA | BNP Paribas | (4.679) | 614 | Tyson Foods Inc 'A' | BNP Paribas | (1.743) |
| (10.371) | Tenaris SA | Goldam Sachs | (5.499) | 349 | Uber Technologies Inc | Goldam Sachs | (1.811) |
| (483) | Teradyne Inc | Barclays Bank | (2.345) | 1.696 | Uber Technologies Inc | BNP Paribas | (225) |
| (37) | Tesla Inc | BNP Paribas | (990) | 614 | Tyson Foods Inc 'A' | Goldam Sachs | (903) |
| (53) | Tesla Inc | Goldam Sachs | (1.418) | 349 | Uber Technologies Inc | BNP Paribas | (24) |
| (13.531) | Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR | Bank of America | | 4.990 | UGI Corp | Goldam Sachs | (119) |
| | | Merrill Lynch | (13.666) | 2.185 | UGI Corp | BNP Paribas | 12.974 |
| (8.322) | Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR | Barclays Bank | (3.911) | 70 | Ulta Beauty Inc | Goldam Sachs | 5.681 |
| | | | | | | Bank of America | |
| | | | | 415 | Ulta Beauty Inc | Merrill Lynch | 1.651 |
| | | | | 261 | Ulta Beauty Inc | Barclays Bank | 29.092 |
| | | | | 31 | Ulta Beauty Inc | Goldam Sachs | 6.157 |
| | | | | | | HSBC | 1.105 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (60) | Union Pacific Corp | Bank of America | | 214 | Vertex Pharmaceuticals Inc | HSBC | 7.116 |
| | | Merrill Lynch | 414 | (412) | VF Corp | Bank of America | |
| (99) | Union Pacific Corp | Barclays Bank | (406) | | | Merrill Lynch | (1.384) |
| (67) | Union Pacific Corp | BNP Paribas | (326) | (379) | VF Corp | Barclays Bank | (1.463) |
| (178) | Union Pacific Corp | Goldam Sachs | 1.228 | (1.532) | VF Corp | BNP Paribas | (5.148) |
| 161 | United Parcel Service Inc 'B' | Barclays Bank | 836 | (91) | VF Corp | Citibank | (351) |
| 298 | United Parcel Service Inc 'B' | BNP Paribas | (57) | (1.738) | VF Corp | Goldam Sachs | (5.840) |
| 42 | United Parcel Service Inc 'B' | Goldam Sachs | (8) | (1.456) | ViacomCBS Inc 'B' | BNP Paribas | (8.620) |
| 339 | United Parcel Service Inc 'B' | HSBC | (627) | (269) | ViacomCBS Inc 'B' | Citibank | (229) |
| 68 | United Rentals Inc | Bank of America | | (1.156) | ViacomCBS Inc 'B' | HSBC | (7.514) |
| | | Merrill Lynch | 735 | (2.937) | Viatis Inc | Barclays Bank | (1.292) |
| 113 | United Rentals Inc | Barclays Bank | 2.214 | (32) | Viatis Inc | Citibank | (14) |
| 383 | United Rentals Inc | BNP Paribas | 4.140 | (5.097) | Viatis Inc | Goldam Sachs | (4.740) |
| 125 | United Rentals Inc | Citibank | 2.449 | (74) | Visa Inc 'A' | Citibank | (343) |
| 225 | United Rentals Inc | Goldam Sachs | 2.432 | (426) | Visa Inc 'A' | Goldam Sachs | (6.126) |
| 112 | United Rentals Inc | HSBC | 1.644 | (34) | Vulcan Materials Co | Barclays Bank | (19) |
| 42 | United Rentals Inc | JP Morgan | 291 | (193) | Vulcan Materials Co | BNP Paribas | (838) |
| (201) | UnitedHealth Group Inc | Citibank | (2.050) | (170) | Vulcan Materials Co | Citibank | (95) |
| (231) | UnitedHealth Group Inc | Goldam Sachs | (3.017) | (559) | W R Berkley Corp | Bank of America | |
| (452) | Unity Software Inc | Barclays Bank | 344 | | | Merrill Lynch | (1.560) |
| (220) | Universal Health Services Inc 'B' | Bank of America | | (504) | W R Berkley Corp | Barclays Bank | (1.300) |
| | | Merrill Lynch | 81 | (237) | W R Berkley Corp | BNP Paribas | (661) |
| (774) | Universal Health Services Inc 'B' | BNP Paribas | 286 | (225) | W R Berkley Corp | Citibank | (581) |
| (222) | Universal Health Services Inc 'B' | HSBC | 322 | (402) | W R Berkley Corp | HSBC | (1.282) |
| (170) | Upstart Holdings Inc | Bank of America | | (423) | Walgreens Boots Alliance Inc | BNP Paribas | 292 |
| | | Merrill Lynch | (2.076) | (203) | Walmart Inc | Bank of America | |
| (345) | Upstart Holdings Inc | Barclays Bank | (2.777) | (618) | Walmart Inc | Merrill Lynch | (1.893) |
| (142) | Upstart Holdings Inc | BNP Paribas | (1.734) | (687) | Walmart Inc | Barclays Bank | (3.393) |
| (11) | Upstart Holdings Inc | Citibank | (89) | (247) | Walmart Inc | BNP Paribas | 3.008 |
| (467) | US Bancorp | Bank of America | | (439) | Walmart Inc | Citibank | (1.356) |
| | | Merrill Lynch | (1.896) | (532) | Walmart Inc | Goldam Sachs | 8.833 |
| (2.079) | US Bancorp | Barclays Bank | (3.285) | (808) | Walt Disney Co | HSBC | 10.558 |
| (4.000) | US Bancorp | BNP Paribas | (16.240) | (2.255) | Waste Connections Inc | BNP Paribas | (2.876) |
| (180) | US Bancorp | Citibank | (284) | (725) | Waste Connections Inc | Barclays Bank | (4.194) |
| 224 | Vail Resorts Inc | Barclays Bank | 2.253 | (660) | Waste Connections Inc | BNP Paribas | (624) |
| 298 | Vail Resorts Inc | BNP Paribas | 5.552 | (2.759) | Waste Management Inc | Goldam Sachs | (568) |
| 64 | Vail Resorts Inc | Citibank | 644 | | | Bank of America | |
| 152 | Vail Resorts Inc | Goldam Sachs | 2.832 | (496) | Waste Management Inc | Merrill Lynch | (3.256) |
| 373 | Vail Resorts Inc | HSBC | 5.319 | (181) | Waste Management Inc | BNP Paribas | (585) |
| 110 | Vail Resorts Inc | JP Morgan | 1.569 | (516) | Waste Management Inc | Citibank | (458) |
| 734 | Veeva Systems Inc 'A' | Barclays Bank | 3.890 | (842) | Waste Management Inc | Goldam Sachs | (609) |
| 316 | Veeva Systems Inc 'A' | BNP Paribas | 1.912 | 582 | Waters Corp | HSBC | 530 |
| 183 | Veeva Systems Inc 'A' | Goldam Sachs | 1.107 | 36 | Waters Corp | Barclays Bank | 4.150 |
| 102 | Veeva Systems Inc 'A' | JP Morgan | 224 | 27 | Waters Corp | BNP Paribas | 265 |
| 84 | VeriSign Inc | Bank of America | | (362) | Wayfair Inc 'A' | HSBC | 324 |
| | | Merrill Lynch | 752 | | | Bank of America | |
| 903 | VeriSign Inc | Barclays Bank | 6.131 | (995) | Wayfair Inc 'A' | Merrill Lynch | (2.016) |
| 693 | VeriSign Inc | BNP Paribas | 5.437 | (195) | Wayfair Inc 'A' | BNP Paribas | (5.542) |
| 52 | VeriSign Inc | Citibank | 353 | (331) | Webster Financial Corp | Goldam Sachs | (1.086) |
| 314 | VeriSign Inc | Goldam Sachs | 2.810 | (215) | Wells Fargo & Co | Goldam Sachs | (685) |
| (223) | Verisk Analytics Inc | Bank of America | | (2.276) | Wells Fargo & Co | BNP Paribas | (778) |
| | | Merrill Lynch | (876) | (787) | Wells Fargo & Co | Goldam Sachs | (8.239) |
| (105) | Verisk Analytics Inc | BNP Paribas | (413) | (176) | Wells Fargo & Co | HSBC | (1.472) |
| (132) | Verisk Analytics Inc | Citibank | (660) | 496 | West Pharmaceutical Services Inc | JP Morgan | (329) |
| (264) | Verisk Analytics Inc | Goldam Sachs | (1.038) | 22 | West Pharmaceutical Services Inc | Bank of America | |
| (105) | Verisk Analytics Inc | HSBC | 216 | 176 | West Pharmaceutical Services Inc | Merrill Lynch | 5.674 |
| 1.377 | Verizon Communications Inc | BNP Paribas | 2.802 | | | BNP Paribas | 252 |
| 1.747 | Verizon Communications Inc | Goldam Sachs | 3.555 | (1.199) | Western Digital Corp | BNP Paribas | |
| 361 | Verizon Communications Inc | JP Morgan | 886 | (430) | Western Digital Corp | Goldam Sachs | 2.013 |
| 124 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | (421) | Western Digital Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.748 | (230) | Western Digital Corp | Merrill Lynch | (2.458) |
| 9 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (1) | (1.060) | Western Union Co | Barclays Bank | (1.118) |
| 278 | Vertex Pharmaceuticals Inc | BNP Paribas | 3.920 | (570) | Western Union Co | BNP Paribas | (863) |
| 240 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Citibank | (19) | | | Citibank | (598) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | |
|---|--|-----------------|--|---|-----------------------------------|-----------------|--|------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | |
| (2.908) | Western Union Co | Citibank | (1.367) | (148) | Zimmer Biomet Holdings Inc | Barclays Bank | 209 | |
| (847) | Western Union Co | Goldam Sachs | (678) | (807) | Zimmer Biomet Holdings Inc | BNP Paribas | (3.470) | |
| (3.451) | Western Union Co | HSBC | (2.381) | (529) | Zimmer Biomet Holdings Inc | Goldam Sachs | (2.275) | |
| 132 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Barclays Bank | 944 | (503) | Zoetis Inc | Bank of America | | |
| 242 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | BNP Paribas | 2.059 | (214) | Zoetis Inc | Merrill Lynch | (2.253) | |
| 134 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | JP Morgan | 1.104 | (200) | Zoetis Inc | Barclays Bank | (1.494) | |
| 355 | Westrock Co | Bank of America | | (250) | Zoetis Inc | BNP Paribas | (896) | |
| 199 | Westrock Co | Merrill Lynch | 1.534 | (564) | Zoom Video Communications Inc 'A' | Citibank | (1.745) | |
| 447 | Westrock Co | Barclays Bank | 557 | (632) | Zoom Video Communications Inc 'A' | Barclays Bank | (10.507) | |
| 596 | Westrock Co | BNP Paribas | 961 | | Zoom Video Communications Inc 'A' | BNP Paribas | (12.033) | |
| 741 | Westrock Co | Citibank | 1.862 | (266) | Zoom Video Communications Inc 'A' | BNP Paribas | (4.956) | |
| 214 | Westrock Co | Goldam Sachs | 1.593 | (6) | Zoom Video Communications Inc 'A' | Citibank | | |
| (130) | Whirlpool Corp | HSBC | (610) | (190) | Zoom Video Communications Inc 'A' | Goldam Sachs | (114) | |
| (52) | Whirlpool Corp | Barclays Bank | (920) | | Zoom Video Communications Inc 'A' | HSBC | (2.968) | |
| (250) | Whirlpool Corp | BNP Paribas | (2) | (2.788) | ZoomInfo Technologies Inc | BNP Paribas | 5.604 | |
| (1.582) | Williams Cos Inc | Goldam Sachs | (8) | 41 | Zscaler Inc | Barclays Bank | 771 | |
| (3.931) | Williams Cos Inc | Barclays Bank | (2.531) | 62 | Zscaler Inc | BNP Paribas | 1.048 | |
| (3.319) | Williams Cos Inc | BNP Paribas | (8.570) | 71 | Zscaler Inc | BNP Paribas | 1.200 | |
| (1.366) | Williams Cos Inc | Goldam Sachs | (7.235) | | | Goldam Sachs | | |
| (836) | Willis Towers Watson Plc | HSBC | (3.934) | | | | (211.204) | |
| (137) | Willis Towers Watson Plc | Barclays Bank | (6.880) | | | | | |
| (49) | Willis Towers Watson Plc | BNP Paribas | (1.097) | Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 241.405.829) | | | | (853.303) |
| (392) | Wix.com Ltd | Goldam Sachs | (392) | | | | | |
| (203) | Wix.com Ltd | Barclays Bank | 1.047 | | | | | |
| (120) | Wix.com Ltd | BNP Paribas | 491 | | | | | |
| (3) | Wix.com Ltd | Goldam Sachs | 290 | | | | | |
| (77) | Wix.com Ltd | HSBC | 1 | | | | | |
| 479 | Workday Inc 'A' | JP Morgan | 28 | | | | | |
| 470 | Workday Inc 'A' | Bank of America | | | | | | |
| 662 | Workday Inc 'A' | Merrill Lynch | (9.978) | | | | | |
| 261 | Workday Inc 'A' | Barclays Bank | (4.963) | | | | | |
| 449 | Workday Inc 'A' | BNP Paribas | (13.178) | | | | | |
| 317 | Workday Inc 'A' | Citibank | (2.756) | | | | | |
| 126 | Workday Inc 'A' | Goldam Sachs | (9.353) | | | | | |
| 29 | WW Grainger Inc | HSBC | (6.651) | | | | | |
| 45 | WW Grainger Inc | JP Morgan | (2.369) | | | | | |
| 38 | WW Grainger Inc | BNP Paribas | 176 | | | | | |
| 541 | WW Grainger Inc | Citibank | 738 | | | | | |
| 102 | WW Grainger Inc | Goldam Sachs | 655 | | | | | |
| (1.295) | Wynn Resorts Ltd | HSBC | 3.608 | | | | | |
| (546) | Wynn Resorts Ltd | JP Morgan | 955 | | | | | |
| (272) | Wynn Resorts Ltd | Barclays Bank | (4.753) | | | | | |
| (1.174) | Wynn Resorts Ltd | BNP Paribas | (912) | | | | | |
| (696) | Xylem Inc | Citibank | (998) | | | | | |
| (159) | Xylem Inc | Goldam Sachs | (3.167) | | | | | |
| (430) | Xylem Inc | Barclays Bank | (2.046) | | | | | |
| (140) | Xylem Inc | BNP Paribas | (378) | | | | | |
| (578) | Xylem Inc | Citibank | (1.264) | | | | | |
| (186) | Xylem Inc | Goldam Sachs | (333) | | | | | |
| 2.209 | Yum! Brands Inc | HSBC | 462 | | | | | |
| 126 | Yum! Brands Inc | JP Morgan | 149 | | | | | |
| 1.002 | Yum! Brands Inc | Barclays Bank | 12.945 | | | | | |
| 220 | Yum! Brands Inc | BNP Paribas | 945 | | | | | |
| 201 | Zebra Technologies Corp 'A' | Goldam Sachs | 7.515 | | | | | |
| 207 | Zebra Technologies Corp 'A' | JP Morgan | 2.108 | | | | | |
| (262) | Zendesk Inc | BNP Paribas | 1.282 | | | | | |
| (91) | Zendesk Inc | Goldam Sachs | 1.321 | | | | | |
| (95) | Zendesk Inc | BNP Paribas | (912) | | | | | |
| (970) | Zillow Group Inc 'C' | Citibank | (998) | | | | | |
| (535) | Zillow Group Inc 'C' | Goldam Sachs | (912) | | | | | |
| (722) | Zillow Group Inc 'C' | Bank of America | (660) | | | | | |
| (234) | Zillow Group Inc 'C' | Merrill Lynch | (660) | | | | | |
| (74) | Zimmer Biomet Holdings Inc | Barclays Bank | 642 | | | | | |
| | | BNP Paribas | (491) | | | | | |
| | | Goldam Sachs | (159) | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (318) | | | | | |

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Marktwert USD |
|-------------------------------------|-----------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | USD 2.462.000 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.38 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 9.667 | (33.367) |
| CCCDs | USD 9.602.000 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.38 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (6.625) | (87.700) |
| CCCDs | EUR 9.107.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1 | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | (10.596) | (57.123) |
| CCCDs | EUR 2.335.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1 | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 8.774 | (61.812) |
| CCIRS | USD 1.250.000 | Fund receives Fixed 0,537% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 20/10/2030 | (196.162) | (196.162) |
| CCIRS | EUR 7.806.000 | Fund receives Fixed 0,825% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | (848.380) | (857.545) |
| CCIRS | SEK 150.574.000 | Fund receives Fixed 1,213% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (953.120) | (958.073) |
| CCIRS | USD 317.000 | Fund receives Fixed 1,548% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (16.370) | (16.505) |
| CCIRS | GBP 14.202.000 | Fund receives Fixed 1,570% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (614.772) | (614.851) |
| CCIRS | EUR 2.829.000 | Fund receives Fixed 1,770% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | (46.755) | (46.414) |
| CCIRS | HKD 3.853.948 | Fund receives Fixed 2,056% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (19.869) | (19.863) |
| CCIRS | HKD 16.756.740 | Fund receives Fixed 2,069% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (85.144) | (85.120) |
| CCIRS | GBP 4.373.000 | Fund receives Fixed 2,100% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (54.612) | (53.829) |
| CCIRS | CAD 11.675.000 | Fund receives Fixed 2,265% and pays Floating CAD 3 Month CDOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | (900.141) | (899.418) |
| CCIRS | SEK 6.067.000 | Fund receives Fixed 2,380% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (4.418) | (4.830) |
| CCIRS | SEK 66.300.000 | Fund receives Fixed 2,430% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (32.403) | (36.970) |
| CCIRS | CAD 1.019.000 | Fund receives Fixed 2,452% and pays Floating CAD 3 Month CDOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | (65.586) | (65.572) |
| CCIRS | SEK 9.586.000 | Fund receives Fixed 2,480% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (5.385) | (3.059) |
| CCIRS | USD 517.000 | Fund receives Fixed 2,712% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 1.101 | 1.107 |
| CCIRS | CAD 144.000 | Fund receives Fixed 2,984% and pays Floating CAD 3 Month CDOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | (4.089) | (4.087) |
| CCIRS | HKD 5.246.000 | Fund receives Fixed 3,076% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 4.723 | 4.731 |
| CCIRS | HKD 16.003.000 | Fund receives Fixed 3,080% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 14.789 | 14.812 |
| CCIRS | HKD 3.599.000 | Fund receives Fixed 3,150% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 4.822 | 4.828 |
| CCIRS | HKD 3.503.000 | Fund receives Fixed 3,185% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 5.422 | 5.427 |
| CCIRS | HKD 3.580.000 | Fund receives Fixed 3,220% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 6.286 | 6.291 |
| CCIRS | CAD 5.477.000 | Fund receives Fixed 3,380% and pays Floating CAD 3 Month CDOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | (6.697) | (8.665) |
| CCIRS | AUD 403.000 | Fund receives Fixed 3,620% and pays Floating AUD 6 Month BBSW | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | (5.002) | (4.222) |
| CCIRS | ZAR 14.679.000 | Fund receives Fixed 7,475% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (7.697) | (7.686) |
| CCIRS | ZAR 6.815.000 | Fund receives Fixed 7,485% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (3.395) | (3.389) |
| CCIRS | ZAR 80.240.000 | Fund receives Fixed 7,534% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (29.645) | (29.587) |
| CCIRS | ZAR 49.428.000 | Fund receives Fixed 7,630% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (5.806) | (5.771) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Marktwert USD |
|-------------------------------------|----------------|--|-------------------------------|--------------------|---|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | ZAR 10.941.000 | Fund receives Fixed 7,785% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 3.166 | 3.174 |
| CCIRS | MXN 20.251.000 | Fund receives Fixed 8,120% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | (18.579) | (18.568) |
| CCIRS | MXN 10.652.000 | Fund receives Fixed 8,328% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | (5.288) | (5.282) |
| CCIRS | MXN 10.410.000 | Fund receives Fixed 8,412% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | (3.373) | (3.367) |
| CCIRS | MXN 17.003.000 | Fund receives Fixed 8,605% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | 1.133 | 1.142 |
| CCIRS | MXN 15.481.000 | Fund receives Fixed 8,610% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | 1.189 | 1.197 |
| CCIRS | MXN 23.773.000 | Fund receives Fixed 8,640% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | 3.272 | 3.285 |
| CCIRS | MXN 20.924.000 | Fund receives Fixed 8,645% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | 3.092 | 3.104 |
| CCIRS | MXN 11.354.000 | Fund receives Fixed 8,670% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | 2.254 | 2.260 |
| CCIRS | MXN 71.396.000 | Fund receives Fixed 8,725% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | 22.140 | 22.180 |
| CCIRS | MXN 27.462.000 | Fund receives Fixed 8,825% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | 14.088 | 14.103 |
| CCIRS | MXN 9.509.000 | Fund receives Fixed 9,228% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2027 | 12.644 | 12.649 |
| CCIRS | AUD 661.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,470% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 4.137 | 3.806 |
| CCIRS | CAD 22.061.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,070% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 916.246 | 915.179 |
| CCIRS | CAD 69.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,251% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 2.407 | 2.408 |
| CCIRS | CAD 1.599.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,851% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 20.845 | 20.859 |
| CCIRS | CAD 10.160.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 3,250% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (15.636) | (15.080) |
| CCIRS | EUR 14.817.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,540% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 842.587 | 852.750 |
| CCIRS | EUR 5.406.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,520% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 37.778 | 37.760 |
| CCIRS | GBP 7.509.500 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,340% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | 685.739 | 686.204 |
| CCIRS | GBP 2.342.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,900% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | 68.387 | 68.062 |
| CCIRS | PLN 66.955.196 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 4,350% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 1.458.414 | 1.458.577 |
| CCIRS | PLN 27.708.000 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 6,195% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 118.207 | 118.277 |
| CCIRS | PLN 156.000 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 6,320% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 480 | 481 |
| CCIRS | SEK 80.019.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 1,420% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | 851.089 | 855.248 |
| CCIRS | SEK 3.112.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 2,485% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | 3.912 | 3.478 |
| CCIRS | SEK 4.816.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 2,520% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | 5.810 | 3.868 |
| CCIRS | SEK 35.224.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 2,530% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | 36.468 | 25.129 |
| CCIRS | SGD 514.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 1,978% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 9.119 | 9.123 |
| CCIRS | SGD 1.066.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,205% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 10.657 | 10.665 |
| CCIRS | SGD 364.500 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,276% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 2.763 | 2.766 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Marktwert USD |
|-------------------------------------|-------------------|---|----------------------------------|--------------------|---|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | SGD 850.500 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,285% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 6.186 | 6.193 |
| CCIRS | SGD 833.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,330% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 4.783 | 4.790 |
| CCIRS | SGD 297.559 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,359% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 1.415 | 1.417 |
| CCIRS | SGD 323.789 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,374% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 1.374 | 1.377 |
| CCIRS | SGD 198.372 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,376% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 825 | 827 |
| CCIRS | SGD 368.280 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,378% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 1.513 | 1.516 |
| CCIRS | SGD 1.470.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,440% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 2.936 | 2.948 |
| CCIRS | SGD 2.122.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,455% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 3.155 | 3.173 |
| CCIRS | SGD 5.383.260 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,482% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 2.966 | 3.009 |
| CCIRS | SGD 1.262.740 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,485% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 588 | 598 |
| CCIRS | SGD 1.161.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,490% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 343 | 353 |
| CCIRS | SGD 874.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,505% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (188) | (181) |
| CCIRS | SGD 2.060.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,510% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (793) | (777) |
| CCIRS | SGD 743.270 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,547% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (1.222) | (1.216) |
| CCIRS | SGD 532.730 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,549% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (912) | (908) |
| CCIRS | SGD 1.967.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,555% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (3.771) | (3.755) |
| CCIRS | SGD 1.123.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,575% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (2.917) | (2.908) |
| CCIRS | SGD 717.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,580% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (1.985) | (1.979) |
| CCIRS | SGD 1.102.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,732% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (8.752) | (8.743) |
| CCIRS | USD 323.000 | Fund receives Floating USD 12 Month FEDL and pays Fixed 0,554% | Bank of America Merrill Lynch | 20/10/2030 | 24.591 | 50.322 |
| CCIRS | USD 1.357.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 1,612% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2032 | 127.637 | 128.398 |
| IRS | INR 738.557.000 | Fund receives Fixed 6,173% and pays Floating INR 6 Month MIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (397.333) | (397.333) |
| IRS | INR 340.920.000 | Fund receives Fixed 7,229% and pays Floating INR 6 Month MIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 15.646 | 15.646 |
| IRS | CNY 6.574.000 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 2,425% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 1.317 | 1.317 |
| IRS | CNY 3.580.000 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 2,458% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | (69) | (69) |
| IRS | KRW 1.444.066.000 | Fund receives Floating KRW 3 Month KWDCDC and pays Fixed 3,177% | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2027 | 1.950 | 1.950 |
| IRS | CNY 10.924.000 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 2,494% | JP Morgan | 21/9/2027 | (2.907) | (2.907) |
| IRS | THB 65.233.000 | Fund receives Floating THB 6 Month THBXF and pays Fixed 1,840% | Morgan Stanley | 21/9/2027 | 66.746 | 66.746 |
| TRS | BRL 7.875.658 | Fund receives Fixed 0,000% and pays Ibovespa Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 101.786 | 101.786 |
| TRS | BRL 799.392 | Fund receives Fixed 0,000% and pays Ibovespa Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 3.161 | 3.161 |
| TRS | BRL 887.605 | Fund receives Fixed 0,000% and pays Ibovespa Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (1.913) | (1.913) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Marktwert USD |
|---|-------------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| TRS | BRL 993.958 | Fund receives Fixed 0,000% and pays Ibovespa Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (3.129) | (3.129) |
| TRS | BRL 3.183.183 | Fund receives Fixed 0,000% and pays Ibovespa Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (38.074) | (38.074) |
| TRS | BRL 1.982.625 | Fund receives Fixed 0,000% and pays Ibovespa Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (7.383) | (7.383) |
| TRS | BRL 2.315.448 | Fund receives Fixed 0,000% and pays Ibovespa Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (8.107) | (8.107) |
| TRS | KRW 4.008.697.875 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 9/6/2022 | 19.811 | 19.811 |
| TRS | KRW 3.515.593.000 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 9/6/2022 | (20.940) | (20.940) |
| TRS | KRW 265.392.600 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 9/6/2022 | (178) | (178) |
| TRS | KRW 725.438.200 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 9/6/2022 | 13.852 | 13.852 |
| TRS | KRW 272.986.650 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 9/6/2022 | 5.960 | 5.960 |
| TRS | KRW 1.548.128.375 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 9/6/2022 | 34.749 | 34.749 |
| TRS | KRW 894.116.500 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 9/6/2022 | 7.066 | 7.066 |
| TRS | KRW 445.464.750 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 9/6/2022 | 2.245 | 2.245 |
| TRS | KRW 442.814.125 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 9/6/2022 | 102 | 102 |
| TRS | KRW 171.867.150 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 9/6/2022 | (4.209) | (4.209) |
| TRS | KRW 864.827.000 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 9/6/2022 | (16.608) | (16.608) |
| TRS | KRW 1.355.947.600 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 9/6/2022 | (49.024) | (49.024) |
| TRS | KRW 1.495.473.000 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 9/6/2022 | (7.812) | (7.812) |
| TRS | THB 1.369.868 | Fund receives Fixed 0,000% and pays SET50 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 29/6/2022 | (799) | (799) |
| TRS | THB 7.454.846 | Fund receives Fixed 0,000% and pays SET50 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 29/6/2022 | (9.630) | (9.630) |
| TRS | THB 17.264.369 | Fund receives Fixed 0,000% and pays SET50 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 29/6/2022 | (26.278) | (26.278) |
| TRS | THB 4.461.552 | Fund receives Fixed 0,000% and pays SET50 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 29/6/2022 | (3.777) | (3.777) |
| TRS | THB 18.998.478 | Fund receives Fixed 0,000% and pays SET50 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 29/6/2022 | (10.600) | (10.600) |
| TRS | TWD 22.965.880 | Fund receives Fixed 0,000% and pays TAIEX Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 13.351 | 13.351 |
| TRS | TWD 69.945.809 | Fund receives TAIEX Index Futures and pays Fixed 0,000% | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 118.884 | 118.884 |
| TRS | PLN 1.170.442 | Fund receives WIG20 Index Futures and pays Fixed 0,000% | HSBC | 17/6/2022 | (31.112) | (31.112) |
| TRS | PLN 1.139.725 | Fund receives WIG20 Index Futures and pays Fixed 0,000% | HSBC | 17/6/2022 | (32.599) | (32.599) |
| TRS | PLN 2.582.333 | Fund receives WIG20 Index Futures and pays Fixed 0,000% | HSBC | 17/6/2022 | (66.698) | (66.698) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 32.599.518) | | | | | 1.053.281 | 822.914 |

CCDS: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps
 CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps
 IRS: Zinsraten-Swaps
 TRS: Gesamtertrag-Swaps

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| 76 | EUR | Amsterdam Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 11.608.964 | 257.897 |
| 438 | AUD | Australian 10 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 38.427.542 | (1.934.930) |
| 163 | EUR | CAC 40 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 11.274.809 | 129.578 |
| (511) | CAD | Canadian 10 Year Bond Futures September 2022 | September 2022 | 51.324.309 | 387.329 |
| (15) | EUR | DAX Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 5.774.305 | (108.919) |
| (20) | USD | E-Mini S&P 500 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 4.115.000 | 257.595 |
| 178 | EUR | Euro Bund Futures June 2022 | Juni 2022 | 28.886.489 | (255.738) |
| (135) | GBP | FTSE 100 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 12.931.614 | (166.674) |
| 326 | USD | FTSE China A50 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 4.419.256 | 169.115 |
| 85 | EUR | FTSE MIB Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 11.154.390 | 184.871 |
| (141) | ZAR | FTSE/JSE Top 40 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 5.918.591 | (262.701) |
| 32 | EUR | IBEX 35 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 3.032.751 | 110.531 |
| (2) | JPY | Japan 10 Year Bond Futures June 2022 | Juni 2022 | 2.324.389 | 5.359 |
| 77 | USD | MSCI Hong Kong Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 5.153.225 | 98.851 |
| (303) | SGD | MSCI Singapore Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 6.636.827 | (38.134) |
| (403) | SEK | OMX Stockholm 30 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 8.462.128 | (158.996) |
| (17) | CAD | S&P/TSX 60 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 3.378.890 | 91.399 |
| 156 | USD | SGX NIFTY 50 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 5.166.720 | 79.998 |
| (54) | AUD | SPI 200 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 6.989.129 | 113.824 |
| 43 | CHF | Swiss Market Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 5.204.367 | (125.128) |
| 71 | JPY | Topix Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 10.526.075 | (69.560) |
| (112) | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2022 | September 2022 | 16.386.654 | 288.344 |
| 16 | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2022 | September 2022 | 1.910.000 | (14.026) |
| Gesamt | | | | | (960.115) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|------------|---------|-----------|-------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 870.000 | USD | 654.884 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (30.236) |
| AUD | 3.119.000 | USD | 2.246.388 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | (6.991) |
| AUD | 1.126.000 | USD | 842.784 | JP Morgan | 15/6/2022 | (34.331) |
| AUD | 5.291.000 | USD | 3.862.600 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (63.738) |
| AUD | 473.000 | USD | 350.033 | Standard Chartered Bank | 15/6/2022 | (10.426) |
| AUD | 2.451.000 | USD | 1.769.434 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (8.715) |
| AUD | 472.000 | USD | 349.550 | UBS | 20/7/2022 | (10.480) |
| AUD | 358.000 | USD | 246.722 | Morgan Stanley | 17/8/2022 | 10.542 |
| BRL | 17.674.000 | USD | 3.424.126 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 320.044 |
| BRL | 5.493.000 | USD | 1.114.691 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 48.979 |
| BRL | 453.000 | USD | 87.198 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 8.769 |
| BRL | 522.000 | USD | 100.206 | Barclays Bank | 20/7/2022 | 9.301 |
| BRL | 1.363.000 | USD | 266.887 | HSBC | 20/7/2022 | 19.047 |
| BRL | 17.640.000 | USD | 3.634.266 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | 66.306 |
| BRL | 13.685.000 | USD | 2.622.994 | HSBC | 17/8/2022 | 223.913 |
| BRL | 527.000 | USD | 100.332 | UBS | 17/8/2022 | 9.301 |
| CAD | 9.626.000 | USD | 7.577.777 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 34.844 |
| CAD | 310.000 | USD | 245.749 | JP Morgan | 15/6/2022 | (589) |
| CAD | 1.228.000 | USD | 976.766 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (5.615) |
| CAD | 205.000 | USD | 159.990 | UBS | 15/6/2022 | 2.132 |
| CAD | 142.000 | USD | 112.536 | Bank of America Merrill Lynch | 20/7/2022 | (254) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|-------------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| CAD | 7.570.000 | USD | 6.030.575 | JP Morgan Standard Chartered Bank | 20/7/2022 | (44.848) |
| CAD | 586.000 | USD | 457.503 | Chartered Bank | 20/7/2022 | 5.857 |
| CAD | 5.494.000 | USD | 4.259.360 | Deutsche Bank | 17/8/2022 | 84.396 |
| CAD | 586.000 | USD | 457.464 | Chartered Bank | 17/8/2022 | 5.849 |
| CHF | 1.623.000 | EUR | 1.595.187 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (17.265) |
| CHF | 600.000 | USD | 633.759 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (8.024) |
| CLP | 19.842.382 | USD | 24.154 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (208) |
| CLP | 630.591.000 | USD | 755.746 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 5.268 |
| CLP | 209.752.000 | USD | 250.268 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 2.866 |
| CLP | 516.159.618 | USD | 624.937 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | (2.023) |
| CLP | 55.141.000 | USD | 63.687 | Bank of America Merrill Lynch | 20/7/2022 | 2.398 |
| CLP | 50.661.000 | USD | 59.383 | Barclays Bank | 20/7/2022 | 1.334 |
| CLP | 357.529.000 | USD | 430.862 | BNP Paribas | 20/7/2022 | (2.369) |
| CLP | 44.984.000 | USD | 53.616 | Goldman Sachs | 20/7/2022 | 297 |
| CLP | 83.090.000 | USD | 95.092 | HSBC | 20/7/2022 | 4.490 |
| CLP | 148.806.000 | USD | 176.104 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | 2.238 |
| CLP | 50.948.000 | USD | 59.401 | Barclays Bank | 17/8/2022 | 1.326 |
| CLP | 45.220.000 | USD | 53.610 | Morgan Stanley | 17/8/2022 | 290 |
| CNH | 4.152.000 | USD | 638.868 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (17.062) |
| CNH | 2.321.000 | USD | 362.836 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (15.241) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|---------------|---------|------------|------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| CNH | 3.177.000 | USD | 497.188 | BNP Paribas | 15/6/2022 | (21.398) |
| CNH | 2.256.000 | USD | 351.150 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (13.289) |
| | | | | Standard | | |
| CNH | 8.265.000 | USD | 1.291.670 | Chartered Bank | 15/6/2022 | (53.899) |
| CNH | 3.428.000 | USD | 523.652 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (10.787) |
| EUR | 605.544 | CHF | 615.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 7.703 |
| EUR | 329.312 | CHF | 338.000 | Societe Generale | 15/6/2022 | 491 |
| EUR | 35.000 | USD | 36.491 | Citibank | 15/6/2022 | 1.026 |
| EUR | 106.000 | USD | 115.243 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (1.622) |
| EUR | 1.154.000 | USD | 1.257.491 | HSBC | 15/6/2022 | (20.522) |
| EUR | 2.617.000 | USD | 2.920.543 | JP Morgan | 15/6/2022 | (115.388) |
| EUR | 175.000 | USD | 191.164 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (3.582) |
| | | | | Standard | | |
| EUR | 985.000 | USD | 1.040.428 | Chartered Bank | 15/6/2022 | 15.390 |
| EUR | 178.000 | USD | 193.997 | UBS | 15/6/2022 | (3.199) |
| EUR | 106.000 | USD | 115.471 | Deutsche Bank | 20/7/2022 | (1.632) |
| EUR | 210.000 | USD | 222.257 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | 3.272 |
| | | | | Standard | | |
| EUR | 808.000 | USD | 854.870 | Chartered Bank | 20/7/2022 | 12.883 |
| EUR | 592.000 | USD | 628.296 | JP Morgan | 17/8/2022 | 8.523 |
| | | | | Standard | | |
| EUR | 34.000 | USD | 35.583 | Chartered Bank | 17/8/2022 | 991 |
| | | | | Bank of America | | |
| GBP | 2.337.000 | USD | 3.021.348 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | (79.295) |
| GBP | 257.000 | USD | 322.911 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 627 |
| GBP | 226.000 | USD | 296.038 | HSBC | 15/6/2022 | (11.526) |
| GBP | 436.000 | USD | 572.196 | JP Morgan | 15/6/2022 | (23.316) |
| GBP | 1.083.000 | USD | 1.421.827 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (58.438) |
| GBP | 1.323.000 | USD | 1.740.679 | UBS | 15/6/2022 | (75.152) |
| | | | | Bank of America | | |
| GBP | 360.000 | USD | 455.124 | Merrill Lynch | 20/7/2022 | (1.797) |
| GBP | 84.000 | USD | 109.470 | Deutsche Bank | 20/7/2022 | (3.694) |
| GBP | 2.090.000 | USD | 2.745.620 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (113.801) |
| | | | | Standard | | |
| GBP | 173.000 | USD | 213.561 | Chartered Bank | 20/7/2022 | 4.289 |
| GBP | 2.125.000 | USD | 2.626.224 | HSBC | 17/8/2022 | 50.324 |
| HUF | 797.029.000 | USD | 2.277.399 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | (121.313) |
| HUF | 89.787.000 | USD | 260.720 | HSBC | 15/6/2022 | (17.833) |
| HUF | 74.247.000 | USD | 215.198 | JP Morgan | 15/6/2022 | (14.348) |
| HUF | 46.202.000 | USD | 131.675 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (6.691) |
| HUF | 51.820.000 | USD | 154.507 | UBS | 15/6/2022 | (14.326) |
| | | | | Bank of America | | |
| HUF | 314.054.000 | USD | 900.022 | Merrill Lynch | 20/7/2022 | (54.551) |
| HUF | 211.017.000 | USD | 591.068 | Goldman Sachs | 20/7/2022 | (22.984) |
| HUF | 19.968.000 | USD | 54.415 | HSBC | 20/7/2022 | (658) |
| HUF | 374.960.000 | USD | 1.022.194 | HSBC | 17/8/2022 | (16.653) |
| | | | | Bank of America | | |
| INR | 4.339.000 | USD | 55.916 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | (134) |
| INR | 6.062.000 | USD | 78.036 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (104) |
| INR | 1.036.609.000 | USD | 13.275.898 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 50.615 |
| INR | 22.954.000 | USD | 300.090 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (4.996) |
| INR | 20.566.000 | USD | 268.298 | JP Morgan | 15/6/2022 | (3.904) |
| | | | | Standard | | |
| INR | 9.785.000 | USD | 127.196 | Chartered Bank | 15/6/2022 | (1.401) |
| INR | 3.772.000 | USD | 49.088 | UBS | 15/6/2022 | (596) |
| INR | 3.465.000 | USD | 44.503 | Citibank | 20/7/2022 | (119) |
| INR | 878.568.570 | USD | 11.419.447 | HSBC | 20/7/2022 | (165.492) |
| INR | 4.803.000 | USD | 62.283 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (759) |
| | | | | Standard | | |
| INR | 10.435.000 | USD | 133.907 | Chartered Bank | 20/7/2022 | (241) |
| INR | 6.101.000 | USD | 78.036 | Deutsche Bank | 17/8/2022 | (111) |
| INR | 848.528.740 | USD | 10.900.794 | Goldman Sachs | 17/8/2022 | (62.861) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|---------------|---------|------------|------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| INR | 4.366.000 | USD | 55.902 | Standard | | |
| INR | 3.478.000 | USD | 44.532 | Chartered Bank | 17/8/2022 | (137) |
| | | | | UBS | 17/8/2022 | (108) |
| | | | | Bank of America | | |
| JPY | 135.464.000 | USD | 1.106.687 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | (54.189) |
| JPY | 100.000.000 | USD | 783.816 | HSBC | 15/6/2022 | (6.859) |
| JPY | 311.708.000 | USD | 2.551.697 | JP Morgan | 15/6/2022 | (129.858) |
| JPY | 843.420.000 | USD | 7.299.695 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (746.683) |
| | | | | Bank of America | | |
| JPY | 21.257.000 | USD | 165.791 | Merrill Lynch | 20/7/2022 | (377) |
| JPY | 20.337.000 | USD | 161.159 | HSBC | 20/7/2022 | (2.904) |
| JPY | 25.884.000 | USD | 206.283 | JP Morgan | 20/7/2022 | (4.864) |
| JPY | 935.997.000 | USD | 7.489.968 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (206.412) |
| | | | | Bank of America | | |
| JPY | 530.399.000 | USD | 4.082.495 | Merrill Lynch | 17/8/2022 | 51.093 |
| JPY | 20.305.000 | USD | 161.163 | HSBC | 17/8/2022 | (2.919) |
| | | | | Bank of America | | |
| KRW | 490.346.363 | USD | 396.350 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | (1.659) |
| KRW | 691.868.637 | USD | 557.604 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (705) |
| KRW | 1.021.066.000 | USD | 828.001 | BNP Paribas | 15/6/2022 | (6.123) |
| KRW | 690.750.000 | USD | 559.475 | HSBC | 15/6/2022 | (3.476) |
| KRW | 471.176.000 | USD | 373.558 | JP Morgan | 15/6/2022 | 5.702 |
| KRW | 620.478.000 | USD | 503.584 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (4.149) |
| | | | | Standard | | |
| KRW | 790.787.000 | USD | 624.338 | Chartered Bank | 15/6/2022 | 12.183 |
| KRW | 66.837.000 | USD | 53.830 | UBS | 15/6/2022 | (32) |
| KRW | 470.979.000 | USD | 373.425 | Barclays Bank | 20/7/2022 | 5.807 |
| KRW | 1.259.927.000 | USD | 1.001.938 | BNP Paribas | 20/7/2022 | 12.556 |
| KRW | 466.391.000 | USD | 366.508 | HSBC | 20/7/2022 | 9.030 |
| KRW | 66.782.000 | USD | 53.813 | UBS | 20/7/2022 | (40) |
| | | | | Bank of America | | |
| KRW | 790.203.000 | USD | 624.000 | Merrill Lynch | 17/8/2022 | 12.374 |
| KRW | 813.424.000 | USD | 642.035 | HSBC | 17/8/2022 | 13.041 |
| MXN | 353.066.000 | USD | 16.457.038 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 1.504.482 |
| MXN | 9.737.000 | USD | 489.687 | HSBC | 15/6/2022 | 5.663 |
| MXN | 2.761.000 | USD | 129.499 | JP Morgan | 15/6/2022 | 10.962 |
| MXN | 5.428.000 | USD | 251.103 | UBS | 15/6/2022 | 25.036 |
| MXN | 2.000.000 | USD | 98.661 | Citibank | 20/7/2022 | 2.397 |
| MXN | 4.270.000 | USD | 215.579 | Goldman Sachs | 20/7/2022 | 179 |
| MXN | 6.754.000 | USD | 337.343 | HSBC | 20/7/2022 | 3.930 |
| MXN | 3.222.000 | USD | 157.129 | JP Morgan | 20/7/2022 | 5.675 |
| MXN | 2.332.000 | USD | 111.546 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | 6.288 |
| MXN | 4.270.000 | USD | 214.404 | Goldman Sachs | 17/8/2022 | 174 |
| MXN | 6.758.000 | USD | 335.742 | HSBC | 17/8/2022 | 3.864 |
| NOK | 792.000 | USD | 81.452 | Citibank | 15/6/2022 | 2.620 |
| NOK | 8.238.000 | USD | 919.893 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | (45.416) |
| NOK | 24.774.000 | USD | 2.767.305 | JP Morgan | 15/6/2022 | (137.504) |
| NOK | 4.016.000 | USD | 437.962 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (11.656) |
| NOK | 5.136.000 | USD | 590.398 | Societe Generale | 15/6/2022 | (45.203) |
| NOK | 791.000 | USD | 81.382 | Citibank | 20/7/2022 | 2.615 |
| NOK | 22.719.000 | USD | 2.585.001 | JP Morgan | 20/7/2022 | (172.462) |
| NOK | 2.416.000 | USD | 257.037 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (481) |
| | | | | Bank of America | | |
| NOK | 18.672.000 | USD | 1.973.892 | Merrill Lynch | 17/8/2022 | 9.816 |
| NOK | 791.000 | USD | 81.403 | JP Morgan | 17/8/2022 | 2.633 |
| | | | | Bank of America | | |
| NZD | 89.000 | USD | 61.108 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | (3.205) |
| NZD | 779.000 | USD | 541.818 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (35.005) |
| NZD | 233.000 | USD | 150.194 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 1.395 |
| NZD | 953.000 | USD | 610.529 | JP Morgan | 15/6/2022 | 9.488 |
| NZD | 4.356.000 | USD | 2.936.021 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (102.034) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) |
|--------------------------------------|-------------|---------|-----------|----------------------------------|------------|---|
| | | | | | | USD |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| NZD | 233.000 | USD | 150.139 | Deutsche Bank | 20/7/2022 | 1.374 |
| NZD | 720.000 | USD | 450.190 | JP Morgan | 20/7/2022 | 18.004 |
| NZD | 2.060.000 | USD | 1.356.792 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (17.237) |
| NZD | 720.000 | USD | 450.046 | JP Morgan | 17/8/2022 | 17.918 |
| NZD | 910.000 | USD | 585.990 | Morgan Stanley | 17/8/2022 | 5.466 |
| PLN | 2.840.000 | USD | 650.619 | JP Morgan | 15/6/2022 | 13.785 |
| PLN | 1.907.000 | USD | 432.873 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 13.261 |
| PLN | 866.000 | USD | 193.048 | UBS | 15/6/2022 | 9.548 |
| PLN | 682.000 | USD | 157.908 | Citibank | 20/7/2022 | 867 |
| PLN | 684.000 | USD | 151.250 | JP Morgan | 20/7/2022 | 7.990 |
| PLN | 3.690.000 | USD | 847.693 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | 11.368 |
| PLN | 687.000 | USD | 151.320 | Goldman Sachs | 17/8/2022 | 7.984 |
| SEK | 5.654.000 | USD | 593.885 | Citibank | 15/6/2022 | (17.983) |
| SEK | 1.250.000 | USD | 133.179 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (5.857) |
| SEK | 1.092.000 | USD | 109.410 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 1.819 |
| SEK | 3.451.000 | USD | 350.755 | HSBC | 15/6/2022 | 755 |
| SEK | 15.796.000 | USD | 1.638.446 | JP Morgan | 15/6/2022 | (29.505) |
| SEK | 7.235.000 | USD | 757.145 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (20.205) |
| SEK | 11.443.000 | USD | 1.146.684 | Societe Generale | 15/6/2022 | 18.870 |
| SEK | 5.340.000 | USD | 575.619 | UBS | 15/6/2022 | (31.701) |
| SEK | 4.093.000 | USD | 428.201 | Citibank | 20/7/2022 | (10.821) |
| SEK | 3.446.000 | USD | 350.777 | HSBC | 20/7/2022 | 626 |
| SEK | 10.653.000 | USD | 1.095.420 | JP Morgan | 20/7/2022 | (9.091) |
| SEK | 4.269.000 | USD | 436.354 | JP Morgan | 17/8/2022 | (607) |
| SGD | 753.000 | USD | 551.473 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (2.256) |
| SGD | 8.963.000 | USD | 6.572.512 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (35.148) |
| SGD | 669.000 | USD | 487.759 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 191 |
| SGD | 216.000 | USD | 156.348 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 1.197 |
| SGD | 242.000 | USD | 174.940 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 1.568 |
| SGD | 1.864.000 | USD | 1.343.506 | Societe Generale | 15/6/2022 | 16.044 |
| SGD | 375.000 | USD | 274.007 | Bank of America Merrill Lynch | 20/7/2022 | (505) |
| SGD | 2.919.000 | USD | 2.118.377 | BNP Paribas | 20/7/2022 | 10.561 |
| SGD | 458.000 | USD | 331.324 | Goldman Sachs | 20/7/2022 | 2.713 |
| SGD | 378.000 | USD | 277.513 | HSBC | 20/7/2022 | (1.823) |
| SGD | 9.000 | USD | 6.646 | Societe Generale | 20/7/2022 | (82) |
| SGD | 375.000 | USD | 274.046 | Bank of America Merrill Lynch | 17/8/2022 | (521) |
| SGD | 2.919.000 | USD | 2.118.727 | BNP Paribas | 17/8/2022 | 10.390 |
| THB | 108.931.000 | USD | 3.230.277 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (46.056) |
| THB | 42.395.000 | USD | 1.277.979 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | (38.708) |
| THB | 2.362.000 | USD | 70.242 | HSBC | 15/6/2022 | (1.197) |
| THB | 42.758.000 | USD | 1.239.641 | Standard Chartered Bank | 15/6/2022 | 10.242 |
| THB | 11.121.000 | USD | 331.948 | UBS | 15/6/2022 | (6.864) |
| THB | 52.036.000 | USD | 1.523.458 | Barclays Bank | 20/7/2022 | (716) |
| THB | 6.110.000 | USD | 177.849 | HSBC | 20/7/2022 | 949 |
| THB | 7.494.000 | USD | 220.023 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (724) |
| THB | 82.535.000 | USD | 2.450.740 | Societe Generale | 20/7/2022 | (35.500) |
| THB | 36.612.000 | USD | 1.061.525 | Standard Chartered Bank | 20/7/2022 | 9.859 |
| THB | 131.422.000 | USD | 3.830.741 | Bank of America Merrill Lynch | 17/8/2022 | 19.379 |
| THB | 2.094.000 | USD | 61.585 | Barclays Bank | 17/8/2022 | (239) |
| THB | 13.595.000 | USD | 397.901 | Societe Generale | 17/8/2022 | 375 |
| THB | 28.600.000 | USD | 825.695 | Standard Chartered Bank | 17/8/2022 | 12.167 |
| TWD | 8.743.000 | USD | 294.933 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 6.660 |
| TWD | 28.838.000 | USD | 1.002.706 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (7.928) |
| TWD | 12.709.000 | USD | 426.505 | JP Morgan | 15/6/2022 | 11.897 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) |
|--------------------------------------|------------|---------|---------------|----------------------------------|------------|---|
| | | | | | | USD |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| TWD | 8.615.000 | USD | 291.582 | Standard Chartered Bank | 15/6/2022 | 5.596 |
| TWD | 8.588.000 | USD | 291.524 | Goldman Sachs | 20/7/2022 | 5.676 |
| TWD | 18.676.000 | USD | 632.316 | HSBC | 20/7/2022 | 13.993 |
| TWD | 12.674.000 | USD | 426.381 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | 12.221 |
| TWD | 12.642.000 | USD | 426.311 | Deutsche Bank | 17/8/2022 | 12.230 |
| TWD | 17.267.000 | USD | 586.277 | HSBC | 17/8/2022 | 12.702 |
| USD | 9.337.799 | AUD | 12.604.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 288.308 |
| USD | 935.409 | AUD | 1.251.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 37.209 |
| USD | 403.736 | AUD | 550.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 8.844 |
| USD | 1.624.627 | AUD | 2.248.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 10.595 |
| USD | 417.560 | AUD | 565.000 | UBS | 15/6/2022 | 11.899 |
| USD | 6.003.971 | AUD | 8.047.000 | Citibank | 20/7/2022 | 223.269 |
| USD | 543.240 | AUD | 761.000 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (3.437) |
| USD | 139.556 | AUD | 195.000 | Standard Chartered Bank | 20/7/2022 | (526) |
| USD | 4.678.344 | AUD | 6.587.000 | Goldman Sachs | 17/8/2022 | (55.160) |
| USD | 359.326 | BRL | 1.841.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (30.683) |
| USD | 302.230 | BRL | 1.446.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (4.100) |
| USD | 1.399.182 | BRL | 7.027.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | (89.463) |
| USD | 300.696 | BRL | 1.571.000 | Citibank | 15/6/2022 | (32.115) |
| USD | 262.338 | BRL | 1.318.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | (16.875) |
| USD | 111.259 | BRL | 579.000 | HSBC | 15/6/2022 | (11.400) |
| USD | 163.158 | BRL | 779.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (1.870) |
| USD | 782.230 | BRL | 3.894.000 | Barclays Bank | 20/7/2022 | (34.665) |
| USD | 885.838 | BRL | 4.531.000 | BNP Paribas | 20/7/2022 | (64.688) |
| USD | 207.125 | BRL | 1.000.000 | Goldman Sachs | 20/7/2022 | (2.658) |
| USD | 155.809 | BRL | 787.000 | HSBC | 20/7/2022 | (9.290) |
| USD | 657.884 | BRL | 3.316.000 | Barclays Bank | 17/8/2022 | (31.947) |
| USD | 207.255 | BRL | 1.009.000 | HSBC | 17/8/2022 | (2.649) |
| USD | 124.725 | BRL | 612.000 | UBS | 17/8/2022 | (2.590) |
| USD | 512.286 | CAD | 641.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 5.358 |
| USD | 1.598.462 | CAD | 2.049.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | (21.968) |
| USD | 861.875 | CAD | 1.101.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | (8.839) |
| USD | 2.824.496 | CAD | 3.628.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (44.670) |
| USD | 97.349 | CAD | 125.000 | Standard Chartered Bank | 15/6/2022 | (1.506) |
| USD | 512.235 | CAD | 641.000 | Barclays Bank | 20/7/2022 | 5.385 |
| USD | 910.496 | CAD | 1.165.000 | BNP Paribas | 20/7/2022 | (10.689) |
| USD | 342.204 | CAD | 440.000 | HSBC | 20/7/2022 | (5.712) |
| USD | 1.666.452 | CAD | 2.149.000 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (32.798) |
| USD | 910.419 | CAD | 1.165.000 | BNP Paribas | 17/8/2022 | (10.672) |
| USD | 705.331 | CAD | 918.000 | Morgan Stanley | 17/8/2022 | (20.474) |
| USD | 1.699.630 | CHF | 1.566.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 66.463 |
| USD | 281.507 | CLP | 230.273.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 3.608 |
| USD | 549.991 | CLP | 445.417.532 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 12.449 |
| USD | 453.923 | CLP | 395.821.000 | Credit Suisse | 15/6/2022 | (23.763) |
| USD | 220.928 | CLP | 186.092.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | (3.652) |
| USD | 3.857.804 | CLP | 3.167.836.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 34.782 |
| USD | 118.987 | CLP | 94.138.468 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 5.378 |
| USD | 4.125.292 | CLP | 3.403.180.000 | Barclays Bank | 20/7/2022 | 46.639 |
| USD | 453.914 | CLP | 398.605.000 | Credit Suisse | 20/7/2022 | (23.807) |
| USD | 96.465 | CLP | 84.216.000 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (4.466) |
| USD | 124.437 | CLP | 103.627.000 | Barclays Bank | 17/8/2022 | 918 |
| USD | 454.293 | CLP | 400.982.000 | Credit Suisse | 17/8/2022 | (23.656) |
| USD | 3.158.642 | CLP | 2.755.594.000 | Goldman Sachs | 17/8/2022 | (125.883) |
| USD | 477.108 | CNH | 3.036.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | 22.434 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|-----------|---------|-------------|------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 232.324 | CNH | 1.481.505 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 10.453 |
| USD | 2.738.156 | CNH | 18.483.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | (29.872) |
| USD | 2.213.059 | CNH | 14.305.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 70.731 |
| USD | 2.687.838 | CNH | 17.539.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 61.185 |
| | | | | Standard | | |
| USD | 747.334 | CNH | 4.765.495 | Chartered Bank | 15/6/2022 | 33.650 |
| USD | 2.737.921 | CNH | 18.507.000 | BNP Paribas | 20/7/2022 | (30.922) |
| USD | 581.633 | CNH | 3.923.000 | Deutsche Bank | 20/7/2022 | (5.289) |
| USD | 2.815.911 | CNH | 18.311.000 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | 76.393 |
| | | | | Standard | | |
| USD | 300.081 | CNH | 2.018.000 | Chartered Bank | 20/7/2022 | (1.833) |
| USD | 1.789.211 | CNH | 12.162.000 | BNP Paribas | 17/8/2022 | (29.312) |
| USD | 581.855 | CNH | 3.927.000 | Deutsche Bank | 17/8/2022 | (5.329) |
| USD | 3.457.476 | CNH | 23.306.000 | Morgan Stanley | 17/8/2022 | (27.353) |
| | | | | Bank of America | | |
| USD | 1.820.499 | EUR | 1.635.000 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | 67.948 |
| USD | 503.859 | EUR | 453.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 18.290 |
| USD | 3.103.908 | EUR | 2.820.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 81.158 |
| USD | 1.136.781 | EUR | 1.059.000 | HSBC | 15/6/2022 | 1.642 |
| USD | 1.214.152 | EUR | 1.091.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 44.712 |
| USD | 1.940.071 | EUR | 1.830.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (21.500) |
| USD | 449.602 | EUR | 411.000 | UBS | 15/6/2022 | 9.052 |
| USD | 3.442.819 | EUR | 3.146.786 | Deutsche Bank | 20/7/2022 | 63.326 |
| USD | 414.720 | EUR | 392.000 | HSBC | 20/7/2022 | (6.268) |
| USD | 1.196.754 | EUR | 1.126.000 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (12.515) |
| | | | | Standard | | |
| USD | 970.050 | EUR | 909.000 | Chartered Bank | 20/7/2022 | (6.171) |
| USD | 348.288 | EUR | 323.000 | Deutsche Bank | 17/8/2022 | 834 |
| USD | 208.250 | EUR | 193.000 | Morgan Stanley | 17/8/2022 | 639 |
| | | | | Standard | | |
| USD | 4.730.606 | EUR | 4.453.000 | Chartered Bank | 17/8/2022 | (59.517) |
| | | | | Bank of America | | |
| USD | 2.829.936 | GBP | 2.135.000 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | 142.181 |
| USD | 220.273 | GBP | 168.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 8.778 |
| USD | 184.107 | GBP | 141.000 | HSBC | 15/6/2022 | 6.602 |
| USD | 354.428 | GBP | 283.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | (1.841) |
| USD | 1.939.435 | GBP | 1.543.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (3.050) |
| | | | | Standard | | |
| USD | 173.814 | GBP | 132.000 | Chartered Bank | 15/6/2022 | 7.639 |
| | | | | Bank of America | | |
| USD | 706.504 | GBP | 541.000 | Merrill Lynch | 20/7/2022 | 25.253 |
| USD | 179.018 | GBP | 143.000 | JP Morgan | 20/7/2022 | (1.054) |
| USD | 676.206 | GBP | 546.000 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (11.341) |
| USD | 174.249 | GBP | 134.000 | Societe Generale | 20/7/2022 | 5.511 |
| USD | 179.085 | GBP | 143.000 | JP Morgan | 17/8/2022 | (1.031) |
| USD | 676.444 | GBP | 546.000 | Morgan Stanley | 17/8/2022 | (11.271) |
| USD | 510.835 | HKD | 3.991.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 2.080 |
| | | | | Bank of America | | |
| USD | 998.959 | HUF | 369.412.000 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | (357) |
| USD | 276.767 | HUF | 95.244.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 19.117 |
| USD | 444.345 | HUF | 155.010.000 | HSBC | 15/6/2022 | 25.019 |
| USD | 576.937 | HUF | 210.961.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 6.255 |
| USD | 265.852 | HUF | 94.745.000 | UBS | 15/6/2022 | 9.552 |
| USD | 446.950 | HUF | 156.934.000 | Goldman Sachs | 20/7/2022 | 24.465 |
| USD | 163.382 | HUF | 58.858.000 | HSBC | 20/7/2022 | 4.929 |
| USD | 389.897 | HUF | 144.608.000 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | 594 |
| USD | 140.814 | HUF | 51.212.000 | UBS | 20/7/2022 | 2.945 |
| USD | 170.181 | HUF | 61.458.000 | BNP Paribas | 17/8/2022 | 5.367 |
| USD | 93.170 | HUF | 34.447.000 | HSBC | 17/8/2022 | 793 |
| USD | 390.132 | HUF | 145.253.000 | Morgan Stanley | 17/8/2022 | 603 |
| | | | | Bank of America | | |
| USD | 50.457 | INR | 3.906.000 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | 242 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|------------|---------|----------------|-----------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 484.581 | INR | 37.819.000 | Citibank | 15/6/2022 | (1.616) |
| USD | 1.303.582 | INR | 100.055.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 17.288 |
| USD | 1.081.944 | INR | 83.375.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 10.084 |
| | | | | Standard | | |
| USD | 266.445 | INR | 20.535.000 | Chartered Bank | 15/6/2022 | 2.450 |
| USD | 55.995 | INR | 4.308.000 | Deutsche Bank | 20/7/2022 | 812 |
| USD | 223.251 | INR | 17.228.000 | HSBC | 20/7/2022 | 2.570 |
| USD | 210.375 | INR | 16.299.000 | JP Morgan | 20/7/2022 | 1.594 |
| | | | | Bank of America | | |
| USD | 1.186.578 | JPY | 153.415.000 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | (5.392) |
| USD | 43.818 | JPY | 5.556.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 650 |
| USD | 103.135 | JPY | 13.218.000 | Citibank | 15/6/2022 | 436 |
| USD | 200.881 | JPY | 23.790.000 | HSBC | 15/6/2022 | 16.043 |
| USD | 1.504.949 | JPY | 191.907.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 13.913 |
| USD | 4.358.559 | JPY | 543.201.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 138.117 |
| | | | | Bank of America | | |
| USD | 1.186.381 | JPY | 153.124.000 | Merrill Lynch | 20/7/2022 | (5.169) |
| USD | 43.803 | JPY | 5.545.000 | BNP Paribas | 20/7/2022 | 654 |
| USD | 103.120 | JPY | 13.193.000 | Citibank | 20/7/2022 | 457 |
| USD | 1.504.737 | JPY | 191.558.000 | JP Morgan | 20/7/2022 | 14.108 |
| USD | 1.742.721 | JPY | 225.627.000 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (13.019) |
| | | | | Standard | | |
| USD | 406.903 | JPY | 52.900.000 | Chartered Bank | 20/7/2022 | (4.744) |
| USD | 43.801 | JPY | 5.536.000 | BNP Paribas | 17/8/2022 | 657 |
| USD | 103.101 | JPY | 13.169.000 | Citibank | 17/8/2022 | 470 |
| USD | 1.317.122 | JPY | 166.985.000 | JP Morgan | 17/8/2022 | 15.748 |
| USD | 656.476 | KRW | 821.236.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (4.554) |
| USD | 87.867 | KRW | 107.343.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 1.464 |
| USD | 171.884 | KRW | 213.249.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 236 |
| | | | | Standard | | |
| USD | 10.981.059 | KRW | 13.539.316.000 | Chartered Bank | 15/6/2022 | 82.979 |
| USD | 288.215 | KRW | 362.935.000 | BNP Paribas | 20/7/2022 | (4.020) |
| USD | 9.222.459 | KRW | 11.307.841.000 | Deutsche Bank | 20/7/2022 | 117.380 |
| USD | 340.528 | KRW | 428.139.000 | HSBC | 20/7/2022 | (4.210) |
| USD | 9.061.536 | KRW | 11.484.500.000 | HSBC | 17/8/2022 | (187.285) |
| | | | | Bank of America | | |
| USD | 2.249.521 | MXN | 46.296.889 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | (105.742) |
| USD | 845.596 | MXN | 17.657.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | (52.668) |
| USD | 352.381 | MXN | 7.264.111 | JP Morgan | 15/6/2022 | (17.166) |
| USD | 2.156.057 | MXN | 44.540.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (109.825) |
| | | | | Bank of America | | |
| USD | 234.221 | MXN | 4.811.000 | Merrill Lynch | 20/7/2022 | (8.874) |
| USD | 3.709.563 | MXN | 74.674.000 | Citibank | 20/7/2022 | (63.638) |
| | | | | Bank of America | | |
| USD | 234.372 | MXN | 4.840.000 | Merrill Lynch | 17/8/2022 | (8.850) |
| USD | 3.306.158 | MXN | 67.716.000 | HSBC | 17/8/2022 | (96.734) |
| USD | 734.737 | NOK | 6.741.000 | Citibank | 15/6/2022 | 19.169 |
| USD | 841.454 | NOK | 7.462.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 49.351 |
| USD | 1.243.521 | NOK | 11.572.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | 15.134 |
| USD | 686.242 | NOK | 6.035.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 45.617 |
| USD | 250.999 | NOK | 2.411.000 | Citibank | 20/7/2022 | (5.026) |
| USD | 1.327.349 | NOK | 12.393.000 | JP Morgan | 20/7/2022 | 11.332 |
| USD | 251.033 | NOK | 2.410.000 | HSBC | 17/8/2022 | (5.005) |
| USD | 676.280 | NOK | 6.423.000 | JP Morgan | 17/8/2022 | (6.097) |
| | | | | Bank of America | | |
| USD | 2.968.951 | NZD | 4.327.000 | Merrill Lynch | 15/6/2022 | 153.828 |
| USD | 544.430 | NZD | 799.000 | HSBC | 15/6/2022 | 24.605 |
| USD | 88.207 | NZD | 137.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | (924) |
| USD | 223.537 | NZD | 348.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (2.869) |
| | | | | Bank of America | | |
| USD | 276.352 | NZD | 416.000 | Merrill Lynch | 20/7/2022 | 5.840 |
| USD | 958.605 | NZD | 1.408.000 | Deutsche Bank | 20/7/2022 | 43.026 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|-----------|---------|-------------|-------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 223.568 | NZD | 348.000 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (2.726) |
| USD | 547.883 | NZD | 854.000 | Morgan Stanley | 17/8/2022 | (7.175) |
| USD | 811.850 | PLN | 3.618.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | (34.562) |
| USD | 1.334.874 | PLN | 5.838.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | (30.897) |
| USD | 658.071 | PLN | 2.923.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (25.750) |
| USD | 1.766.165 | PLN | 7.593.000 | HSBC | 20/7/2022 | (1.546) |
| USD | 662.088 | PLN | 2.926.000 | JP Morgan | 20/7/2022 | (19.108) |
| USD | 368.018 | PLN | 1.653.000 | UBS | 20/7/2022 | (16.814) |
| USD | 1.454.171 | PLN | 6.577.000 | HSBC | 17/8/2022 | (70.927) |
| USD | 201.012 | PLN | 869.000 | JP Morgan | 17/8/2022 | (495) |
| USD | 409.348 | SEK | 3.874.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 14.753 |
| USD | 502.730 | SEK | 4.988.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | (5.335) |
| USD | 4.538.566 | SEK | 45.132.000 | JP Morgan | 15/6/2022 | (58.465) |
| USD | 1.124.600 | SEK | 10.870.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 17.409 |
| USD | 541.003 | SEK | 5.444.000 | Societe Generale | 15/6/2022 | (13.509) |
| USD | 409.355 | SEK | 3.869.000 | Deutsche Bank | 20/7/2022 | 14.818 |
| USD | 502.537 | SEK | 4.980.000 | Goldman Sachs | 20/7/2022 | (5.293) |
| USD | 143.971 | SEK | 1.424.000 | JP Morgan | 20/7/2022 | (1.240) |
| USD | 156.804 | SEK | 1.536.000 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | 172 |
| USD | 2.734.508 | SEK | 25.733.000 | Standard Chartered Bank | 20/7/2022 | 110.412 |
| USD | 100.936 | SEK | 1.000.000 | Deutsche Bank | 17/8/2022 | (1.137) |
| USD | 186.070 | SEK | 1.874.000 | Goldman Sachs | 17/8/2022 | (5.214) |
| USD | 2.201.158 | SEK | 21.756.000 | HSBC | 17/8/2022 | (19.533) |
| USD | 1.540.096 | SGD | 2.089.993 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 15.713 |
| USD | 2.136.077 | SGD | 2.929.575 | BNP Paribas | 15/6/2022 | (674) |
| USD | 614.849 | SGD | 837.000 | HSBC | 15/6/2022 | 4.364 |
| USD | 90.171 | SGD | 122.432 | JP Morgan | 15/6/2022 | 873 |
| USD | 2.362.951 | SGD | 3.229.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 7.809 |
| USD | 2.995.010 | SGD | 4.065.000 | Standard Chartered Bank | 15/6/2022 | 30.111 |
| USD | 1.877.441 | SGD | 2.578.000 | BNP Paribas | 20/7/2022 | (2.793) |
| USD | 168.956 | SGD | 234.000 | JP Morgan | 20/7/2022 | (1.709) |
| USD | 1.115.948 | SGD | 1.524.000 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | 4.437 |
| USD | 2.375.802 | SGD | 3.288.000 | HSBC | 17/8/2022 | (22.465) |
| USD | 173.533 | SGD | 242.000 | Morgan Stanley | 17/8/2022 | (2.981) |
| USD | 317.917 | THB | 10.538.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | 9.875 |
| USD | 234.964 | THB | 7.868.000 | Goldman Sachs | 15/6/2022 | 4.970 |
| USD | 71.900 | THB | 2.471.000 | Societe Generale | 15/6/2022 | (331) |
| USD | 156.670 | THB | 5.209.000 | Standard Chartered Bank | 15/6/2022 | 4.403 |
| USD | 230.733 | THB | 7.928.000 | UBS | 15/6/2022 | (1.014) |
| USD | 302.504 | THB | 10.391.000 | UBS | 20/7/2022 | (1.570) |
| USD | 444.620 | TWD | 13.107.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2022 | (7.512) |
| USD | 1.857.963 | TWD | 53.695.000 | BNP Paribas | 15/6/2022 | 5.730 |
| USD | 2.375.553 | TWD | 68.408.000 | Deutsche Bank | 15/6/2022 | 15.789 |
| USD | 702.866 | TWD | 20.114.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 9.025 |
| USD | 1.359.070 | TWD | 38.223.000 | Standard Chartered Bank | 15/6/2022 | 40.550 |
| USD | 235.502 | TWD | 6.632.000 | UBS | 15/6/2022 | 6.729 |
| USD | 813.749 | TWD | 23.733.000 | Barclays Bank | 20/7/2022 | (7.564) |
| USD | 4.739.852 | TWD | 136.814.000 | HSBC | 20/7/2022 | 5.212 |
| USD | 686.487 | TWD | 19.997.000 | UBS | 20/7/2022 | (5.537) |
| USD | 195.553 | TWD | 5.680.000 | HSBC | 17/8/2022 | (1.481) |
| USD | 5.520.520 | TWD | 162.714.000 | Standard Chartered Bank | 17/8/2022 | (123.898) |
| USD | 181.992 | ZAR | 2.886.000 | Barclays Bank | 15/6/2022 | (2.542) |
| USD | 423.849 | ZAR | 6.735.000 | Citibank | 15/6/2022 | (6.794) |
| USD | 2.109.920 | ZAR | 32.952.000 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | 2.933 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 181.943 | ZAR | 2.896.000 | Barclays Bank | 20/7/2022 | (2.464) |
| USD | 378.808 | ZAR | 6.012.000 | Citibank | 20/7/2022 | (4.015) |
| USD | 970.498 | ZAR | 14.358.000 | UBS | 20/7/2022 | 56.231 |
| USD | 917.980 | ZAR | 14.825.000 | JP Morgan | 17/8/2022 | (23.190) |
| USD | 143.615 | ZAR | 2.268.000 | Morgan Stanley | 17/8/2022 | (370) |
| ZAR | 1.478.000 | USD | 99.061 | Citibank | 15/6/2022 | (4.556) |
| ZAR | 13.539.000 | USD | 921.098 | HSBC | 15/6/2022 | (55.400) |
| ZAR | 3.621.000 | USD | 246.561 | JP Morgan | 15/6/2022 | (15.030) |
| ZAR | 8.645.000 | USD | 561.817 | Morgan Stanley | 15/6/2022 | (9.047) |
| ZAR | 8.853.000 | USD | 563.742 | Morgan Stanley | 20/7/2022 | (14) |
| ZAR | 2.892.000 | USD | 182.912 | Morgan Stanley | 17/8/2022 | 687 |
| | | | | | | 56.500 |
| Auf AUD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| AUD | 52.065.133 | USD | 36.969.694 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 412.325 |
| USD | 3.585.021 | AUD | 5.172.422 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (128.705) |
| | | | | | | 283.620 |
| Auf BRL lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| BRL | 16.679 | USD | 3.293 | State Street Bank & Trust Company | 2/6/2022 | 253 |
| BRL | 16.033 | USD | 3.336 | State Street Bank & Trust Company | 5/7/2022 | 43 |
| USD | 3.491 | BRL | 16.678 | State Street Bank & Trust Company | 2/6/2022 | (55) |
| USD | 75 | BRL | 359 | State Street Bank & Trust Company | 5/7/2022 | (1) |
| | | | | | | 240 |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 418.896 | USD | 426.531 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 10.332 |
| USD | 29.088 | CHF | 28.674 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (815) |
| | | | | | | 9.517 |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 2.540.156 | USD | 2.692.364 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 30.421 |
| USD | 144.005 | EUR | 135.894 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (1.658) |
| | | | | | | 28.763 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 665.059 | USD | 822.865 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 14.378 |
| USD | 204.759 | GBP | 164.045 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (1.756) |
| | | | | | | 12.622 |
| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| JPY | 10.800.720.782 | USD | 83.030.055 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 886.930 |
| USD | 1.688.327 | JPY | 216.696.798 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 4.685 |
| | | | | | | 891.615 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Style Advantage Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|--------|---------|----------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf NZD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| NZD | 206 | USD | 133 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 1 |
| USD | 4 | NZD | 5 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | — |
| | | | | | | 1 |
| Auf SEK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| SEK | 33.906 | USD | 3.428 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 25 |
| USD | 215 | SEK | 2.142 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (2) |
| | | | | | | 23 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 611.016.228) | | | | | | 1.282.901 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Staatsanleihen | 67,74 |
| Finanzen | 7,41 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 75,15 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 24,85 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|-------------------------------------|------------------------|--------------------|---------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| STAMMAKTIE UND VORZUGSAKTIE | | | | Kaimaninseln | | | |
| Australien | | | | Curaçao | | | |
| 2.330 | Ampol Ltd | 55.798 | 0,01 | 45.432 | Schlumberger NV | 2.172.104 | 0,49 |
| 84.276 | Aristocrat Leisure Ltd | 2.044.211 | 0,46 | | | 2.172.104 | 0,49 |
| 8.761 | Atlas Arteria Ltd (Unit) | 45.219 | 0,01 | Dänemark | | | |
| 98.743 | Aurizon Holdings Ltd | 284.948 | 0,06 | 19 | AP Moller - Maersk A/S 'A' | 54.308 | 0,01 |
| 10.958 | Brambles Ltd | 85.584 | 0,02 | 893 | Carlsberg A/S 'B' | 114.959 | 0,03 |
| 5.212 | carsales.com Ltd | 76.699 | 0,02 | 2.416 | Danske Bank A/S | 39.191 | 0,01 |
| 171 | Cochlear Ltd | 27.370 | 0,01 | 1.126 | Genmab A/S | 343.575 | 0,08 |
| 19.058 | Coles Group Ltd | 239.824 | 0,05 | 580 | Jyske Bank A/S Reg | 34.142 | 0,01 |
| 9.741 | Commonwealth Bank of Australia | 729.745 | 0,17 | 26.335 | Novo Nordisk A/S 'B' | 2.916.167 | 0,66 |
| 3.664 | Computershare Ltd | 61.021 | 0,01 | 9.731 | Novozymes A/S 'B' | 617.944 | 0,14 |
| 2.662 | CSL Ltd | 519.444 | 0,12 | | | 4.120.286 | 0,94 |
| 20.528 | Flight Centre Travel Group Ltd | 302.088 | 0,07 | Finnland | | | |
| 8.944 | Insignia Financial Ltd | 21.316 | 0,00 | 4.884 | Kone Oyj 'B' | 249.932 | 0,06 |
| 4.164 | JB Hi-Fi Ltd | 137.380 | 0,03 | 108.692 | Nokia Oyj | 548.415 | 0,12 |
| 6.186 | Macquarie Group Ltd | 825.866 | 0,19 | 38.864 | Nordea Bank Abp | 394.526 | 0,09 |
| 22.999 | Medibank Pvt Ltd | 53.162 | 0,01 | 9.228 | Outokumpu Oyj* | 52.967 | 0,01 |
| 45.170 | Mirvac Group (REIT) | 73.281 | 0,02 | | | 1.245.840 | 0,28 |
| 18.046 | QBE Insurance Group Ltd | 155.840 | 0,04 | Frankreich | | | |
| 10.750 | REA Group Ltd | 868.999 | 0,20 | 1.227 | Amundi SA | 71.373 | 0,02 |
| 4.571 | Sims Ltd | 57.882 | 0,01 | 42.569 | AXA SA | 1.067.316 | 0,24 |
| 436.477 | South32 Ltd | 1.566.625 | 0,36 | 10.418 | Electricite de France SA | 92.229 | 0,02 |
| 165.342 | Stockland (REIT) | 474.763 | 0,11 | 105.649 | Engie SA | 1.406.784 | 0,32 |
| 117.082 | Telstra Corp Ltd | 326.104 | 0,07 | 495 | Hermes International | 582.235 | 0,13 |
| 30.008 | Westpac Banking Corp | 514.189 | 0,12 | 2.783 | Kering SA | 1.501.675 | 0,34 |
| 7.683 | Woodside Energy Group Ltd | 164.134 | 0,04 | 2.720 | Legrand SA | 236.542 | 0,05 |
| | | 9.711.492 | 2,21 | 9.067 | L'Oreal SA* | 3.196.070 | 0,73 |
| Österreich | | | | 2.946 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 1.886.598 | 0,43 |
| 2.376 | ANDRITZ AG | 109.600 | 0,02 | 7.584 | Pernod Ricard SA | 1.487.570 | 0,34 |
| 1.105 | OMV AG | 65.579 | 0,02 | 17.329 | Rubis SCA | 525.909 | 0,12 |
| 1.177 | Raiffeisen Bank International AG | 15.685 | 0,00 | 12.154 | Schneider Electric SE | 1.682.441 | 0,38 |
| 1.375 | Verbund AG | 135.955 | 0,03 | 6.544 | Societe Generale SA | 175.677 | 0,04 |
| | | 326.819 | 0,07 | 8.255 | Valeo SA | 177.836 | 0,04 |
| Belgien | | | | | | 14.090.255 | 3,20 |
| 2.451 | Ackermans & van Haaren NV | 414.850 | 0,09 | Deutschland | | | |
| 14.205 | Anheuser-Busch InBev SA | 798.746 | 0,18 | 1.410 | Allianz SE Reg* | 294.208 | 0,07 |
| 460 | Elia Group SA* | 75.888 | 0,02 | 985 | Aurubis AG | 93.151 | 0,02 |
| 4.631 | Groupe Bruxelles Lambert SA | 429.321 | 0,10 | 16.107 | Bayerische Motoren Werke AG* | 1.387.444 | 0,32 |
| 408 | KBC Group NV | 25.516 | 0,01 | 1.115 | Bayerische Motoren Werke AG (Pref)* | 87.433 | 0,02 |
| 1.103 | Solvay SA | 107.288 | 0,02 | 35.685 | Commerzbank AG | 307.579 | 0,07 |
| | | 1.851.609 | 0,42 | 81.497 | Deutsche Bank AG Reg | 913.371 | 0,21 |
| Britische Jungferninseln | | | | 2.420 | Deutsche Boerse AG | 403.770 | 0,09 |
| 448 | Nomad Foods Ltd | 9.453 | 0,00 | 28.769 | E.ON SE | 292.039 | 0,07 |
| | | 9.453 | 0,00 | 7.192 | Freenet AG | 187.911 | 0,04 |
| Kanada | | | | 433 | Hannover Rueck SE | 65.821 | 0,01 |
| 1.414 | Atco Ltd 'I' | 50.740 | 0,01 | 4.825 | K+S AG Reg | 135.526 | 0,03 |
| 9.188 | BCE Inc* | 501.203 | 0,11 | 11.632 | Mercedes-Benz Group AG | 821.165 | 0,19 |
| 972 | BRP Inc | 75.171 | 0,02 | 40 | Rational AG | 26.031 | 0,01 |
| 6.504 | Canadian National Railway Co | 741.683 | 0,17 | 1.552 | Rheinmetall AG | 317.220 | 0,07 |
| 1.308 | CGI Inc | 111.811 | 0,03 | 20.970 | SAP SE | 2.080.177 | 0,47 |
| 76.816 | Crescent Point Energy Corp | 685.320 | 0,16 | 335 | Sartorius AG (Pref) | 134.683 | 0,03 |
| 342 | Descartes Systems Group Inc | 20.728 | 0,00 | 2.193 | Scout24 AG | 134.941 | 0,03 |
| 33.387 | Enbridge Inc | 1.550.059 | 0,35 | | | | |
| 1.675 | Finning International Inc | 44.818 | 0,01 | | | | |
| 2.836 | First Quantum Minerals Ltd | 81.669 | 0,02 | | | | |
| 2.065 | FirstService Corp | 258.593 | 0,06 | | | | |
| 9.311 | Franco-Nevada Corp | 1.342.283 | 0,30 | | | | |
| 16.606 | Great-West Lifeco Inc* | 452.204 | 0,10 | | | | |
| 77.391 | Hydro One Ltd | 2.161.329 | 0,49 | | | | |
| 7.602 | Intact Financial Corp | 1.095.792 | 0,25 | | | | |
| 273 | Kinaxis Inc | 29.385 | 0,01 | | | | |
| 4.666 | Lundin Mining Corp | 40.816 | 0,01 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|--------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Deutschland Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 21.147 | Siemens AG Reg | 2.790.939 | 0,63 | 8.700 | JGC Holdings Corp | 122.225 | 0,03 |
| 6.507 | thyssenkrupp AG | 62.833 | 0,01 | 3.300 | Kakaku.com Inc | 65.505 | 0,01 |
| 533 | Volkswagen AG (Pref) | 87.782 | 0,02 | 6.800 | Komatsu Ltd | 168.779 | 0,04 |
| | | 10.624.024 | 2,41 | 3.100 | Kuraray Co Ltd [^] | 25.880 | 0,01 |
| Hongkong | | | | 21.100 | Mitsubishi Corp | 726.411 | 0,16 |
| 244.000 | AIA Group Ltd | 2.515.512 | 0,57 | 34.400 | Mitsui & Co Ltd | 863.440 | 0,20 |
| 207.000 | BOC Hong Kong Holdings Ltd | 795.327 | 0,18 | 14.900 | Mitsui Fudosan Co Ltd | 325.968 | 0,07 |
| 281.400 | Swire Properties Ltd | 688.515 | 0,16 | 15.300 | Mitsui Mining & Smelting Co Ltd [^] | 404.586 | 0,09 |
| 7.500 | Techtronic Industries Co Ltd | 98.252 | 0,02 | 23.600 | Nikon Corp | 294.164 | 0,07 |
| | | 4.097.606 | 0,93 | 900 | Nintendo Co Ltd [^] | 401.336 | 0,09 |
| Irland | | | | 10.900 | Nitto Denko Corp [^] | 791.481 | 0,18 |
| 2.978 | Accenture Plc 'A' | 893.906 | 0,20 | 16.100 | Nomura Research Institute Ltd [^] | 443.871 | 0,10 |
| 7.518 | Alkermes Plc | 227.795 | 0,05 | 21.800 | Omron Corp | 1.257.227 | 0,28 |
| 280 | Aon Plc 'A' | 77.193 | 0,02 | 41.300 | Recruit Holdings Co Ltd | 1.518.380 | 0,34 |
| 1.294 | Flutter Entertainment Plc | 157.541 | 0,04 | 17.400 | Sega Sammy Holdings Inc | 323.771 | 0,07 |
| 254 | Horizon Therapeutics Plc | 23.457 | 0,00 | 61.000 | Sekisui House Ltd [^] | 1.081.291 | 0,25 |
| 11.096 | James Hardie Industries Plc - CDI | 287.546 | 0,06 | 3.200 | Shin-Etsu Chemical Co Ltd [^] | 455.652 | 0,10 |
| 9.119 | Johnson Controls International Plc | 494.159 | 0,11 | 17.700 | SoftBank Corp | 203.440 | 0,05 |
| 2.508 | Kingspan Group Plc | 207.144 | 0,05 | 9.500 | SoftBank Group Corp | 396.851 | 0,09 |
| 6.373 | Linde Plc | 2.065.426 | 0,47 | 900 | Sony Corp | 84.678 | 0,02 |
| 20.997 | Medtronic Plc | 2.095.711 | 0,48 | 414.600 | Sumitomo Chemical Co Ltd [^] | 1.709.724 | 0,39 |
| 5.612 | Perrigo Co Plc | 223.245 | 0,05 | 2.000 | Suntory Beverage & Food Ltd | 74.787 | 0,02 |
| | | 6.753.123 | 1,53 | 2.400 | Sysmex Corp | 156.508 | 0,04 |
| Israel | | | | 42.600 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd [^] | 1.225.083 | 0,28 |
| 172.087 | Bank Hapoalim BM | 1.610.599 | 0,37 | 50.200 | Teijin Ltd | 516.561 | 0,12 |
| 58.526 | Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd | 89.831 | 0,02 | 14.100 | Terumo Corp | 456.623 | 0,10 |
| 291 | Check Point Software Technologies Ltd | 36.450 | 0,01 | 8.900 | Tokio Marine Holdings Inc | 516.036 | 0,12 |
| 24.925 | Israel Discount Bank Ltd 'A' | 140.027 | 0,03 | 6.400 | Tokyo Electron Ltd | 2.931.480 | 0,67 |
| 3.843 | Teva Pharmaceutical Industries Ltd | 34.147 | 0,01 | 24.100 | Tokyo Gas Co Ltd | 469.965 | 0,11 |
| 21.141 | Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR | 188.578 | 0,04 | 20.400 | Toray Industries Inc | 105.561 | 0,02 |
| | | 2.099.632 | 0,48 | 7.500 | Unicharm Corp [^] | 257.562 | 0,06 |
| Italien | | | | 7.200 | ZOZO Inc [^] | 153.489 | 0,03 |
| 22.728 | BPER Banca | 46.637 | 0,01 | | | 26.412.739 | 6,00 |
| 236.495 | Intesa Sanpaolo SpA | 512.771 | 0,12 | Jersey | | | |
| 18 | Italgas SpA | 115 | 0,00 | 5.561 | Experian Plc | 186.150 | 0,04 |
| 3.256 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA [^] | 33.185 | 0,01 | 8.319 | Ferguson Plc | 1.003.503 | 0,23 |
| 2.604 | Moncler SpA | 124.441 | 0,03 | 27.546 | Glencore Plc | 183.549 | 0,04 |
| 59.087 | UniCredit SpA | 685.633 | 0,15 | 1.153 | Janus Henderson Group Plc | 32.434 | 0,01 |
| 12.118 | Unipol Gruppo SpA | 64.595 | 0,01 | | | 1.405.636 | 0,32 |
| | | 1.467.377 | 0,33 | Luxemburg | | | |
| Japan | | | | 779 | RTL Group SA | 36.034 | 0,01 |
| 7.700 | Advantest Corp | 532.210 | 0,12 | | | 36.034 | 0,01 |
| 2.300 | Ajinomoto Co Inc | 55.979 | 0,01 | Niederlande | | | |
| 44.200 | Amada Co Ltd | 354.932 | 0,08 | 2.342 | ABN AMRO Bank NV - CVA [^] | 27.296 | 0,01 |
| 181.400 | Asahi Kasei Corp [^] | 1.469.345 | 0,33 | 4.269 | ASML Holding NV [^] | 2.469.967 | 0,56 |
| 8.800 | Astellas Pharma Inc [^] | 140.954 | 0,03 | 4.727 | Davide Campari-Milano NV [^] | 50.385 | 0,01 |
| 1.900 | Casio Computer Co Ltd | 17.397 | 0,00 | 5.576 | Heineken NV | 560.892 | 0,13 |
| 25.300 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd [^] | 693.188 | 0,16 | 576 | IMCD NV [^] | 86.385 | 0,02 |
| 2.500 | Daifuku Co Ltd | 157.652 | 0,04 | 11.862 | Koninklijke Vopak NV | 343.475 | 0,08 |
| 7.600 | Daikin Industries Ltd | 1.220.875 | 0,28 | 784 | OCI NV | 27.329 | 0,01 |
| 4.300 | Daiwa House Industry Co Ltd | 103.689 | 0,02 | 3.453 | Signify NV [^] | 137.419 | 0,03 |
| 2.300 | DMG Mori Co Ltd | 33.866 | 0,01 | 27.331 | Wolters Kluwer NV | 2.702.390 | 0,61 |
| 3.900 | Ebara Corp | 168.097 | 0,04 | | | 6.405.538 | 1,46 |
| 12.500 | FUJIFILM Holdings Corp | 689.920 | 0,16 | Neuseeland | | | |
| 54.700 | Honda Motor Co Ltd [^] | 1.353.853 | 0,31 | 36.620 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | 500.440 | 0,11 |
| 1.300 | Hoya Corp | 139.425 | 0,03 | 9.719 | Mercury NZ Ltd | 34.786 | 0,01 |
| 21.000 | Inpex Corp | 273.824 | 0,06 | 42.534 | Meridian Energy Ltd | 130.091 | 0,03 |
| 16.700 | ITOCHU Corp | 479.218 | 0,11 | | | 665.317 | 0,15 |
| Norwegen | | | | 62.020 | Equinor ASA | 2.392.588 | 0,54 |
| | | | | 5.390 | Leroy Seafood Group ASA | 41.993 | 0,01 |
| | | | | 9.800 | Norsk Hydro ASA | 78.327 | 0,02 |
| | | | | | | 2.512.908 | 0,57 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|-----------------------|---|------------------------|--------------------|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Portugal | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| 8.581 | Galp Energia SGPS SA | 115.273 | 0,03 | 16.847 | Drax Group Plc | | |
| | | 115.273 | 0,03 | | 144.113 | 0,03 | |
| Singapur | | | | 52.068 | GlaxoSmithKline Plc | 1.132.152 | 0,26 |
| 1.923 | CDL Hospitality Trusts (Unit) | 1.753 | 0,00 | 5.307 | Howden Joinery Group Plc | 45.698 | 0,01 |
| 12.100 | City Developments Ltd | 72.900 | 0,02 | 583 | InterContinental Hotels Group Plc | 36.403 | 0,01 |
| 22.600 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd^ | 195.009 | 0,04 | 1.295 | International Game Technology Plc | 27.791 | 0,01 |
| 597.200 | Singapore Telecommunications Ltd^ | 1.128.190 | 0,26 | 344 | Intertek Group Plc | 20.311 | 0,00 |
| 8.200 | United Overseas Bank Ltd | 176.500 | 0,04 | 442.149 | ITV Plc^ | 388.188 | 0,09 |
| 12.500 | Wilmar International Ltd | 38.020 | 0,01 | 260.528 | J Sainsbury Plc^ | 748.776 | 0,17 |
| | | 1.612.372 | 0,37 | 7.782 | Johnson Matthey Plc | 208.475 | 0,05 |
| Spanien | | | | 161.882 | Kingfisher Plc^ | 535.365 | 0,12 |
| 218 | Acciona SA^ | 41.919 | 0,01 | 1.139 | Liberty Global Plc 'A'^ | 28.384 | 0,01 |
| 134.723 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | 730.847 | 0,17 | 2.226.150 | Lloyds Banking Group Plc | 1.256.081 | 0,28 |
| 415.739 | Banco Santander SA | 1.345.656 | 0,30 | 22 | Micro Focus International Plc | 104 | 0,00 |
| 46.217 | Industria de Diseno Textil SA | 1.106.548 | 0,25 | 1.236 | National Grid Plc^ | 18.174 | 0,00 |
| | | 3.224.970 | 0,73 | 178.034 | Natwest Group Plc | 510.786 | 0,12 |
| Schweden | | | | 30.043 | RELX Plc | 860.053 | 0,20 |
| 59.513 | Atlas Copco AB 'A' | 678.798 | 0,15 | 7.843 | Rightmove Plc | 59.143 | 0,01 |
| 8.512 | Boliden AB | 360.371 | 0,08 | 2.810 | Smiths Group Plc | 55.362 | 0,01 |
| 12.124 | Epiroc AB 'A' | 234.919 | 0,05 | 1.645 | Spectris Plc^ | 62.520 | 0,01 |
| 7.780 | Lundin Energy AB | 382.296 | 0,09 | 8.517 | SSE Plc | 189.351 | 0,04 |
| 21.357 | Saab AB 'B' | 910.275 | 0,21 | 72.244 | Standard Chartered Plc | 570.426 | 0,13 |
| 53.136 | Tele2 AB 'B' | 646.532 | 0,15 | 86.392 | Taylor Wimpey Plc | 140.952 | 0,03 |
| 23.097 | Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | 188.751 | 0,04 | 10.427 | Unilever Plc (traded in Netherlands) | 495.274 | 0,11 |
| | | 3.401.942 | 0,77 | 3.533 | Unilever Plc (traded in United Kingdom)^ | 167.856 | 0,04 |
| Schweiz | | | | 2.778 | United Utilities Group Plc | 36.756 | 0,01 |
| 43.784 | ABB Ltd Reg^ | 1.351.623 | 0,31 | 284.605 | Vodafone Group Plc^ | 470.577 | 0,11 |
| 4.910 | Adecco Group AG Reg | 190.106 | 0,04 | | | 14.701.381 | 3,34 |
| 1.938 | Baloise Holding AG Reg^ | 330.440 | 0,07 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 196 | Belimo Holding AG Reg | 78.543 | 0,02 | 7.615 | 3M Co | 1.116.968 | 0,25 |
| 25 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | 248.827 | 0,06 | 2.862 | Abbott Laboratories | 329.903 | 0,07 |
| 337 | Flughafen Zurich AG Reg | 56.723 | 0,01 | 14.220 | AbbVie Inc | 2.098.588 | 0,48 |
| 1.218 | Garmin Ltd | 126.928 | 0,03 | 7.612 | Adobe Inc | 3.174.661 | 0,72 |
| 324 | Givaudan SA Reg^ | 1.193.684 | 0,27 | 124 | Advance Auto Parts Inc^ | 23.644 | 0,01 |
| 6.130 | Julius Baer Group Ltd | 314.837 | 0,07 | 14.739 | Advanced Micro Devices Inc | 1.494.829 | 0,34 |
| 11.220 | Nestle SA Reg | 1.367.448 | 0,31 | 526 | AECOM^ | 37.204 | 0,01 |
| 2.314 | Novartis AG Reg | 208.996 | 0,05 | 24.988 | Agilent Technologies Inc | 3.226.950 | 0,73 |
| 4.217 | On Holding AG 'A'^ | 88.810 | 0,02 | 4.364 | Align Technology Inc^ | 1.211.883 | 0,28 |
| 72 | Roche Holding AG | 28.035 | 0,00 | 24.108 | Ally Financial Inc | 1.042.912 | 0,24 |
| 2.651 | Sika AG Reg | 737.141 | 0,17 | 2.933 | Alphabet Inc 'A' | 6.599.631 | 1,50 |
| 1.949 | Straumann Holding AG Reg^ | 249.439 | 0,06 | 1.248 | Alphabet Inc 'C' | 2.816.711 | 0,64 |
| 2.817 | Swatch Group AG^ | 713.718 | 0,16 | 10.435 | Altice USA Inc 'A' | 119.585 | 0,03 |
| 118 | Swiss Life Holding AG Reg | 66.926 | 0,01 | 2.594 | Amazon.com Inc | 6.059.921 | 1,38 |
| 4.716 | Swiss Re AG^ | 389.174 | 0,09 | 17.971 | American Express Co | 3.041.951 | 0,69 |
| 67.488 | UBS Group AG Reg | 1.272.390 | 0,29 | 1.556 | American Tower Corp (REIT) | 401.137 | 0,09 |
| 837 | VAT Group AG | 249.312 | 0,06 | 778 | Ameriprise Financial Inc | 214.627 | 0,05 |
| | | 9.263.100 | 2,10 | 1.085 | AmerisourceBergen Corp | 167.589 | 0,04 |
| Großbritannien | | | | 5.414 | Amgen Inc | 1.360.701 | 0,31 |
| 10.832 | Antofagasta Plc | 208.569 | 0,05 | 2.692 | Anthem Inc | 1.392.491 | 0,32 |
| 1.836 | Associated British Foods Plc | 40.125 | 0,01 | 6.431 | APA Corp | 316.341 | 0,07 |
| 18.799 | AstraZeneca Plc^ | 2.458.431 | 0,56 | 132.042 | Apple Inc | 19.530.332 | 4,43 |
| 1.109 | Atlassian Corp Plc 'A' | 199.443 | 0,05 | 2.634 | Applied Materials Inc | 308.244 | 0,07 |
| 29.998 | Auto Trader Group Plc | 221.753 | 0,05 | 503 | ASGN Inc | 47.352 | 0,01 |
| 34.426 | Barclays Plc | 73.841 | 0,02 | 43.947 | AT&T Inc | 932.336 | 0,21 |
| 2.972 | Bellway Plc | 87.213 | 0,02 | 4.561 | Autodesk Inc | 940.433 | 0,21 |
| 230.866 | BP Plc | 1.274.881 | 0,29 | 1.347 | Automatic Data Processing Inc | 300.273 | 0,07 |
| 6.869 | British Land Co Plc (REIT) | 45.451 | 0,01 | 688 | AvalonBay Communities Inc (REIT) | 143.606 | 0,03 |
| 860 | Burberry Group Plc | 18.318 | 0,00 | 117.520 | Bank of America Corp | 4.370.569 | 0,99 |
| 267.377 | Centrica Plc | 265.915 | 0,06 | 33.233 | Bank of New York Mellon Corp | 1.532.706 | 0,35 |
| 21.614 | Compass Group Plc | 482.431 | 0,11 | 7.808 | Berkshire Hathaway Inc 'B' | 2.467.172 | 0,56 |
| 484 | Croda International Plc | 41.798 | 0,01 | 464 | Best Buy Co Inc | 38.313 | 0,01 |
| 23.268 | Diageo Plc | 1.074.141 | 0,24 | 2.147 | Biogen Inc | 434.209 | 0,10 |
| | | | | 736 | Booking Holdings Inc | 1.636.128 | 0,37 |
| | | | | 6.452 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | 550.356 | 0,12 |
| | | | | 80.708 | Boston Scientific Corp | 3.309.835 | 0,75 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|---|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 8.558 | Brighthouse Financial Inc | 419.684 | 0,10 | 16.482 | Home Depot Inc | 4.984.651 | 1,13 |
| 3.293 | Bristol-Myers Squibb Co [^] | 244.374 | 0,06 | 34.876 | HP Inc | 1.346.562 | 0,31 |
| 15.124 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | 368.269 | 0,08 | 3.322 | Humana Inc | 1.520.081 | 0,35 |
| 34.400 | Brown-Forman Corp 'B' | 2.260.080 | 0,51 | 32.975 | Huntington Bancshares Inc | 454.725 | 0,10 |
| 705 | Braker Corp | 44.084 | 0,01 | 3.357 | IDEXX Laboratories Inc | 1.319.939 | 0,30 |
| 9.025 | Cadence Design Systems Inc | 1.381.998 | 0,31 | 3.515 | Illinois Tool Works Inc | 716.638 | 0,16 |
| 4.885 | Campbell Soup Co [^] | 230.572 | 0,05 | 98.143 | Intel Corp | 4.307.987 | 0,98 |
| 9.644 | Capital One Financial Corp | 1.226.331 | 0,28 | 2.627 | Intercontinental Exchange Inc | 268.269 | 0,06 |
| 6.861 | Cardinal Health Inc | 385.931 | 0,09 | 1.293 | Interpublic Group of Cos Inc | 41.363 | 0,01 |
| 1.692 | CBRE Group Inc 'A' | 140.656 | 0,03 | 5.452 | Intuit Inc | 2.295.292 | 0,52 |
| 16.907 | Charles Schwab Corp | 1.188.055 | 0,27 | 37.202 | Johnson & Johnson | 6.549.412 | 1,49 |
| 3.359 | Charter Communications Inc 'A' | 1.701.871 | 0,39 | 309 | Jones Lang LaSalle Inc | 61.349 | 0,01 |
| 9.106 | Chevron Corp | 1.642.176 | 0,37 | 46.717 | JPMorgan Chase & Co | 6.140.950 | 1,39 |
| 5.169 | Cigna Corp | 1.397.077 | 0,32 | 19.763 | Juniper Networks Inc | 605.538 | 0,14 |
| 448 | Cirrus Logic Inc | 36.176 | 0,01 | 11.734 | Keysight Technologies Inc | 1.703.659 | 0,39 |
| 24.703 | Cisco Systems Inc | 1.109.659 | 0,25 | 109.808 | Kinder Morgan Inc | 2.192.866 | 0,50 |
| 34.117 | Citigroup Inc | 1.827.648 | 0,41 | 1.381 | KLA Corp | 498.348 | 0,11 |
| 33.721 | Coca-Cola Co | 2.130.156 | 0,48 | 147 | Lam Research Corp | 75.701 | 0,02 |
| 15.677 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | 1.161.195 | 0,26 | 1.749 | Landstar System Inc [^] | 261.091 | 0,06 |
| 42.120 | Colgate-Palmolive Co | 3.288.308 | 0,75 | 558 | Lennar Corp 'A' | 44.646 | 0,01 |
| 104.069 | Comcast Corp 'A' | 4.557.182 | 1,03 | 1.177 | Lennox International Inc | 242.121 | 0,05 |
| 11.337 | Consolidated Edison Inc | 1.128.598 | 0,26 | 1.604 | Lincoln National Corp | 92.727 | 0,02 |
| 930 | Continental Resources Inc | 65.695 | 0,01 | 11.421 | Lowe's Cos Inc | 2.233.719 | 0,51 |
| 8.563 | Costco Wholesale Corp | 3.947.886 | 0,90 | 912 | Manhattan Associates Inc | 109.987 | 0,02 |
| 15.827 | Crown Castle International Corp (REIT) | 3.008.238 | 0,68 | 1.563 | ManpowerGroup Inc | 134.418 | 0,03 |
| 1.518 | CSX Corp | 48.333 | 0,01 | 10.090 | Marsh & McLennan Cos Inc | 1.603.906 | 0,36 |
| 919 | Cummins Inc | 190.398 | 0,04 | 574 | Marvell Technology Inc | 33.912 | 0,01 |
| 12.292 | CVS Health Corp | 1.195.274 | 0,27 | 3.011 | Masco Corp | 169.881 | 0,04 |
| 6.811 | Danaher Corp | 1.784.414 | 0,41 | 1.551 | Masimo Corp | 222.491 | 0,05 |
| 350 | DaVita Inc | 33.933 | 0,01 | 4.631 | Mastercard Inc 'A' | 1.650.859 | 0,37 |
| 51.111 | Dell Technologies Inc 'C' | 2.492.172 | 0,57 | 992 | McDonald's Corp | 248.129 | 0,06 |
| 694 | Devon Energy Corp | 53.986 | 0,01 | 501 | McKesson Corp | 164.498 | 0,04 |
| 4.163 | Discover Financial Services | 467.005 | 0,11 | 45.521 | Merck & Co Inc | 4.144.232 | 0,94 |
| 5.488 | Ecolab Inc | 891.635 | 0,20 | 24.491 | Meta Platforms Inc 'A' | 4.746.601 | 1,08 |
| 30.579 | Edison International | 2.116.678 | 0,48 | 50.312 | MetLife Inc | 3.379.960 | 0,77 |
| 8.050 | Edwards Lifesciences Corp | 804.034 | 0,18 | 1.373 | Mettler-Toledo International Inc | 1.794.333 | 0,41 |
| 6.260 | Eli Lilly & Co | 1.956.688 | 0,44 | 68.077 | Microsoft Corp | 18.438.655 | 4,19 |
| 10.920 | Entergy Corp | 1.305.486 | 0,30 | 1.274 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | 231.766 | 0,05 |
| 17.211 | EOG Resources Inc | 2.409.196 | 0,55 | 1.201 | Moderna Inc | 176.379 | 0,04 |
| 447 | EPAM Systems Inc | 144.618 | 0,03 | 397 | Molina Healthcare Inc | 118.802 | 0,03 |
| 1.005 | Equinix Inc (REIT) | 685.430 | 0,16 | 22.116 | Molson Coors Beverage Co 'B' [^] | 1.208.861 | 0,27 |
| 8.828 | Equity Residential (REIT) | 683.199 | 0,15 | 1.043 | Monolithic Power Systems Inc | 465.741 | 0,11 |
| 1.876 | Estee Lauder Cos Inc 'A' | 478.793 | 0,11 | 3.461 | Moody's Corp | 1.045.014 | 0,24 |
| 1.765 | Exelixis Inc | 32.282 | 0,01 | 2.669 | Mosaic Co | 166.199 | 0,04 |
| 2.298 | Expedia Group Inc | 294.925 | 0,07 | 400 | Motorola Solutions Inc | 87.532 | 0,02 |
| 1.294 | Expeditors International of Washington Inc | 139.545 | 0,03 | 8.583 | NetApp Inc | 617.375 | 0,14 |
| 52.156 | Exxon Mobil Corp | 5.166.573 | 1,17 | 540 | NextEra Energy Inc | 41.221 | 0,01 |
| 216 | FactSet Research Systems Inc | 82.631 | 0,02 | 5.795 | NIKE Inc 'B' | 673.321 | 0,15 |
| 1.477 | FedEx Corp | 324.689 | 0,07 | 2.267 | Norfolk Southern Corp | 544.760 | 0,12 |
| 8.464 | Fidelity National Information Services Inc | 883.049 | 0,20 | 21.724 | NVIDIA Corp | 4.032.192 | 0,92 |
| 229 | FMC Corp | 28.314 | 0,01 | 351 | Old Dominion Freight Line Inc | 89.726 | 0,02 |
| 1.798 | Fortinet Inc | 525.573 | 0,12 | 7.025 | ONEOK Inc | 469.481 | 0,11 |
| 39.222 | Fox Corp 'A' | 1.388.459 | 0,32 | 2.176 | Owens Corning | 207.003 | 0,05 |
| 11.939 | Fox Corp 'B' | 389.928 | 0,09 | 1.142 | Palo Alto Networks Inc | 574.791 | 0,13 |
| 528 | Gartner Inc | 138.399 | 0,03 | 5.302 | Paychex Inc | 650.078 | 0,15 |
| 2.307 | General Electric Co | 181.838 | 0,04 | 13.347 | PayPal Holdings Inc | 1.121.281 | 0,25 |
| 3.695 | General Motors Co | 141.445 | 0,03 | 17.477 | PepsiCo Inc | 2.894.191 | 0,66 |
| 13.493 | Gilead Sciences Inc | 862.203 | 0,20 | 40.959 | Pfizer Inc | 2.132.735 | 0,48 |
| 2.095 | Global Payments Inc | 273.377 | 0,06 | 5.435 | Phillips 66 | 561.381 | 0,13 |
| 2.639 | Hartford Financial Services Group Inc [^] | 189.797 | 0,04 | 5.193 | PNC Financial Services Group Inc | 904.828 | 0,21 |
| 12.922 | HEICO Corp [^] | 1.828.334 | 0,41 | 882 | Power Integrations Inc | 74.088 | 0,02 |
| 12.888 | HEICO Corp 'A' | 1.496.426 | 0,34 | 2.689 | Principal Financial Group Inc [^] | 194.818 | 0,04 |
| 9.684 | Henry Schein Inc | 822.172 | 0,19 | 3.857 | Procter & Gamble Co | 564.858 | 0,13 |
| 44.406 | Hewlett Packard Enterprise Co | 692.734 | 0,16 | 5.968 | Prologis Inc (REIT) | 753.997 | 0,17 |
| | | | | 5.440 | Public Service Enterprise Group Inc | 371.389 | 0,08 |
| | | | | 15.227 | QUALCOMM Inc | 2.107.112 | 0,48 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|---|---------------------------------|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.254 | Quanta Services Inc [^] | 152.361 | 0,03 | 1.644 | Ulta Beauty Inc | | |
| 3.615 | Ralph Lauren Corp | 355.861 | 0,08 | | 685.137 | 0,16 | |
| 557 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | 378.429 | 0,09 | 2.897 | Union Pacific Corp | 640.208 | 0,15 |
| 31.027 | Regions Financial Corp | 676.078 | 0,15 | 5.778 | United Parcel Service Inc 'B' | 1.037.613 | 0,24 |
| 411 | Reinsurance Group of America Inc | 51.605 | 0,01 | 2.739 | United Rentals Inc | 804.554 | 0,18 |
| 7.656 | Reliance Steel & Aluminum Co [^] | 1.538.550 | 0,35 | 1.047 | United Therapeutics Corp | 242.286 | 0,05 |
| 613 | RingCentral Inc 'A' | 39.483 | 0,01 | 7.628 | UnitedHealth Group Inc | 3.831.392 | 0,87 |
| 3.494 | Robert Half International Inc | 307.961 | 0,07 | 1.306 | Unum Group | 47.382 | 0,01 |
| 932 | Roper Technologies Inc | 410.052 | 0,09 | 5.611 | Valero Energy Corp [^] | 753.950 | 0,17 |
| 13.402 | salesforce.com Inc | 2.151.825 | 0,49 | 62.193 | Verizon Communications Inc | 3.176.508 | 0,72 |
| 2.404 | SBA Communications Corp (REIT) | 811.254 | 0,18 | 1.261 | Vertex Pharmaceuticals Inc | 338.288 | 0,08 |
| 2.153 | Sempra Energy | 354.879 | 0,08 | 684 | VF Corp | 34.426 | 0,01 |
| 450 | Semtech Corp | 28.463 | 0,01 | 2.391 | Viatis Inc | 28.859 | 0,01 |
| 9.995 | Service Corp International [^] | 688.156 | 0,16 | 27.134 | Visa Inc 'A' [^] | 5.757.563 | 1,31 |
| 4.060 | ServiceNow Inc | 1.910.108 | 0,43 | 7.945 | Voya Financial Inc | 542.405 | 0,12 |
| 11.188 | Simon Property Group Inc (REIT) | 1.273.418 | 0,29 | 10.517 | Walmart Inc | 1.347.123 | 0,31 |
| 106.409 | Sirius XM Holdings Inc [^] | 676.761 | 0,15 | 1.756 | Walt Disney Co | 190.947 | 0,04 |
| 2.780 | SiteOne Landscape Supply Inc [^] | 370.157 | 0,08 | 38.794 | Wells Fargo & Co | 1.777.929 | 0,40 |
| 2.187 | Snap-on Inc [^] | 482.387 | 0,11 | 9.041 | Williams Cos Inc [^] | 340.122 | 0,08 |
| 608 | Stifel Financial Corp | 38.863 | 0,01 | 7.294 | Workday Inc 'A' | 1.132.248 | 0,26 |
| 41.827 | Synchrony Financial | 1.520.411 | 0,35 | 3.258 | WW Grainger Inc | 1.575.210 | 0,36 |
| 1.291 | Syneos Health Inc | 95.896 | 0,02 | 892 | Zebra Technologies Corp 'A' | 299.453 | 0,07 |
| 4.945 | Target Corp | 809.051 | 0,18 | 17.780 | Zoetis Inc | 3.022.244 | 0,69 |
| 5.247 | Tesla Inc | 3.941.179 | 0,89 | | | | |
| 176 | Tetra Tech Inc [^] | 23.635 | 0,01 | | | | |
| 3.134 | Texas Instruments Inc | 546.507 | 0,12 | | | | |
| 1.038 | Toll Brothers Inc | 52.108 | 0,01 | | | | |
| 17.657 | Travel + Leisure Co | 894.504 | 0,20 | | | | |
| 16.613 | Travelers Cos Inc | 2.933.357 | 0,67 | | | | |
| 22.013 | Truist Financial Corp | 1.076.656 | 0,24 | | | | |
| | | | | | | 291.382.173 | 66,17 |
| | | | | Gesamt Stammaktien und Vorzugsaktien | | 434.670.173 | 98,71 |
| | | | | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 434.670.173 | 98,71 |
| | | | | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 434.670.173 | 98,71 |
| | | | | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 5.700.982 | 1,29 |
| | | | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | 440.371.155 | 100,00 |

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

| Anzahl der Kontrakte | Vertrags- währung | Kontrakte/ Bezeichnung | Verfalls- datum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn USD |
|-------------------------------------|----------------------|--|--------------------|--|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| 14 | USD | E-Mini S&P 500 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 2.880.500 | 133.200 |
| 13 | USD | MSCI EAFE Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 1.323.920 | 23.422 |
| Gesamt | | | | | 156.622 |

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|---------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 9.028 | USD | 9.574 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 104 |
| USD | 1.169 | EUR | 1.110 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (21) |
| | | | | | | 83 |
| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| JPY | 1.108.654.839 | USD | 8.535.696 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 78.078 |
| USD | 812.073 | JPY | 104.675.423 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (1.210) |
| | | | | | | 76.868 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 9.437.925) | | | | | | 76.951 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Nicht zyklische Konsumgüter | 20,56 |
| Technologie | 19,28 |
| Finanzen | 18,90 |
| Kommunikation | 10,56 |
| Zyklische Konsumgüter | 9,69 |
| Industrie | 7,52 |
| Energie | 5,36 |
| Grundstoffe | 4,26 |
| Versorger | 2,58 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 98,71 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 1,29 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|---------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Brasilien Fortsetzung | | | |
| STAMMAKTIE UND VORZUGSAKTIE | | | | 13.611 | Sendas Distribuidora SA | 46.160 | 0,03 |
| Australien | | | | 7.335 | Ultrapar Participacoes SA | 22.521 | 0,01 |
| 14.695 | AGL Energy Ltd | 92.408 | 0,06 | 8.168 | Vale SA | 148.907 | 0,10 |
| 1.815 | Aristocrat Leisure Ltd | 44.025 | 0,03 | 2.684 | YDUQS Part | 9.542 | 0,01 |
| 774 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | 13.913 | 0,01 | | | 1.021.918 | 0,70 |
| 47.594 | BHP Group Ltd | 1.524.116 | 1,05 | Britische Jungferninseln | | | |
| 1.494 | Charter Hall Group (REIT) | 14.232 | 0,01 | 583 | Nomad Foods Ltd [^] | 12.301 | 0,01 |
| 1.464 | Commonwealth Bank of Australia | 109.675 | 0,08 | | | 12.301 | 0,01 |
| 775 | CSL Ltd [^] | 151.228 | 0,10 | Kanada | | | |
| 3.308 | Deterra Royalties Ltd | 10.662 | 0,01 | 815 | Aritzia Inc | 23.702 | 0,02 |
| 4.410 | Incitec Pivot Ltd | 11.143 | 0,01 | 1.467 | Atco Ltd 'I' | 52.642 | 0,04 |
| 399 | JB Hi-Fi Ltd | 13.164 | 0,01 | 10.914 | BCE Inc | 595.356 | 0,41 |
| 891 | Macquarie Group Ltd | 118.954 | 0,08 | 3.853 | Canadian National Railway Co | 439.376 | 0,30 |
| 21.289 | Medibank Pvt Ltd | 49.209 | 0,03 | 6.467 | Canadian Natural Resources Ltd | 441.517 | 0,30 |
| 4.217 | Origin Energy Ltd | 20.736 | 0,01 | 342 | Canadian Utilities Ltd 'A' | 10.779 | 0,01 |
| 9.392 | QBE Insurance Group Ltd | 81.107 | 0,06 | 6.623 | Cenovus Energy Inc | 156.572 | 0,11 |
| 2.409 | REA Group Ltd | 194.736 | 0,13 | 72.877 | Crescent Point Energy Corp | 650.178 | 0,45 |
| 13.037 | Scentre Group (REIT) | 26.859 | 0,02 | 1.443 | Emera Inc | 72.004 | 0,05 |
| 46.353 | South32 Ltd | 166.372 | 0,11 | 24.388 | Enbridge Inc | 1.132.262 | 0,78 |
| 21.278 | Stockland (REIT) | 61.098 | 0,04 | 1.478 | FirstService Corp | 185.085 | 0,13 |
| 44.372 | Telstra Corp Ltd | 123.587 | 0,09 | 3.659 | Franco-Nevada Corp | 527.485 | 0,36 |
| 329 | Wesfarmers Ltd | 11.145 | 0,01 | 100 | George Weston Ltd | 12.308 | 0,01 |
| 5.624 | Westpac Banking Corp | 96.368 | 0,07 | 12.581 | Great-West Lifeco Inc [^] | 342.598 | 0,24 |
| 12.032 | Woodside Energy Group Ltd | 257.042 | 0,18 | 4.787 | Hydro One Ltd | 133.688 | 0,09 |
| | | 3.191.779 | 2,20 | 3.148 | Imperial Oil Ltd | 178.819 | 0,12 |
| Österreich | | | | 1.296 | Intact Financial Corp | 186.812 | 0,13 |
| 3.045 | ANDRITZ AG [^] | 140.460 | 0,10 | 32.565 | Manulife Financial Corp | 598.062 | 0,41 |
| 168 | BAWAG Group AG | 8.635 | 0,01 | 143 | Nutrien Ltd | 13.890 | 0,01 |
| 352 | Raiffeisen Bank International AG [^] | 4.691 | 0,00 | 507 | Parex Resources Inc | 11.416 | 0,01 |
| 196 | Verbund AG | 19.379 | 0,01 | 3.355 | Stantec Inc | 152.207 | 0,10 |
| | | 173.165 | 0,12 | 283 | Suncor Energy Inc | 11.785 | 0,01 |
| Belgien | | | | 2.002 | Teck Resources Ltd 'B' | 86.281 | 0,06 |
| 273 | Groupe Bruxelles Lambert SA | 25.309 | 0,02 | 17.914 | Wheaton Precious Metals Corp [^] | 756.884 | 0,52 |
| 343 | KBC Group NV | 21.451 | 0,01 | 3.686 | Yamana Gold Inc | 20.320 | 0,01 |
| 626 | Solvay SA | 60.890 | 0,04 | | | 6.792.028 | 4,68 |
| | | 107.650 | 0,07 | Kaimaninseln | | | |
| Bermuda | | | | 79.500 | 3SBio Inc | 59.064 | 0,04 |
| 300 | Jardine Matheson Holdings Ltd | 17.412 | 0,01 | 16.112 | Alibaba Group Holding Ltd | 197.623 | 0,14 |
| 1.500 | Orient Overseas International Ltd | 46.068 | 0,03 | 4.000 | ANTA Sports Products Ltd | 45.622 | 0,03 |
| 9.000 | Pacific Basin Shipping Ltd | 4.691 | 0,01 | 3.391 | Autohome Inc ADR [^] | 121.228 | 0,08 |
| | | 68.171 | 0,05 | 16.184 | Baidu Inc 'A' | 304.205 | 0,21 |
| Brasilien | | | | 600 | BeiGene Ltd | 6.572 | 0,00 |
| 84.460 | Ambev SA | 254.111 | 0,17 | 1.000 | Bizlink Holding Inc | 10.732 | 0,01 |
| 82.308 | Banco Bradesco SA (Pref) | 358.239 | 0,25 | 64.500 | China Hongqiao Group Ltd | 80.058 | 0,06 |
| 3.738 | Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA | 10.594 | 0,01 | 12.500 | China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd | 12.919 | 0,01 |
| 28.233 | Cogna Educacao | 16.268 | 0,01 | 10.000 | CIMC Enric Holdings Ltd | 10.552 | 0,01 |
| 5.353 | CPFL Energia SA | 38.619 | 0,03 | 4.000 | CK Hutchison Holdings Ltd | 28.392 | 0,02 |
| 4.334 | Energisa SA (Unit) | 40.307 | 0,03 | 10.000 | Dongyue Group Ltd | 12.705 | 0,01 |
| 4.147 | Fleury SA | 13.553 | 0,01 | 3.300 | ENN Energy Holdings Ltd | 50.590 | 0,03 |
| 3.898 | Marfrig Global Foods SA | 12.847 | 0,01 | 8.500 | Innovent Biologics Inc | 26.376 | 0,02 |
| 20.417 | Marisa Lojas SA | 10.723 | 0,01 | 10.500 | Jinxin Fertility Group Ltd | 8.242 | 0,01 |
| 6.195 | Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA | 31.732 | 0,02 | 7.500 | Li Ning Co Ltd | 58.493 | 0,04 |
| 3.216 | Qualicorp Consultoria e Corretora de Seguros SA | 7.795 | 0,00 | 11.000 | Logan Group Co Ltd [^] | 2.903 | 0,00 |
| | | | | 1.265 | NetEase Inc | 27.437 | 0,02 |
| | | | | 2.000 | Parade Technologies Ltd | 103.704 | 0,07 |
| | | | | 42.000 | SSY Group Ltd | 19.054 | 0,01 |
| | | | | 79.000 | Sunac China Holdings Ltd [^] | 40.820 | 0,03 |
| | | | | 902 | Tecnoglass Inc | 20.069 | 0,01 |
| | | | | 14.700 | Tencent Holdings Ltd | 678.881 | 0,47 |
| | | | | 12.915 | Vipshop Holdings Ltd ADR | 122.822 | 0,08 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---------------------------------|--|------------------------|--------------------|--------------------|-------------------------------------|------------------------|--------------------|
| Kaimaninseln Fortsetzung | | | | Curaçao | | | |
| 15.500 | WH Group Ltd | 11.891 | 0,01 | 6.136 | Schlumberger NV | 293.362 | 0,20 |
| 8.500 | Wuxi Biologics Cayman Inc | 62.825 | 0,04 | | | 293.362 | 0,20 |
| | | 2.123.779 | 1,46 | Dänemark | | | |
| China | | | | 236 | Carlsberg A/S 'B' | 30.381 | 0,02 |
| 121.700 | Aluminum Corp of China Ltd 'A' | 93.904 | 0,06 | 255 | Genmab A/S | 77.808 | 0,05 |
| 72.000 | Aluminum Corp of China Ltd 'H' | 32.848 | 0,02 | 4.906 | Novo Nordisk A/S 'B' | 543.259 | 0,38 |
| 36.000 | Angang Steel Co Ltd 'H' | 15.277 | 0,01 | | | 651.448 | 0,45 |
| 700 | Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd 'A' | 27.441 | 0,02 | Finnland | | | |
| 2.743 | Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co Ltd 'A' | 52.354 | 0,04 | 129.181 | Nokia Oyj | 651.794 | 0,45 |
| 5.000 | BGI Genomics Co Ltd 'A' | 49.225 | 0,03 | 4.733 | Nordea Bank Abp | 48.047 | 0,03 |
| 11.276 | BYD Co Ltd 'A' | 499.922 | 0,34 | | | 699.841 | 0,48 |
| 6.500 | BYD Co Ltd 'H' | 231.931 | 0,16 | Frankreich | | | |
| 9.000 | China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H' | 19.337 | 0,01 | 4.517 | AXA SA | 113.253 | 0,08 |
| 63.000 | China Molybdenum Co Ltd 'H' | 30.909 | 0,02 | 3 | Casino Guichard Perrachon SA^ | 58 | 0,00 |
| 38.000 | China Suntien Green Energy Corp Ltd 'H' | 22.179 | 0,01 | 181 | Dassault Aviation SA | 30.655 | 0,02 |
| 3.500 | Contemporary Amperex Technology Co Ltd 'A' | 213.952 | 0,15 | 6.710 | Electricite de France SA | 59.402 | 0,04 |
| 3.500 | Do-Fluoride Chemicals Co Ltd 'A' | 20.289 | 0,01 | 38.696 | Engie SA^ | 515.262 | 0,35 |
| 3.400 | Ganfeng Lithium Co Ltd 'H' | 43.674 | 0,03 | 9 | Hermes International | 10.586 | 0,01 |
| 4.400 | GoerTek Inc 'A' | 26.851 | 0,02 | 476 | Kering SA | 256.844 | 0,18 |
| 4.500 | Great Wall Motor Co Ltd 'H' | 8.097 | 0,01 | 1.998 | Legrand SA | 173.754 | 0,12 |
| 3.200 | Guangzhou Tinci Materials Technology Co Ltd 'A' | 18.243 | 0,01 | 3.079 | L'Oreal SA | 1.085.332 | 0,75 |
| 1.000 | Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H' | 9.647 | 0,01 | 214 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 137.044 | 0,09 |
| 800 | Imeik Technology Development Co Ltd 'A' | 64.833 | 0,04 | 1.488 | Pernod Ricard SA | 291.865 | 0,20 |
| 1.200 | Joinn Laboratories China Co Ltd 'H' | 9.573 | 0,01 | 11.823 | Rexel SA^ | 251.028 | 0,17 |
| 24.000 | Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'H' | 9.206 | 0,01 | 6.019 | Rubis SCA | 182.668 | 0,13 |
| 2.000 | NAURA Technology Group Co Ltd 'A' | 80.906 | 0,06 | 188 | Sartorius Stedim Biotech | 65.594 | 0,04 |
| 80.000 | PetroChina Co Ltd 'H' | 42.920 | 0,03 | 3.177 | Societe Generale SA | 85.288 | 0,06 |
| 1.500 | Pharmaron Beijing Co Ltd 'A' | 26.805 | 0,02 | 213 | Teleperformance | 70.507 | 0,05 |
| 40.500 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 259.604 | 0,18 | 1.145 | Thales SA | 140.750 | 0,10 |
| 1.500 | SG Micro Corp 'A' | 64.597 | 0,04 | | | 3.469.890 | 2,39 |
| 104.300 | Shandong Nanshan Aluminum Co Ltd 'A' | 55.475 | 0,04 | Deutschland | | | |
| 1.884 | Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd 'A' | 23.846 | 0,02 | 4.950 | Allianz SE Reg | 1.032.857 | 0,71 |
| 2.200 | Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd 'H' | 13.457 | 0,01 | 2.282 | BASF SE | 124.919 | 0,09 |
| 4.100 | Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd 'A' | 78.997 | 0,05 | 3.615 | Bayer AG Reg^ | 257.410 | 0,18 |
| 4.676 | Shenzhen Capchem Technology Co Ltd 'A' | 28.164 | 0,02 | 8.367 | Bayerische Motoren Werke AG | 720.727 | 0,50 |
| 1.100 | Shenzhen Kangtai Biological Products Co Ltd 'A' | 10.266 | 0,01 | 9.559 | Commerzbank AG | 82.392 | 0,06 |
| 1.267 | Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd 'A' | 57.424 | 0,04 | 6.838 | Deutsche Bank AG Reg | 76.636 | 0,05 |
| 900 | StarPower Semiconductor Ltd 'A' | 51.375 | 0,03 | 546 | DWS Group GmbH & Co KGaA | 19.536 | 0,01 |
| 4.877 | Wuhu Sanqi Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd 'A' | 15.827 | 0,01 | 11.891 | E.ON SE | 120.707 | 0,08 |
| 1.600 | WuXi AppTec Co Ltd 'A' | 22.848 | 0,02 | 4.304 | Evonik Industries AG | 115.036 | 0,08 |
| 13.140 | WuXi AppTec Co Ltd 'H' | 162.175 | 0,11 | 2.406 | Freenet AG | 62.863 | 0,04 |
| 65.600 | Zijin Mining Group Co Ltd 'A' | 98.876 | 0,07 | 303 | FUCHS PETROLUB SE (Pref)^ | 9.433 | 0,01 |
| 38.000 | Zijin Mining Group Co Ltd 'H' | 51.621 | 0,04 | 453 | HeidelbergCement AG | 26.059 | 0,02 |
| | | 2.644.875 | 1,82 | 416 | HOCHTIEF AG | 27.175 | 0,02 |
| | | | | 1.134 | K+S AG Reg | 31.852 | 0,02 |
| | | | | 3.098 | Mercedes-Benz Group AG^ | 218.704 | 0,15 |
| | | | | 56 | Merck KGaA | 10.441 | 0,01 |
| | | | | 29 | Rational AG | 18.873 | 0,01 |
| | | | | 940 | Rheinmetall AG | 192.131 | 0,13 |
| | | | | 149 | Sartorius AG (Pref) | 59.904 | 0,04 |
| | | | | 987 | Scout24 AG | 60.733 | 0,04 |
| | | | | 8.133 | Siemens AG Reg | 1.073.377 | 0,74 |
| | | | | 8.002 | Telefonica Deutschland Holding AG | 25.185 | 0,02 |
| | | | | | | 4.366.950 | 3,01 |
| | | | | Hongkong | | | |
| | | | | 68.800 | AIA Group Ltd | 709.292 | 0,49 |
| | | | | 32.500 | BOC Hong Kong Holdings Ltd^ | 124.870 | 0,09 |
| | | | | 10.000 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd | 10.705 | 0,01 |
| | | | | 831 | I-CABLE Communications Ltd | 4 | 0,00 |
| | | | | 126.000 | Lenovo Group Ltd | 124.280 | 0,08 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|-----------------------------|--|------------------------|--------------------|--------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 2.100 | Link (REIT) | 19.014 | 0,01 | 200 | Daikin Industries Ltd | 32.128 | 0,02 |
| 2.000 | Swire Pacific Ltd 'A' | 12.157 | 0,01 | 300 | Ebara Corp | 12.931 | 0,01 |
| 15.000 | Swire Properties Ltd | 36.701 | 0,02 | 300 | Eisai Co Ltd | 12.344 | 0,01 |
| 4.000 | Techtronic Industries Co Ltd | 52.401 | 0,04 | 200 | Hamamatsu Photonics KK | 9.366 | 0,01 |
| | | 1.089.424 | 0,75 | 2.200 | Hoya Corp | 235.949 | 0,16 |
| Ungarn | | | | 1.800 | ITOCHU Corp | 51.652 | 0,04 |
| 6.136 | MOL Hungarian Oil & Gas Plc | 43.533 | 0,03 | 33.100 | Japan Tobacco Inc | 601.643 | 0,41 |
| 929 | OTP Bank Nyrt | 22.502 | 0,02 | 1.700 | JGC Holdings Corp | 23.883 | 0,02 |
| | | 66.035 | 0,05 | 2.200 | Konica Minolta Inc | 7.381 | 0,00 |
| Indien | | | | 1.200 | Kuraray Co Ltd [^] | 10.018 | 0,01 |
| 5 | Housing Development Finance Corp Ltd | 148 | 0,00 | 300 | Kyocera Corp | 16.931 | 0,01 |
| | | 148 | 0,00 | 4.400 | Mitsubishi Corp | 151.479 | 0,10 |
| Indonesien | | | | 2.200 | Mitsubishi Electric Corp | 24.193 | 0,02 |
| 105.900 | Perusahaan Gas Negara Tbk PT | 13.073 | 0,01 | 4.500 | Mitsui & Co Ltd | 112.950 | 0,08 |
| | | 13.073 | 0,01 | 1.100 | Murata Manufacturing Co Ltd | 70.904 | 0,05 |
| Irland | | | | 1.100 | NGK Spark Plug Co Ltd | 20.870 | 0,01 |
| 334 | Accenture Plc 'A' | 100.257 | 0,07 | 500 | Nihon Kohden Corp | 11.882 | 0,01 |
| 1.779 | Alkermes Plc | 53.904 | 0,04 | 8.000 | Nikon Corp | 99.717 | 0,07 |
| 644 | Eaton Corp Plc | 88.460 | 0,06 | 4.400 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | 133.642 | 0,09 |
| 207 | Flutter Entertainment Plc | 25.199 | 0,02 | 100 | Nissin Foods Holdings Co Ltd | 6.539 | 0,00 |
| 9.569 | James Hardie Industries Plc - CDI | 247.975 | 0,17 | 2.400 | Nomura Research Institute Ltd | 66.167 | 0,05 |
| 1.388 | Kingspan Group Plc | 114.639 | 0,08 | 4.400 | Olympus Corp | 91.937 | 0,06 |
| 5.418 | Linde Plc | 1.755.919 | 1,21 | 3.200 | Omron Corp | 184.547 | 0,13 |
| 12.985 | Medtronic Plc | 1.296.033 | 0,89 | 10.300 | Recruit Holdings Co Ltd | 378.676 | 0,26 |
| | | 3.682.386 | 2,54 | 1.200 | Sega Sammy Holdings Inc | 22.329 | 0,01 |
| Israel | | | | 1.400 | Shin-Etsu Chemical Co Ltd [^] | 199.348 | 0,14 |
| 45.860 | Bank Hapoalim BM | 429.214 | 0,30 | 6.800 | SoftBank Corp | 78.158 | 0,05 |
| 8.280 | Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd | 12.709 | 0,01 | 3.000 | SoftBank Group Corp [^] | 125.321 | 0,09 |
| 3.985 | Check Point Software Technologies Ltd | 499.161 | 0,34 | 1.900 | Sony Corp | 178.764 | 0,12 |
| 25.535 | Israel Discount Bank Ltd 'A' | 143.454 | 0,10 | 900 | Subaru Corp | 15.569 | 0,01 |
| 6.444 | Teva Pharmaceutical Industries Ltd | 57.258 | 0,04 | 186.600 | Sumitomo Chemical Co Ltd [^] | 769.500 | 0,53 |
| 21.685 | Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR | 193.430 | 0,13 | 15.300 | Sumitomo Corp | 219.819 | 0,15 |
| 1.674 | Tower Semiconductor Ltd | 81.448 | 0,06 | 2.200 | Suntory Beverage & Food Ltd | 82.266 | 0,06 |
| | | 1.416.674 | 0,98 | 600 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | 17.255 | 0,01 |
| Italien | | | | 6.100 | Terumo Corp [^] | 197.546 | 0,14 |
| 717 | Banca Generali SpA | 24.917 | 0,02 | 200 | Tokio Marine Holdings Inc [^] | 11.596 | 0,01 |
| 2.320 | Banca Mediolanum SpA | 18.187 | 0,01 | 2.200 | Tokyo Electron Ltd [^] | 1.007.696 | 0,69 |
| 25.700 | BPER Banca | 52.736 | 0,04 | 1.000 | Toshiba Corp | 44.810 | 0,03 |
| 434 | Buzzi Unicem SpA [^] | 8.397 | 0,00 | 700 | Tosoh Corp | 10.193 | 0,01 |
| 42.545 | Enel SpA | 276.238 | 0,19 | 1.200 | Unicharm Corp | 41.210 | 0,03 |
| 3.192 | Italgas SpA | 20.431 | 0,01 | 7.200 | Yamada Holdings Co Ltd [^] | 25.386 | 0,02 |
| 7.952 | Leonardo SpA | 85.910 | 0,06 | | | 5.703.228 | 3,93 |
| 2.693 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA [^] | 27.447 | 0,02 | Jersey | | | |
| 1.832 | Moncler SpA | 87.548 | 0,06 | 4.652 | Experian Plc | 155.722 | 0,11 |
| 1.600 | PRADA SpA | 9.879 | 0,01 | 98 | Ferguson Plc | 11.821 | 0,01 |
| 16.884 | UniCredit SpA | 195.918 | 0,13 | 747 | WPP Plc | 8.646 | 0,00 |
| 10.378 | Unipol Gruppo SpA | 55.320 | 0,04 | | | 176.189 | 0,12 |
| | | 862.928 | 0,59 | Luxemburg | | | |
| Japan | | | | 2.182 | RTL Group SA [^] | 100.932 | 0,07 |
| 400 | Advantest Corp [^] | 27.647 | 0,02 | | | 100.932 | 0,07 |
| 6.600 | Amada Co Ltd | 52.999 | 0,04 | Malaysia | | | |
| 1.400 | Calbee Inc | 25.898 | 0,02 | 28.000 | CIMB Group Holdings Bhd | 32.934 | 0,02 |
| 2.300 | Casio Computer Co Ltd | 21.059 | 0,01 | 56.900 | Dialog Group Bhd | 31.579 | 0,02 |
| 4.500 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | 123.294 | 0,08 | 7.700 | Hong Leong Bank Bhd | 37.106 | 0,03 |
| 600 | Daifuku Co Ltd | 37.836 | 0,03 | 96.200 | IHH Healthcare Bhd | 147.206 | 0,10 |
| | | | | 26.800 | Inari Amertron Bhd | 17.199 | 0,01 |
| | | | | 1.700 | Kuala Lumpur Kepong Bhd | 9.924 | 0,01 |
| | | | | 61.700 | Maxis Bhd | 53.407 | 0,04 |
| | | | | 24.300 | MISC Bhd | 39.792 | 0,03 |
| | | | | 2.500 | Petronas Chemicals Group Bhd | 5.858 | 0,00 |
| | | | | 132.800 | Press Metal Aluminium Holdings Bhd | 168.028 | 0,12 |
| | | | | 75.400 | Public Bank Bhd | 81.453 | 0,06 |
| | | | | 88.200 | RHB Bank Bhd | 122.475 | 0,08 |
| | | | | 28.200 | Sime Darby Bhd | 14.105 | 0,01 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|-----------------------------|--|------------------------|--------------------|------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Malaysia Fortsetzung | | | | Südafrika Fortsetzung | | | |
| 4.800 | Tenaga Nasional Bhd | 10.031 | 0,01 | 15.281 | FirstRand Ltd | 70.514 | 0,05 |
| 10.100 | Westports Holdings Bhd | 7.958 | 0,00 | 13.138 | Foschini Group Ltd | 118.643 | 0,08 |
| | | 779.055 | 0,54 | 4.006 | Gold Fields Ltd | 39.799 | 0,03 |
| Mauritius | | | | 2.003 | Naspers Ltd 'N' | 218.871 | 0,15 |
| 520 | Azure Power Global Ltd | 7.899 | 0,01 | 10.209 | Pepkor Holdings Ltd | 14.228 | 0,01 |
| | | 7.899 | 0,01 | 6.663 | Sanlam Ltd | 28.993 | 0,02 |
| Mexiko | | | | 14.097 | Standard Bank Group Ltd | 160.302 | 0,11 |
| 8.888 | Arca Continental SAB de CV | 60.071 | 0,04 | 6.656 | Truworths International Ltd | 23.088 | 0,02 |
| 2.762 | Coca-Cola Femsa SAB de CV (Unit) | 16.174 | 0,01 | 13.243 | Woolworths Holdings Ltd | 46.420 | 0,03 |
| 2.458 | Fomento Economico Mexicano SAB de CV (Unit) | 18.277 | 0,01 | | | 755.490 | 0,52 |
| 22.317 | Grupo Bimbo SAB de CV 'A' | 69.077 | 0,05 | Südkorea | | | |
| 12.190 | Grupo Financiero Banorte SAB de CV 'O' | 78.776 | 0,06 | 85 | AfreecaTV Co Ltd | 7.372 | 0,00 |
| | | 242.375 | 0,17 | 462 | Celltrion Inc | 59.935 | 0,04 |
| Niederlande | | | | 99 | Hugel Inc | 9.954 | 0,01 |
| 2.172 | ASML Holding NV | 1.256.680 | 0,86 | 247 | Hyundai Mobis Co Ltd | 43.622 | 0,03 |
| 3.219 | ASR Nederland NV* | 146.486 | 0,10 | 1.225 | Kakao Corp | 84.162 | 0,06 |
| 1.326 | Heineken NV | 133.383 | 0,09 | 1.813 | Korea Gas Corp | 64.991 | 0,04 |
| 744 | IMCD NV* | 111.581 | 0,08 | 95 | Korea Zinc Co Ltd | 45.688 | 0,03 |
| 972 | NXP Semiconductors NV | 185.681 | 0,13 | 776 | LG Chem Ltd | 366.925 | 0,25 |
| 718 | OCI NV | 25.028 | 0,02 | 149 | LG Electronics Inc | 12.645 | 0,01 |
| 6.792 | Randstad NV* | 383.878 | 0,26 | 13 | LG Household & Health Care Ltd | 7.713 | 0,01 |
| 1.157 | Stellantis NV | 17.137 | 0,01 | 1.100 | NAVER Corp | 256.062 | 0,18 |
| 4.653 | Wolters Kluwer NV | 460.072 | 0,32 | 23 | NCSOFT Corp | 8.459 | 0,01 |
| | | 2.719.926 | 1,87 | 769 | POSCO Holdings Inc | 179.632 | 0,12 |
| Neuseeland | | | | 305 | Samsung Electro-Mechanics Co Ltd | 38.088 | 0,03 |
| 2.157 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | 29.477 | 0,02 | 5.429 | Samsung Electronics Co Ltd | 295.760 | 0,20 |
| 2.351 | Fletcher Building Ltd | 8.292 | 0,01 | 695 | Samsung Engineering Co Ltd | 13.791 | 0,01 |
| | | 37.769 | 0,03 | 383 | SK Innovation Co Ltd | 66.712 | 0,05 |
| Norwegen | | | | 664 | S-Oil Corp | 62.257 | 0,04 |
| 31.691 | Equinor ASA | 1.222.566 | 0,84 | | | 1.623.768 | 1,12 |
| 1.023 | Mowi ASA | 26.364 | 0,02 | Spanien | | | |
| 2.957 | Telenor ASA | 40.520 | 0,03 | 5.294 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | 28.719 | 0,02 |
| | | 1.289.450 | 0,89 | 23.259 | Banco de Sabadell SA | 20.840 | 0,02 |
| Portugal | | | | 170.126 | Banco Santander SA | 550.661 | 0,38 |
| 11.499 | Jeronimo Martins SGPS SA* | 235.033 | 0,16 | 14.692 | Industria de Diseno Textil SA | 351.762 | 0,24 |
| | | 235.033 | 0,16 | | | 951.982 | 0,66 |
| Russland | | | | Schweden | | | |
| 7.513 | Alrosa PJSC* | 1 | 0,00 | 10.036 | Atlas Copco AB 'A' | 114.469 | 0,08 |
| 11.202 | Gazprom PJSC* | 2 | 0,00 | 6.475 | Elektro AB 'B' | 50.765 | 0,04 |
| 1.201 | LUKOIL PJSC* | — | 0,00 | 653 | Epiroc AB 'A' | 12.653 | 0,01 |
| 181 | MMC Norilsk Nickel PJSC* | — | 0,00 | 635 | Indutrade AB | 14.425 | 0,01 |
| 130 | Novatek PJSC GDR* | 1 | 0,00 | 10.376 | Saab AB 'B' | 442.244 | 0,30 |
| 4.078 | Tatneft PJSC* | 1 | 0,00 | 40.992 | Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | 334.990 | 0,23 |
| | | 5 | 0,00 | 174 | Trelleborg AB 'B' | 4.064 | 0,00 |
| | | | | | | 973.610 | 0,67 |
| Saudi-Arabien | | | | Schweiz | | | |
| 1.315 | ACWA Power Co | 54.767 | 0,04 | 38 | Belimo Holding AG Reg | 15.228 | 0,01 |
| 682 | Saudi Arabian Mining Co | 11.838 | 0,01 | 5 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | 49.766 | 0,03 |
| | | 66.605 | 0,05 | 2.669 | Cie Financiere Richemont SA 'A' Reg | 293.465 | 0,20 |
| Singapur | | | | 2.224 | Garmin Ltd | 231.763 | 0,16 |
| 556 | CDL Hospitality Trusts (Unit) | 507 | 0,00 | 69 | Lonza Group AG Reg | 41.609 | 0,03 |
| 1.700 | City Developments Ltd | 10.242 | 0,01 | 1.079 | Nestle SA Reg | 131.504 | 0,09 |
| 4.200 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | 36.241 | 0,02 | 1.119 | Novartis AG Reg* | 101.066 | 0,07 |
| 2.700 | United Overseas Bank Ltd | 58.116 | 0,04 | 4.725 | On Holding AG 'A' | 99.509 | 0,07 |
| | | 105.106 | 0,07 | 107 | PSP Swiss Property AG Reg | 12.824 | 0,01 |
| Südafrika | | | | 311 | Sika AG Reg | 86.477 | 0,06 |
| 1.701 | AngloGold Ashanti Ltd | 30.296 | 0,02 | 423 | Straumann Holding AG Reg | 54.137 | 0,04 |
| 1.031 | AVI Ltd | 4.336 | 0,00 | 461 | Swatch Group AG* | 116.799 | 0,08 |
| | | | | 1.149 | TE Connectivity Ltd | 147.945 | 0,10 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|----------------------------|--|------------------------|--------------------|---------------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Schweiz Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| 9.872 | UBS Group AG Reg | 186.122 | 0,13 | 17.962 | Lloyds Banking Group Plc | 10.135 | 0,01 |
| 154 | VAT Group AG [^] | 45.871 | 0,03 | 9.990 | Marks & Spencer Group Plc | 18.734 | 0,01 |
| | | 1.614.085 | 1,11 | 3.576 | RELX Plc | 102.372 | 0,07 |
| Taiwan | | | | 26.333 | Rentokil Initial Plc [^] | 168.074 | 0,12 |
| 1.000 | ASE Technology Holding Co Ltd | 3.600 | 0,00 | 30.474 | Rightmove Plc | 229.799 | 0,16 |
| 24.000 | CTBC Financial Holding Co Ltd | 22.450 | 0,02 | 252 | Rio Tinto Plc | 18.432 | 0,01 |
| 15.000 | Delta Electronics Inc | 124.806 | 0,09 | 7.306 | Shell Plc | 221.522 | 0,15 |
| 34.000 | Eva Airways Corp | 39.945 | 0,03 | 966 | Spectris Plc [^] | 36.714 | 0,02 |
| 16.000 | Faraday Technology Corp | 132.575 | 0,09 | 1.945 | SSE Plc | 43.242 | 0,03 |
| 3.000 | Global Unichip Corp | 57.158 | 0,04 | 2.016 | Unilever Plc | 95.758 | 0,07 |
| 6.000 | Kinsus Interconnect Technology Corp | 36.176 | 0,02 | | | 3.010.213 | 2,07 |
| 15.000 | MediaTek Inc | 467.700 | 0,32 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 1.300 | momo.com Inc | 37.399 | 0,03 | 11.764 | Abbott Laboratories | 1.356.036 | 0,93 |
| 2.000 | Nan Ya Printed Circuit Board Corp | 27.183 | 0,02 | 4.616 | AbbVie Inc | 681.229 | 0,47 |
| 9.000 | Nanya Technology Corp | 20.713 | 0,01 | 1.736 | Adobe Inc | 724.016 | 0,50 |
| 3.000 | Novatek Microelectronics Corp | 41.964 | 0,03 | 957 | Advanced Micro Devices Inc | 97.059 | 0,07 |
| 1.000 | Pegavision Corp | 15.211 | 0,01 | 292 | Aflac Inc | 17.441 | 0,01 |
| 18.000 | Realtek Semiconductor Corp | 275.969 | 0,19 | 9.820 | Agilent Technologies Inc | 1.268.155 | 0,87 |
| 19.000 | TA Chen Stainless Pipe | 28.410 | 0,02 | 276 | Allstate Corp | 37.246 | 0,03 |
| 85.000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 1.639.966 | 1,13 | 902 | Alphabet Inc 'A' | 2.029.617 | 1,40 |
| 10 | Tung Ho Steel Enterprise Corp | 22 | 0,00 | 958 | Alphabet Inc 'C' | 2.162.187 | 1,49 |
| 1.000 | Unimicron Technology Corp | 7.425 | 0,00 | 7.018 | Altria Group Inc | 377.218 | 0,26 |
| 81.000 | Uni-President Enterprises Corp | 188.093 | 0,13 | 662 | Amazon.com Inc | 1.546.518 | 1,07 |
| 3.000 | Vanguard International Semiconductor Corp | 11.059 | 0,01 | 1.625 | Ameren Corp | 154.521 | 0,11 |
| | | 3.177.824 | 2,19 | 168 | American Electric Power Co Inc [^] | 17.097 | 0,01 |
| Thailand | | | | 2.681 | American Express Co | 453.813 | 0,31 |
| 43.300 | Energy Absolute PCL NVDR | 113.565 | 0,08 | 5.800 | American Homes 4 Rent 'A' (REIT) | 218.254 | 0,15 |
| 4.700 | JMT Network Services PCL | 10.644 | 0,01 | 376 | American Tower Corp (REIT) | 96.933 | 0,07 |
| 5.600 | JMT Network Services PCL NVDR | 12.683 | 0,01 | 232 | Ameriprise Financial Inc | 64.002 | 0,04 |
| 22.100 | Precious Shipping PCL NVDR | 12.787 | 0,01 | 169 | AmerisourceBergen Corp | 26.104 | 0,02 |
| 10.200 | PTT Exploration & Production PCL NVDR [^] | 50.523 | 0,03 | 361 | AMETEK Inc | 43.349 | 0,03 |
| | | 200.202 | 0,14 | 1.647 | Amgen Inc | 413.941 | 0,29 |
| Türkei | | | | 2.991 | Amphenol Corp 'A' | 210.746 | 0,15 |
| 11.056 | Arcelik AS | 52.197 | 0,04 | 1.167 | APA Corp | 57.405 | 0,04 |
| 47.406 | Kardemir Karabuk Demir Celik Sanayi ve Ticaret AS 'D' | 42.563 | 0,03 | 40.373 | Apple Inc | 5.971.570 | 4,12 |
| 31.643 | KOC Holding AS | 80.499 | 0,06 | 1.117 | Applied Materials Inc | 130.717 | 0,09 |
| 3.944 | Migros Ticaret AS | 10.674 | 0,01 | 539 | AT&T Inc | 11.435 | 0,01 |
| 9.232 | Sok Marketler Ticaret AS | 7.511 | 0,00 | 238 | Atmos Energy Corp | 27.589 | 0,02 |
| 13.477 | Turk Telekomunikasyon AS | 7.930 | 0,00 | 91 | Automatic Data Processing Inc | 20.286 | 0,01 |
| 103.681 | Turkcell Iletisim Hizmetleri AS | 123.275 | 0,08 | 871 | AvalonBay Communities Inc (REIT) | 181.804 | 0,13 |
| 2.256 | Türkiye Petrol Rafinerileri AS | 37.605 | 0,03 | 51.859 | Bank of America Corp | 1.928.636 | 1,33 |
| | | 362.254 | 0,25 | 2.539 | Bank of New York Mellon Corp | 117.099 | 0,08 |
| Großbritannien | | | | 1.639 | Berkshire Hathaway Inc 'B' | 517.891 | 0,36 |
| 395 | Anglo American Plc | 19.321 | 0,01 | 717 | Biogen Inc | 145.006 | 0,10 |
| 2.371 | Bellway Plc | 69.577 | 0,05 | 691 | BioMarin Pharmaceutical Inc | 53.103 | 0,04 |
| 74.373 | BP Plc | 410.700 | 0,28 | 818 | Black Hills Corp [^] | 62.446 | 0,04 |
| 5.369 | British American Tobacco Plc | 237.512 | 0,16 | 5.121 | Boeing Co [^] | 666.242 | 0,46 |
| 66.243 | Centrica Plc | 65.881 | 0,04 | 226 | Booking Holdings Inc | 502.398 | 0,35 |
| 13.282 | Diageo Plc | 613.149 | 0,42 | 593 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | 50.583 | 0,03 |
| 7.884 | GlaxoSmithKline Plc | 171.427 | 0,12 | 16.449 | Boston Scientific Corp | 674.574 | 0,46 |
| 11.869 | HomeServe Plc | 173.924 | 0,12 | 3.621 | Brighthouse Financial Inc | 177.574 | 0,12 |
| 4.704 | IG Group Holdings Plc | 42.341 | 0,03 | 1.882 | Bristol-Myers Squibb Co [^] | 139.663 | 0,10 |
| 1.313 | Imperial Brands Plc | 29.488 | 0,02 | 5.852 | Brown-Forman Corp 'B' | 384.476 | 0,26 |
| 9.037 | ITV Plc | 7.934 | 0,01 | 1.352 | Cadence Design Systems Inc | 207.032 | 0,14 |
| 4.670 | Johnson Matthey Plc | 125.106 | 0,09 | 526 | Camden Property Trust (REIT) | 75.602 | 0,05 |
| 26.832 | Kingfisher Plc | 88.737 | 0,06 | 1.731 | Capital One Financial Corp | 220.114 | 0,15 |
| 3.139 | Legal & General Group Plc | 10.334 | 0,01 | 186 | Cardinal Health Inc | 10.463 | 0,01 |
| | | | | 6.071 | Charles Schwab Corp | 426.609 | 0,29 |
| | | | | 573 | Charter Communications Inc 'A' | 290.316 | 0,20 |
| | | | | 3.872 | Chevron Corp | 698.276 | 0,48 |
| | | | | 2.400 | Cigna Corp | 648.672 | 0,45 |
| | | | | 8.955 | Cisco Systems Inc | 402.259 | 0,28 |
| | | | | 14.953 | Citigroup Inc | 801.032 | 0,55 |
| | | | | 684 | CMS Energy Corp | 48.318 | 0,03 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 5.396 | Coca-Cola Co | 340.865 | 0,23 | 218 | Masimo Corp | 31.272 | 0,02 |
| 2.316 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | 171.546 | 0,12 | 1.433 | Mastercard Inc 'A' | 510.836 | 0,35 |
| 3.195 | Colgate-Palmolive Co | 249.434 | 0,17 | 61 | McKesson Corp | 20.029 | 0,01 |
| 33.930 | Comcast Corp 'A' | 1.485.795 | 1,02 | 17.254 | Merck & Co Inc | 1.570.804 | 1,08 |
| 1.349 | Continental Resources Inc | 95.293 | 0,07 | 5.991 | Meta Platforms Inc 'A' | 1.161.116 | 0,80 |
| 3.954 | Corteva Inc^ | 250.486 | 0,17 | 20.801 | MetLife Inc | 1.397.411 | 0,96 |
| 2.929 | Costco Wholesale Corp | 1.350.386 | 0,93 | 176 | Mettler-Toledo International Inc^ | 230.009 | 0,16 |
| 3.331 | Crown Castle International Corp (REIT) | 633.123 | 0,44 | 21.724 | Microsoft Corp | 5.883.945 | 4,05 |
| 9.105 | CubeSmart (REIT) | 408.541 | 0,28 | 943 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | 171.551 | 0,12 |
| 2.400 | Danaher Corp | 628.776 | 0,43 | 299 | Moderna Inc | 43.911 | 0,03 |
| 7.008 | Dell Technologies Inc 'C' | 341.710 | 0,24 | 408 | Monolithic Power Systems Inc | 182.188 | 0,13 |
| 193 | Dick's Sporting Goods Inc | 15.687 | 0,01 | 860 | Moody's Corp | 259.668 | 0,18 |
| 1.584 | Discover Financial Services | 177.693 | 0,12 | 1.027 | Mosaic Co | 63.951 | 0,04 |
| 3.070 | Dominion Energy Inc | 258.801 | 0,18 | 1.339 | MP Materials Corp | 53.453 | 0,04 |
| 1.044 | DTE Energy Co | 138.340 | 0,10 | 822 | NetApp Inc | 59.126 | 0,04 |
| 574 | East West Bancorp Inc | 41.661 | 0,03 | 4.171 | NextEra Energy Inc | 318.393 | 0,22 |
| 618 | eBay Inc | 29.565 | 0,02 | 352 | Norfolk Southern Corp | 84.586 | 0,06 |
| 269 | Ecolab Inc | 43.704 | 0,03 | 441 | NRG Energy Inc^ | 20.326 | 0,01 |
| 643 | Edison International^ | 44.508 | 0,03 | 6.945 | NVIDIA Corp | 1.289.061 | 0,89 |
| 1.157 | Edwards Lifesciences Corp | 115.561 | 0,08 | 531 | OGE Energy Corp | 21.840 | 0,01 |
| 2.519 | Eli Lilly & Co | 787.364 | 0,54 | 287 | Ovintiv Inc | 16.621 | 0,01 |
| 9.660 | Energy Corp | 1.154.853 | 0,80 | 315 | Palo Alto Networks Inc | 158.546 | 0,11 |
| 7.259 | EOG Resources Inc | 1.016.115 | 0,70 | 735 | Paychex Inc^ | 90.118 | 0,06 |
| 133 | EPAM Systems Inc | 43.030 | 0,03 | 516 | Paycom Software Inc | 147.829 | 0,10 |
| 3.688 | Equity Residential (REIT) | 285.414 | 0,20 | 2.644 | PayPal Holdings Inc | 222.122 | 0,15 |
| 544 | Estee Lauder Cos Inc 'A' | 138.840 | 0,10 | 1.457 | PepsiCo Inc | 241.279 | 0,17 |
| 484 | Exelixis Inc | 8.852 | 0,01 | 19.148 | Pfizer Inc | 997.036 | 0,69 |
| 337 | Expedia Group Inc | 43.251 | 0,03 | 10.833 | Philip Morris International Inc | 1.143.748 | 0,79 |
| 1.957 | Expeditors International of Washington Inc | 211.043 | 0,15 | 3.257 | Phillips 66 | 336.416 | 0,23 |
| 21.391 | Exxon Mobil Corp | 2.118.992 | 1,46 | 446 | Pinnacle West Capital Corp^ | 34.610 | 0,02 |
| 522 | FactSet Research Systems Inc | 199.691 | 0,14 | 2.953 | PNC Financial Services Group Inc | 514.531 | 0,35 |
| 147 | Fortinet Inc | 42.970 | 0,03 | 505 | Portland General Electric Co | 24.306 | 0,02 |
| 3.737 | Fox Corp 'A' | 132.290 | 0,09 | 1 | PotlatchDeltic Corp (REIT) | 53 | 0,00 |
| 389 | Freeport-McMoRan Inc^ | 15.478 | 0,01 | 409 | Power Integrations Inc | 34.356 | 0,02 |
| 771 | Gartner Inc | 202.095 | 0,14 | 523 | Principal Financial Group Inc | 37.891 | 0,03 |
| 4.063 | Gilead Sciences Inc | 259.626 | 0,18 | 1.878 | Prologis Inc (REIT) | 237.267 | 0,16 |
| 627 | Global Payments Inc | 81.817 | 0,06 | 4.296 | Public Service Enterprise Group Inc | 293.288 | 0,20 |
| 2.469 | Hartford Financial Services Group Inc | 177.570 | 0,12 | 3.977 | QUALCOMM Inc | 550.337 | 0,38 |
| 1.037 | HEICO Corp | 146.725 | 0,10 | 230 | Ralph Lauren Corp | 22.641 | 0,02 |
| 2.554 | HEICO Corp 'A' | 296.545 | 0,20 | 140 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | 95.117 | 0,07 |
| 8.004 | Hewlett Packard Enterprise Co | 124.862 | 0,09 | 397 | Reinsurance Group of America Inc | 49.847 | 0,03 |
| 313 | Highwoods Properties Inc (REIT) | 12.245 | 0,01 | 421 | Reliance Steel & Aluminum Co | 84.604 | 0,06 |
| 3.768 | Home Depot Inc | 1.139.556 | 0,79 | 2.384 | Republic Services Inc | 321.149 | 0,22 |
| 6.665 | Honeywell International Inc | 1.283.946 | 0,88 | 60 | Roper Technologies Inc | 26.398 | 0,02 |
| 6.460 | HP Inc^ | 249.421 | 0,17 | 1.595 | S&P Global Inc | 564.869 | 0,39 |
| 332 | Humana Inc | 151.917 | 0,10 | 2.981 | salesforce.com Inc | 478.629 | 0,33 |
| 1.058 | Huntington Ingalls Industries Inc | 222.688 | 0,15 | 102 | Sempra Energy | 16.813 | 0,01 |
| 401 | IDACORP Inc | 43.304 | 0,03 | 718 | Semtech Corp | 45.414 | 0,03 |
| 436 | IDEXX Laboratories Inc | 171.431 | 0,12 | 757 | ServiceNow Inc | 356.146 | 0,25 |
| 87 | Illinois Tool Works Inc | 17.738 | 0,01 | 2.907 | Simon Property Group Inc (REIT) | 330.875 | 0,23 |
| 281 | Incyte Corp | 21.232 | 0,01 | 63.562 | Sirius XM Holdings Inc^ | 404.254 | 0,28 |
| 24.996 | Intel Corp | 1.097.199 | 0,76 | 334 | SiteOne Landscape Supply Inc^ | 44.472 | 0,03 |
| 329 | Intercontinental Exchange Inc | 33.597 | 0,02 | 1.721 | Snap-on Inc^ | 379.601 | 0,26 |
| 1.234 | Intuit Inc | 519.514 | 0,36 | 8.363 | Southern Co | 631.574 | 0,44 |
| 3.039 | Invitation Homes Inc (REIT) | 115.907 | 0,08 | 2.577 | Stifel Financial Corp | 164.722 | 0,11 |
| 13.673 | Johnson & Johnson | 2.407.132 | 1,66 | 169 | Stryker Corp | 39.363 | 0,03 |
| 17.440 | JPMorgan Chase & Co | 2.292.488 | 1,58 | 119 | Synchrony Financial | 4.326 | 0,00 |
| 2.606 | Keysight Technologies Inc | 378.365 | 0,26 | 91 | Teradyne Inc | 9.805 | 0,01 |
| 367 | KLA Corp | 132.436 | 0,09 | 418 | Tesla Inc | 313.972 | 0,22 |
| 52 | Lam Research Corp | 26.778 | 0,02 | 2.960 | Texas Instruments Inc | 516.165 | 0,36 |
| 669 | Lennar Corp 'A' | 53.527 | 0,04 | 144 | Thermo Fisher Scientific Inc | 82.287 | 0,06 |
| 347 | Lincoln National Corp | 20.060 | 0,01 | 219 | TJX Cos Inc | 13.808 | 0,01 |
| 2.552 | Lowe's Cos Inc | 499.120 | 0,34 | 231 | Toll Brothers Inc | 11.596 | 0,01 |
| 1.363 | Manhattan Associates Inc | 164.378 | 0,11 | | | | |
| 1.161 | Marsh & McLennan Cos Inc | 184.553 | 0,13 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|-------------------------------|------------------------|--------------------|---|---------------------------------------|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | |
| 1.024 | Travel + Leisure Co | 51.876 | 0,04 | Frankreich | | | |
| 2.724 | Travelers Cos Inc | 480.977 | 0,33 | USD 81.090 | Lyxor ETF MSCI India USD [*] | 1.985.489 | 1,37 |
| 1.659 | Truist Financial Corp | 81.142 | 0,06 | <hr/> | | | |
| 918 | UDR Inc (REIT) | 43.991 | 0,03 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | | |
| 40 | Ulta Beauty Inc | 16.670 | 0,01 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| 5.278 | Union Pacific Corp | 1.166.385 | 0,80 | 143.511.591 98,90 | | | |
| 2.609 | United Parcel Service Inc 'B' | 468.524 | 0,32 | <hr/> | | | |
| 1.864 | UnitedHealth Group Inc | 936.250 | 0,64 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | |
| 898 | Unum Group | 32.579 | 0,02 | 143.511.591 98,90 | | | |
| 469 | Valero Energy Corp | 63.020 | 0,04 | <hr/> | | | |
| 3.621 | Verizon Communications Inc | 184.943 | 0,13 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | |
| 349 | Vertex Pharmaceuticals Inc | 93.626 | 0,06 | 1.595.135 1,10 | | | |
| 16.178 | Viatrix Inc | 195.268 | 0,13 | <hr/> | | | |
| 10.050 | Visa Inc 'A' | 2.132.510 | 1,47 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | | |
| 2.073 | Voya Financial Inc | 141.524 | 0,10 | 145.106.726 100,00 | | | |
| 394 | Walmart Inc [*] | 50.467 | 0,03 | <hr/> | | | |
| 434 | Walt Disney Co | 47.193 | 0,03 | [*] Wertpapier unter Vorbehalt einer Anpassung an die beizulegenden Zeitwerte gemäß Anmerkung 2 (a). | | | |
| 249 | Waste Management Inc | 39.494 | 0,03 | [^] Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |
| 9.987 | Wells Fargo & Co | 457.704 | 0,32 | <hr/> | | | |
| 2.412 | Workday Inc 'A' | 374.415 | 0,26 | | | | |
| 5.485 | Zoetis Inc | 932.340 | 0,64 | | | | |
| | | 84.645.277 | 58,33 | | | | |
| Gesamt Stammaktien und Vorzugsaktien | | 141.526.102 | 97,53 | | | | |

| Anzahl der Kontrakte | Vertrags- währung | Kontrakte/ Bezeichnung | Verfalls- datum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn USD |
|-------------------------------------|----------------------|---|--------------------|--|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| 4 | USD | E-Mini S&P 500 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 823.000 | 26.686 |
| 3 | USD | MSCI EAFE Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 305.520 | 13.297 |
| 3 | USD | MSCI Emerging Markets Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 160.710 | 6.479 |
| Gesamt | | | | | 46.462 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD |
|--|---------|---------|----------|--------------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 519.089 | USD | 550.418 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 5.992 |
| USD | 63.827 | EUR | 60.591 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (1.120) |
| | | | | | | 4.872 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 621.358) | | | | | | 4.872 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|----------------------------------|-----------------|
| Nicht zyklische Konsumgüter | 19,67 |
| Technologie | 18,50 |
| Finanzen | 16,84 |
| Kommunikation | 11,09 |
| Industrie | 9,17 |
| Energie | 6,80 |
| Zyklische Konsumgüter | 5,96 |
| Grundstoffe | 5,76 |
| Versorger | 3,64 |
| Fonds | 1,37 |
| Diversifiziert | 0,10 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 98,90 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 1,10 |
| <hr/> | |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|--|-----------------------|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| STAMMAKTIE & WARRANTS | | | | USD 2.000.000 United States Treasury Bill 2/8/2022 (Zero Coupon) 1.996.861 3,81 | | | |
| Kanada | | | | USD 2.000.000 United States Treasury Bill 4/8/2022 (Zero Coupon) 1.996.773 3,80 | | | |
| 3.494 | Bausch + Lomb Corp | 60.481 | 0,11 | <hr/> | | | |
| | | 60.481 | 0,11 | Gesamt Anleihen 49.272.331 93,88 | | | |
| Kaimaninseln | | | | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden 49.769.974 94,83 | | | |
| 18.000 | Hedosophia European Growth | 190.897 | 0,37 | <hr/> | | | |
| 6.000 | Hedosophia European Growth (Wts 13/5/2027) | 1.346 | 0,00 | Wertpapiervermögen zum Marktwert 49.769.974 94,83 | | | |
| | | 192.243 | 0,37 | <hr/> | | | |
| Niederlande | | | | Sonstiges Netto-Fondsvermögen 2.711.370 5,17 | | | |
| 10.022 | Azerion Group NV | 94.477 | 0,18 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) 52.481.344 100,00 | | | |
| 3.340 | Azerion Group NV (Wts 26/3/2026) | 1.968 | 0,00 | <hr/> | | | |
| 1.339 | Climate Transition Capital Acquisition I BV (Wts 29/6/2026) | 153 | 0,00 | | | | |
| 4.017 | Climate Transition Capital Acquisition I BV (Unit) | 41.311 | 0,08 | | | | |
| 9.928 | Pegasus Acquisition Co Europe BV (Unit) | 103.695 | 0,20 | | | | |
| | | 241.604 | 0,46 | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | | |
| 127 | Excelerate Energy Inc 'A' | 3.315 | 0,01 | | | | |
| | | 3.315 | 0,01 | | | | |
| Gesamt Stammaktien & Warrants | | 497.643 | 0,95 | | | | |
| ANLEIHEN | | | | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | | |
| USD 2.000.000 | United States Cash Management Bill 9/8/2022 (Zero Coupon) | 1.996.289 | 3,80 | | | | |
| USD 2.000.000 | United States Cash Management Bill 23/8/2022 (Zero Coupon) | 1.995.181 | 3,80 | | | | |
| USD 2.000.000 | United States Treasury Bill 2/6/2022 (Zero Coupon) | 1.999.985 | 3,81 | | | | |
| USD 5.000.000 | United States Treasury Bill 7/6/2022 (Zero Coupon) | 4.999.640 | 9,53 | | | | |
| USD 4.000.000 | United States Treasury Bill 9/6/2022 (Zero Coupon) | 3.999.651 | 7,62 | | | | |
| USD 9.100.000 | United States Treasury Bill 14/6/2022 (Zero Coupon) | 9.098.352 | 17,34 | | | | |
| USD 6.000.000 | United States Treasury Bill 21/6/2022 (Zero Coupon) | 5.998.285 | 11,43 | | | | |
| USD 5.000.000 | United States Treasury Bill 23/6/2022 (Zero Coupon) | 4.998.133 | 9,52 | | | | |
| USD 5.000.000 | United States Treasury Bill 28/6/2022 (Zero Coupon) | 4.997.606 | 9,52 | | | | |
| USD 1.200.000 | United States Treasury Bill 30/6/2022 (Zero Coupon) | 1.199.285 | 2,29 | | | | |
| USD 3.000.000 | United States Treasury Bill 12/7/2022 (Zero Coupon) | 2.997.386 | 5,71 | | | | |
| USD 1.000.000 | United States Treasury Bill 19/7/2022 (Zero Coupon) | 998.904 | 1,90 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|---|-----------------|---|-------------------------------|---|-----------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | 1.083 | Bank of Queensland Ltd | Morgan Stanley | (19) |
| | Australien | | | 1.412 | Bapcor Ltd | Bank of America | |
| 418 | 29Metals Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (45) |
| | | Merrill Lynch | 78 | 1.088 | Bapcor Ltd | Goldman Sachs | (39) |
| 711 | 29Metals Ltd | Goldman Sachs | 133 | (1.779) | Beach Energy Ltd | Bank of America | |
| 8.180 | a2 Milk Co Ltd | Bank of America | | (37.823) | Beach Energy Ltd | Goldman Sachs | (3.087) |
| | | Merrill Lynch | 3.710 | (24.853) | Beach Energy Ltd | Morgan Stanley | (1.873) |
| 4.331 | a2 Milk Co Ltd | Goldman Sachs | 2.083 | (3.895) | Bega Cheese Ltd | Bank of America | |
| 8.511 | a2 Milk Co Ltd | Morgan Stanley | 2.271 | | | Merrill Lynch | (21) |
| 3.175 | Abacus Property Group (REIT) | Bank of America | | (11.107) | Bega Cheese Ltd | Goldman Sachs | 80 |
| | | Merrill Lynch | (23) | (767) | Bellevue Gold Ltd | Goldman Sachs | (36) |
| 5.804 | Abacus Property Group (REIT) | | | (5.509) | Bendigo & Adelaide Bank Ltd | | |
| | | Goldman Sachs | (42) | | | Goldman Sachs | 8 |
| 545 | Accent Group Ltd | Bank of America | | 1.050 | BHP Group Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (18) | | | Merrill Lynch | (528) |
| (1.032) | Adbri Ltd | Bank of America | | 384 | BHP Group Ltd | Goldman Sachs | (89) |
| | | Merrill Lynch | (40) | 137 | BHP Group Ltd | Morgan Stanley | (317) |
| (12.624) | Adbri Ltd | Goldman Sachs | 725 | 10 | Blackmores Ltd ^{††} | Goldman Sachs | — |
| 2.227 | AGL Energy Ltd | Bank of America | | (1.458) | BlueScope Steel Ltd | Goldman Sachs | 124 |
| | | Merrill Lynch | 275 | 15.206 | Boral Ltd | Bank of America | |
| 3.532 | AGL Energy Ltd | Goldman Sachs | 696 | | | Merrill Lynch | (3.166) |
| 13.754 | AGL Energy Ltd | Morgan Stanley | 1.688 | 7.865 | Boral Ltd | Goldman Sachs | (1.637) |
| 601 | Alkane Resources Ltd | Goldman Sachs | 82 | 7.328 | Boral Ltd | Morgan Stanley | (105) |
| (2.867) | Allkem Ltd | Goldman Sachs | (4.692) | (14.946) | Bravura Solutions Ltd | Goldman Sachs | — |
| (8.413) | ALS Ltd | Goldman Sachs | (5.254) | 52 | Breville Group Ltd | Bank of America | |
| (1.288) | Altium Ltd | Goldman Sachs | (980) | | | Merrill Lynch | 46 |
| 5.150 | Alumina Ltd | Bank of America | | (1.283) | Brickworks Ltd | Goldman Sachs | 988 |
| | | Merrill Lynch | 259 | (243) | BWP Trust (REIT) | Goldman Sachs | (7) |
| 2.923 | Alumina Ltd | Goldman Sachs | 147 | (1.000) | BWX Ltd | Bank of America | |
| 50.999 | Alumina Ltd | Morgan Stanley | 915 | | | Merrill Lynch | (14) |
| (14.180) | AMP Ltd | Goldman Sachs | 25 | (12.336) | BWX Ltd | Goldman Sachs | (177) |
| (1.218) | Ampol Ltd | Goldman Sachs | 280 | 183 | carsales.com Ltd | Bank of America | |
| (1.344) | Ansell Ltd | Goldman Sachs | (154) | | | Merrill Lynch | 91 |
| (5.243) | APA Group (Unit) | Goldman Sachs | (226) | 742 | carsales.com Ltd | Goldman Sachs | 368 |
| (2.056) | Appen Ltd | Goldman Sachs | 708 | 1.273 | carsales.com Ltd | Morgan Stanley | 493 |
| (1.809) | Appen Ltd | Morgan Stanley | 506 | 749 | Centuria Capital Group (Unit) | Bank of America | |
| 135 | ARB Corp Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (27) |
| | | Merrill Lynch | 35 | 4.733 | Centuria Industrial (REIT) | Bank of America | |
| 226 | ARB Corp Ltd | Goldman Sachs | 170 | | | Merrill Lynch | (34) |
| 748 | Arena (REIT) | Goldman Sachs | 21 | 4.735 | Centuria Industrial (REIT) | Goldman Sachs | (34) |
| 347 | Aristocrat Leisure Ltd | Bank of America | | (399) | Centuria Office (REIT) | Goldman Sachs | 11 |
| | | Merrill Lynch | 533 | 3.287 | Challenger Ltd | Goldman Sachs | (165) |
| 465 | Aristocrat Leisure Ltd | Goldman Sachs | 714 | 1.806 | Challenger Ltd | Morgan Stanley | (428) |
| 4.386 | Aristocrat Leisure Ltd | Morgan Stanley | (6.203) | (4.630) | Champion Iron Ltd | Goldman Sachs | (2.825) |
| 3.234 | Atlas Arteria Ltd (Unit) | Bank of America | | 1.314 | Charter Hall Group (REIT) | Morgan Stanley | 113 |
| | | Merrill Lynch | 650 | 1.776 | Charter Hall Long Wale (REIT) | Bank of America | |
| 578 | Atlas Arteria Ltd (Unit) | Goldman Sachs | 116 | | | Merrill Lynch | 38 |
| 7.744 | Atlas Arteria Ltd (Unit) | Morgan Stanley | 889 | 13.108 | Charter Hall Long Wale (REIT) | | |
| 64 | AUB Group Ltd | Bank of America | | | | Goldman Sachs | 282 |
| | | Merrill Lynch | (30) | 3.823 | Charter Hall Retail (REIT) | Bank of America | |
| 4.319 | Aurizon Holdings Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 165 |
| | | Merrill Lynch | 124 | 6.509 | Charter Hall Retail (REIT) | Goldman Sachs | 280 |
| 5.529 | Aurizon Holdings Ltd | Goldman Sachs | 159 | 4.862 | Charter Hall Social Infrastructure (REIT) | Bank of America | |
| 3.896 | Aurizon Holdings Ltd | Morgan Stanley | 56 | | | Merrill Lynch | 433 |
| 1.429 | Aussie Broadband Ltd | Bank of America | | 7.054 | Charter Hall Social Infrastructure (REIT) | | |
| | | Merrill Lynch | 123 | (332) | City Chic Collective Ltd | Goldman Sachs | 606 |
| 3.349 | Aussie Broadband Ltd | Goldman Sachs | 288 | (52.021) | Cleanaway Waste Management Ltd | Goldman Sachs | (3) |
| 1.211 | Austal Ltd | Bank of America | | 26 | Clinuvel Pharmaceuticals Ltd | | |
| | | Merrill Lynch | 12 | | | Goldman Sachs | (16) |
| 1.395 | Austal Ltd | Goldman Sachs | 25 | (143) | Cochlear Ltd | Goldman Sachs | (1.094) |
| (830) | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | Goldman Sachs | 343 | 164 | Codan Ltd | Goldman Sachs | 104 |
| 4.633 | Australian Ethical Investment Ltd | Bank of America | | (3.203) | Coles Group Ltd | Goldman Sachs | 2.483 |
| | | Merrill Lynch | 133 | (66) | Collins Foods Ltd | Goldman Sachs | 27 |
| 3.984 | Australian Ethical Investment Ltd | Goldman Sachs | 114 | 371 | Commonwealth Bank of Australia | Bank of America | |
| 3.523 | Bank of Queensland Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 274 |
| | | Merrill Lynch | (48) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|---|-------------------------------|---|-------------------------------|---|-------------------------------|---|
| Australien Fortsetzung | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| 289 | Commonwealth Bank of Australia | Goldman Sachs | (91) | (442) | Fortescue Metals Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (365) |
| 863 | Commonwealth Bank of Australia | Morgan Stanley | (125) | (2.802) | Fortescue Metals Group Ltd | Goldman Sachs | (2.313) |
| (516) | Computershare Ltd | Goldman Sachs | 263 | (425) | Fortescue Metals Group Ltd | Morgan Stanley | 183 |
| 55 | Corporate Travel Management Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 36 | (10.840) | G8 Education Ltd | Goldman Sachs | (350) |
| 734 | Costa Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | 95 | 923 | GDI Property Group Partnership (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 10 |
| 313 | Credit Corp Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 18 | (630) | Genworth Mortgage Insurance Australia Ltd | Bank of America Merrill Lynch | — |
| 528 | Credit Corp Group Ltd | Goldman Sachs | (65) | (210) | Genworth Mortgage Insurance Australia Ltd | Goldman Sachs | — |
| (14.191) | Cromwell Property Group (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 204 | 7.840 | Gold Road Resources Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 463 |
| (87.176) | Cromwell Property Group (REIT) | Goldman Sachs | 1.252 | 1.589 | Gold Road Resources Ltd | Goldman Sachs | 86 |
| (9.698) | Crown Resorts Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (446) | 1.927 | Goodman Group (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.331 |
| (3.121) | Crown Resorts Ltd | Goldman Sachs | (291) | 745 | Goodman Group (REIT) | Goldman Sachs | 651 |
| (115) | CSL Ltd | Goldman Sachs | 447 | 1.237 | Goodman Group (REIT) | Morgan Stanley | 1.068 |
| 202 | CSR Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (73) | 4.116 | GPT Group (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 177 |
| 3.509 | CSR Ltd | Goldman Sachs | (1.259) | 11.622 | GPT Group (REIT) | Goldman Sachs | 751 |
| 11.103 | CSR Ltd | Morgan Stanley | (3.268) | 5.150 | GPT Group (REIT) | Morgan Stanley | 222 |
| 875 | Data#3 Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (339) | 1.243 | GrainCorp Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (241) |
| 252 | Data#3 Ltd | Goldman Sachs | (98) | 1.935 | GrainCorp Ltd 'A' | Goldman Sachs | (375) |
| (3.397) | De Grey Mining Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (231) | 2.528 | Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 218 |
| (5.894) | De Grey Mining Ltd | Goldman Sachs | (424) | 710 | Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT) | Goldman Sachs | 61 |
| 4.152 | Deterra Royalties Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 119 | (460) | GUD Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 86 |
| 4.641 | Deterra Royalties Ltd | Goldman Sachs | 133 | (2.811) | GUD Holdings Ltd | Goldman Sachs | 525 |
| 10.658 | Deterra Royalties Ltd | Morgan Stanley | (536) | 4.526 | GWA Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | — |
| 2.656 | Dexus Industria (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 95 | 7.702 | GWA Group Ltd | Goldman Sachs | — |
| 4.448 | Dexus Industria (REIT) | Goldman Sachs | 160 | (208) | Hansen Technologies Ltd | Goldman Sachs | (3) |
| 777 | Dicker Data Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 55 | 1.704 | Harvey Norman Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 13 |
| 984 | Dicker Data Ltd | Goldman Sachs | (1) | 672 | Harvey Norman Holdings Ltd | Goldman Sachs | 6 |
| 6.929 | Domain Holdings Australia Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (415) | 1.626 | Harvey Norman Holdings Ltd | Goldman Sachs | (17) |
| 5.156 | Domain Holdings Australia Ltd | Goldman Sachs | (521) | (2.133) | Healius Ltd | Goldman Sachs | (193) |
| 5.148 | Domain Holdings Australia Ltd | Morgan Stanley | (333) | 114 | Home Consortium Ltd (REIT) | Goldman Sachs | (15) |
| 124 | Domino's Pizza Enterprises Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (65) | (2.197) | HomeCo Daily Needs (REIT) | Goldman Sachs | (56) |
| 275 | Domino's Pizza Enterprises Ltd | Goldman Sachs | (269) | (546) | HUB24 Ltd | Goldman Sachs | 8 |
| 302 | Domino's Pizza Enterprises Ltd | Morgan Stanley | (280) | 1.004 | IDP Education Ltd | Morgan Stanley | 195 |
| (10.527) | Downer EDI Ltd | Goldman Sachs | (607) | 3.572 | IGO Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 5.180 |
| (605) | Eagers Automotive Ltd | Goldman Sachs | 356 | 3.468 | IGO Ltd | Goldman Sachs | 5.029 |
| 265 | Elders Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (126) | 4.500 | IGO Ltd | Morgan Stanley | 3.198 |
| 563 | Elders Ltd | Goldman Sachs | (267) | 4.894 | Iluka Resources Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.045 |
| 471 | EML Payments Ltd | Goldman Sachs | (3) | 1.980 | Iluka Resources Ltd | Goldman Sachs | 1.507 |
| (18.892) | Endeavour Group Ltd | Goldman Sachs | 6.347 | 3.696 | Iluka Resources Ltd | Morgan Stanley | 1.069 |
| (2.735) | Endeavour Group Ltd | Morgan Stanley | 604 | 5.986 | Imdex Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 816 |
| (45) | EVENT Hospitality and Entertainment Ltd | Goldman Sachs | 11 | 10.773 | Imdex Ltd | Goldman Sachs | 1.469 |
| 2.551 | Evolution Mining Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 696 | 3.156 | Incitec Pivot Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (716) |
| 21.692 | Evolution Mining Ltd | Goldman Sachs | 4.243 | 6.765 | Incitec Pivot Ltd | Goldman Sachs | (941) |
| 11.544 | Evolution Mining Ltd | Morgan Stanley | 887 | 3.326 | Incitec Pivot Ltd | Morgan Stanley | (191) |
| 422 | Flight Centre Travel Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 161 | 1.605 | Ingenia Communities Group (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 101 |
| 2.582 | Flight Centre Travel Group Ltd | Goldman Sachs | 761 | 1.602 | Ingenia Communities Group (REIT) | Goldman Sachs | 123 |
| 7.141 | Flight Centre Travel Group Ltd | Morgan Stanley | (643) | (3.978) | Inghams Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 257 |
| | | | | (25.432) | Inghams Group Ltd | Goldman Sachs | 1.643 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------|---|-------------------------------|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Australien Fortsetzung | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| 12.537 | Insignia Financial Ltd | Bank of America Merrill Lynch | — | 3.640 | Medibank Pvt Ltd | Goldman Sachs | — |
| 458 | Insignia Financial Ltd | Goldman Sachs | — | 8.039 | Medibank Pvt Ltd | Morgan Stanley | — |
| 18.006 | Insignia Financial Ltd | Morgan Stanley | 517 | 89 | Megaport Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (8) |
| (21.517) | Insurance Australia Group Ltd | Goldman Sachs | 4.788 | 4.791 | Metcash Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 76 |
| (945) | Integral Diagnostics Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 136 | 3.570 | Metcash Ltd | Goldman Sachs | 126 |
| (1.091) | Integral Diagnostics Ltd | Goldman Sachs | 157 | 16.228 | Metcash Ltd | Morgan Stanley | 787 |
| (7.781) | InvoCare Ltd | Goldman Sachs | 6.982 | 886 | Mineral Resources Ltd | Goldman Sachs | 1.736 |
| (12.995) | ioneer Ltd | Goldman Sachs | (886) | 14.234 | Mirvac Group (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 511 |
| (191) | IPH Ltd | Goldman Sachs | 1 | 4.817 | Mirvac Group (REIT) | Goldman Sachs | 160 |
| (789) | IRESS Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 181 | 1.152 | Mirvac Group (REIT) | Morgan Stanley | 58 |
| (6.453) | IRESS Ltd | Goldman Sachs | 1.482 | 2.496 | Monadelphous Group Ltd | Goldman Sachs | 1.792 |
| 256 | James Hardie Industries Plc - CDI | Goldman Sachs | (505) | 2.185 | Nanosonics Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 125 |
| 799 | James Hardie Industries Plc - CDI | Morgan Stanley | (1.233) | 4.032 | Nanosonics Ltd | Goldman Sachs | 232 |
| 314 | JB Hi-Fi Ltd | Goldman Sachs | (491) | 357 | National Australia Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (109) |
| 962 | JB Hi-Fi Ltd | Morgan Stanley | (428) | 4.158 | National Storage (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 239 |
| 527 | Johns Lyng Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 56 | 9.115 | National Storage (REIT) | Goldman Sachs | 523 |
| 12.807 | Johns Lyng Group Ltd | Goldman Sachs | (6.889) | (642) | Nearmap Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (12) |
| 511 | Jumbo Interactive Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (150) | (641) | Nearmap Ltd | Goldman Sachs | (12) |
| 1.800 | Jumbo Interactive Ltd | Goldman Sachs | (530) | 468 | Netwealth Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 87 |
| (22.017) | Karoon Energy Ltd | Goldman Sachs | (2.529) | 577 | Netwealth Group Ltd | Goldman Sachs | 108 |
| (4.848) | Kelsian Group Ltd | Goldman Sachs | 626 | (437) | Newcrest Mining Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (82) |
| 1.351 | Kogan.com Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (67) | (2.033) | Newcrest Mining Ltd | Goldman Sachs | (379) |
| 1.238 | Kogan.com Ltd | Goldman Sachs | (70) | (5.056) | NEXTDC Ltd | Goldman Sachs | (2.468) |
| (239) | Lendlease Corp Ltd (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | 113 | (2.739) | nib holdings Ltd | Goldman Sachs | (456) |
| (4.353) | Lendlease Corp Ltd (Unit) | Goldman Sachs | 2.062 | (527) | Nick Scali Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 19 |
| 652 | Lifestyle Communities Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (197) | (46) | Nick Scali Ltd | Goldman Sachs | 2 |
| 720 | Lifestyle Communities Ltd | Goldman Sachs | (217) | 15.684 | Nickel Mines Ltd | Goldman Sachs | 1.407 |
| (6.508) | Link Administration Holdings Ltd | Goldman Sachs | 327 | 545 | Nine Entertainment Co Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (110) |
| (11.778) | Liontown Resources Ltd | Goldman Sachs | (861) | 347 | Nine Entertainment Co Holdings Ltd | Goldman Sachs | (25) |
| 9.792 | Lottery Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 703 | (20.019) | Northern Star Resources Ltd | Goldman Sachs | (2.663) |
| 701 | Lottery Corp Ltd | Morgan Stanley | (36) | (265) | Novonix Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (78) |
| 445 | Lovisa Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (146) | (1.182) | Novonix Ltd | Goldman Sachs | (166) |
| 564 | Lovisa Holdings Ltd | Goldman Sachs | (273) | 322 | NRW Holdings Ltd | Goldman Sachs | 32 |
| (937) | Lynas Rare Earths Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (133) | (3.739) | Nufarm Ltd | Goldman Sachs | 3.167 |
| (2.715) | Lynas Rare Earths Ltd | Goldman Sachs | (1.189) | (5.534) | Nuix Ltd | Goldman Sachs | 43 |
| (309) | Lynas Rare Earths Ltd | Morgan Stanley | (106) | 615 | Objective Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 305 |
| 210 | MA Financial Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (50) | 849 | Objective Corp Ltd | Goldman Sachs | 421 |
| 64 | Macquarie Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 290 | (5.723) | Omni Bridgeway Ltd | Goldman Sachs | 246 |
| 253 | Macquarie Group Ltd | Goldman Sachs | 1.148 | (2.773) | Orica Ltd | Goldman Sachs | 318 |
| 86 | Macquarie Group Ltd | Morgan Stanley | 377 | (528) | Orica Ltd | Morgan Stanley | 8 |
| 933 | Magellan Financial Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 301 | (1.544) | Origin Energy Ltd | Goldman Sachs | (22) |
| 143 | Magellan Financial Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (20) | (4.266) | Orora Ltd | Goldman Sachs | (276) |
| 1.152 | Magellan Financial Group Ltd | Goldman Sachs | 372 | (3.286) | OZ Minerals Ltd | Goldman Sachs | (6.227) |
| 144 | Magellan Financial Group Ltd | Goldman Sachs | (20) | (2.684) | Pact Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | (135) |
| 734 | Magellan Financial Group Ltd | Morgan Stanley | 248 | (37.578) | Paladin Energy Ltd | Goldman Sachs | (3.507) |
| 91 | Magellan Financial Group Ltd | Morgan Stanley | (7) | 434 | Pandal Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 34 |
| (17.001) | Mayne Pharma Group Ltd | Goldman Sachs | (244) | 3.471 | Pandal Group Ltd | Goldman Sachs | 274 |
| | | | | (34.584) | Perenti Global Ltd | Goldman Sachs | 497 |
| | | | | 2.866 | Perpetual Ltd | Morgan Stanley | 555 |
| | | | | 789 | Perseus Mining Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (7) |
| | | | | (35) | PEXA Group Ltd | Goldman Sachs | 2 |
| | | | | 882 | Pilbara Minerals Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 222 |
| | | | | 2.466 | Pilbara Minerals Ltd | Goldman Sachs | 620 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|--|----------------------------------|---|-------------------------------|---|----------------------------------|---|
| Australien Fortsetzung | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| 4.717 | Pilbara Minerals Ltd | Morgan Stanley | 474 | 33.105 | St Barbara Ltd | Goldman Sachs | 2.729 |
| 1.250 | Pinnacle Investment Management Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (251) | 18.641 | Star Entertainment Grp Ltd | Morgan Stanley | (1.740) |
| 5.505 | Pinnacle Investment Management Group Ltd | Goldman Sachs | (1.106) | (2.176) | Steadfast Group Ltd | Goldman Sachs | (125) |
| 11.262 | Platinum Asset Management Ltd | Goldman Sachs | 162 | 3.196 | Stockland (REIT) | Goldman Sachs | 206 |
| 14.788 | Platinum Asset Management Ltd | Morgan Stanley | 318 | 12.749 | Stockland (REIT) | Morgan Stanley | 932 |
| (12.868) | PointsBet Holdings Ltd | Goldman Sachs | (3.325) | (14.499) | Suncorp Group Ltd | Goldman Sachs | 7.567 |
| 1.983 | PolyNovo Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (21) | (360) | Super Retail Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 129 |
| (666) | Premier Investments Ltd | Goldman Sachs | 406 | (2.801) | Super Retail Group Ltd | Goldman Sachs | 1.005 |
| 768 | Pro Medicus Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 436 | 23.063 | Tabcorp Holdings Ltd | Goldman Sachs | (1.377) |
| 327 | Pro Medicus Ltd | Goldman Sachs | 185 | 1.216 | Tassal Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (26) |
| 231 | Pro Medicus Ltd | Morgan Stanley | 40 | 4.705 | Tassal Group Ltd | Goldman Sachs | (101) |
| (2.470) | Qantas Airways Ltd | Goldman Sachs | (158) | 850 | Technology One Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 232 |
| (3.643) | QBE Insurance Group Ltd | Goldman Sachs | 798 | 1.800 | Technology One Ltd | Goldman Sachs | 491 |
| (672) | Ramelius Resources Ltd | Goldman Sachs | (31) | 15.987 | Telstra Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (269) |
| (1.324) | Ramsay Health Care Ltd | Goldman Sachs | 105 | 35.851 | Telstra Corp Ltd | Goldman Sachs | (1.192) |
| 164 | REA Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (148) | 24.849 | Telstra Corp Ltd | Morgan Stanley | (714) |
| 97 | REA Group Ltd | Goldman Sachs | (88) | 303 | Temple & Webster Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (65) |
| 229 | REA Group Ltd | Morgan Stanley | (252) | (71.302) | TopBeta Holdings Ltd | Goldman Sachs | (1.280) |
| (10.919) | Redbubble Ltd | Goldman Sachs | 431 | (599) | TPG Telecom Ltd | Goldman Sachs | 29 |
| (4.951) | Reece Ltd | Goldman Sachs | 320 | (16.348) | TPG Telecom Ltd | Morgan Stanley | 2.230 |
| (880) | Regis Resources Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (38) | (3.294) | Transurban Group (Unit) | Goldman Sachs | (662) |
| (3.838) | Regis Resources Ltd | Goldman Sachs | (306) | 830 | Treasury Wine Estates Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 435 |
| (5.728) | Reliance Worldwide Corp Ltd | Goldman Sachs | 538 | (1.310) | Tyro Payments Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 19 |
| 481 | Rio Tinto Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 3.470 | (2.435) | Tyro Payments Ltd | Goldman Sachs | 35 |
| 107 | Rio Tinto Ltd | Goldman Sachs | 772 | (46.378) | Uniti Group Ltd | Goldman Sachs | (1.321) |
| 376 | Rural Funds Group (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 5 | (40.022) | Vicinity Centres (REIT) | Goldman Sachs | (700) |
| 1.600 | Sandfire Resources Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 655 | (60.645) | Vicinity Centres (REIT) | Morgan Stanley | (1.088) |
| 918 | Sandfire Resources Ltd | Goldman Sachs | 376 | (22.092) | Viva Energy Group Ltd | Goldman Sachs | (159) |
| (12.285) | Santos Ltd | Goldman Sachs | (251) | 823 | Waypoint (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 24 |
| 4.328 | Scentre Group (REIT) | Morgan Stanley | 31 | 4.974 | Waypoint (REIT) | Goldman Sachs | 143 |
| 655 | SEEK Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (449) | 3.591 | Webjet Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 851 |
| 201 | SEEK Ltd | Goldman Sachs | 15 | 4.995 | Webjet Ltd | Goldman Sachs | 1.179 |
| 2.235 | SEEK Ltd | Morgan Stanley | (1.764) | 661 | Wesfarmers Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (507) |
| (1.085) | Select Harvests Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 140 | 1.368 | Wesfarmers Ltd | Goldman Sachs | (2.426) |
| (949) | Select Harvests Ltd | Goldman Sachs | 123 | 973 | Wesfarmers Ltd | Morgan Stanley | 663 |
| (809) | Seven Group Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (10) | (2.161) | West African Resources Ltd | Goldman Sachs | (159) |
| (2.871) | Seven Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | 42 | 796 | Westgold Resources Ltd | Goldman Sachs | 66 |
| (230) | Seven Group Holdings Ltd | Morgan Stanley | (64) | (2.785) | Westpac Banking Corp | Goldman Sachs | 1.020 |
| (5.544) | Shopping Centres Australasia Property Group (REIT) | Goldman Sachs | 119 | 72 | WiseTech Global Ltd | Goldman Sachs | 51 |
| (6.525) | Sigma Healthcare Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (94) | 956 | WiseTech Global Ltd | Morgan Stanley | (233) |
| (29.251) | Sigma Healthcare Ltd | Goldman Sachs | (420) | 478 | Woodside Energy Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 4.077 |
| 1.071 | Silver Lake Resources Ltd | Goldman Sachs | (7) | 448 | Woodside Energy Group Ltd | Goldman Sachs | 594 |
| (571) | Sims Ltd | Goldman Sachs | 279 | 1.488 | Woodside Energy Group Ltd | Morgan Stanley | 1.406 |
| (201) | SmartGroup Corp Ltd | Goldman Sachs | (3) | (853) | Woolworths Group Ltd | Goldman Sachs | 1.721 |
| 186 | Sonic Healthcare Ltd | Goldman Sachs | 92 | (2.663) | Worley Ltd | Goldman Sachs | (1.223) |
| 693 | Sonic Healthcare Ltd | Morgan Stanley | (45) | (573) | Xero Ltd | Goldman Sachs | (516) |
| 3.405 | South32 Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.467 | 616 | Zip Co Ltd | Goldman Sachs | (15) |
| 20.039 | South32 Ltd | Goldman Sachs | 8.120 | | | | 44.690 |
| 6.490 | South32 Ltd | Morgan Stanley | 1.537 | Österreich | | | |
| 9.742 | St Barbara Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 792 | 135 | ANDRITZ AG | Bank of America Merrill Lynch | 223 |
| | | | | 165 | ANDRITZ AG | Goldman Sachs | 272 |
| | | | | 684 | ANDRITZ AG | Morgan Stanley | 1.026 |
| | | | | 277 | AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG | Bank of America Merrill Lynch | 1.929 |
| | | | | 138 | AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG | Goldman Sachs | 925 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|--|-------------------------------|---|----------------------------|--|-------------------------------|---|
| Österreich Fortsetzung | | | | Belgien Fortsetzung | | | |
| (437) | BAWAG Group AG | Bank of America Merrill Lynch | (1.919) | (214) | Aedifica SA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 894 |
| (543) | BAWAG Group AG | Goldman Sachs | (2.385) | (395) | Aedifica SA (REIT) | Goldman Sachs | 1.650 |
| (256) | BAWAG Group AG | Morgan Stanley | (219) | (76) | Ageas SA | Bank of America Merrill Lynch | (184) |
| (1.962) | CA Immobilien Anlagen AG | Bank of America Merrill Lynch | (5.780) | (365) | Ageas SA | Goldman Sachs | (884) |
| 40 | DO & CO AG | Bank of America Merrill Lynch | 186 | (146) | Ageas SA | Morgan Stanley | (300) |
| 29 | DO & CO AG | Goldman Sachs | 129 | 120 | AGFA-Gevaert NV | Goldman Sachs | 30 |
| 1.342 | Erste Group Bank AG | Bank of America Merrill Lynch | 2.200 | (510) | Anheuser-Busch InBev SA | Bank of America Merrill Lynch | (468) |
| 449 | Erste Group Bank AG | Goldman Sachs | 736 | (549) | Anheuser-Busch InBev SA | Goldman Sachs | 156 |
| 1.760 | Erste Group Bank AG | Morgan Stanley | (661) | (122) | Anheuser-Busch InBev SA | Morgan Stanley | (171) |
| 77 | EVN AG | Bank of America Merrill Lynch | 23 | (60) | Argenx SE | Goldman Sachs | 270 |
| 165 | EVN AG | Goldman Sachs | 46 | (62) | Argenx SE | Morgan Stanley | 445 |
| (2.861) | FACC AG | Goldman Sachs | (552) | 381 | Azelis Group NV | Goldman Sachs | (286) |
| (2.351) | IMMOFINANZ AG | Goldman Sachs | 6.448 | 339 | Barco NV | Bank of America Merrill Lynch | 291 |
| 11 | Lenzing AG | Goldman Sachs | 66 | 345 | Barco NV | Goldman Sachs | 296 |
| 212 | Oesterreichische Post AG | Bank of America Merrill Lynch | (79) | (1.230) | Befimmo SA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (395) |
| 1.017 | Oesterreichische Post AG | Goldman Sachs | (381) | (19) | Bekaert SA | Bank of America Merrill Lynch | (71) |
| (71) | OMV AG | Goldman Sachs | (592) | (144) | Bekaert SA | Goldman Sachs | (527) |
| (1.778) | OMV AG | Morgan Stanley | (6.476) | (2) | Biocartis Group NV ^{TR} | Goldman Sachs | — |
| 176 | Palfinger AG | Bank of America Merrill Lynch | 292 | (340) | bpost SA | Bank of America Merrill Lynch | (93) |
| 214 | Palfinger AG | Goldman Sachs | 355 | (1.293) | bpost SA | Goldman Sachs | (221) |
| 412 | Porr AG | Goldman Sachs | 185 | (15) | Cie d'Entreprises CFE | Goldman Sachs | 264 |
| 852 | Raiffeisen Bank International AG | Bank of America Merrill Lynch | 329 | (196) | Cofinimmo SA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 48 |
| 1.194 | Raiffeisen Bank International AG | Goldman Sachs | 460 | (203) | Cofinimmo SA (REIT) | Goldman Sachs | 48 |
| 1.227 | Raiffeisen Bank International AG | Morgan Stanley | 66 | 304 | Colruyt SA | Bank of America Merrill Lynch | 379 |
| (22) | S IMMO AG | Bank of America Merrill Lynch | 4 | 578 | Colruyt SA | Goldman Sachs | (462) |
| 10 | Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG | Goldman Sachs | 49 | 249 | Colruyt SA | Morgan Stanley | 26 |
| (860) | Semperit AG Holding | Bank of America Merrill Lynch | 2.091 | 260 | Econocom Group SA | Bank of America Merrill Lynch | (6) |
| (1.480) | Semperit AG Holding | Goldman Sachs | 3.599 | 1.164 | Euronav NV | Bank of America Merrill Lynch | 1.741 |
| (730) | Telekom Austria AG | Bank of America Merrill Lynch | (78) | 2.203 | Euronav NV | Goldman Sachs | 2.992 |
| (1.297) | Telekom Austria AG | Morgan Stanley | (97) | (40) | Fagron | Bank of America Merrill Lynch | (2) |
| 136 | UNIQA Insurance Group AG | Bank of America Merrill Lynch | 38 | (254) | Gimv NV | Bank of America Merrill Lynch | 160 |
| (82) | Verbund AG | Goldman Sachs | (729) | (692) | Gimv NV | Goldman Sachs | 443 |
| 257 | Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe | Bank of America Merrill Lynch | (303) | 24 | Groupe Bruxelles Lambert SA | Bank of America Merrill Lynch | 43 |
| 40 | Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe | Goldman Sachs | (47) | 427 | Groupe Bruxelles Lambert SA | Goldman Sachs | 709 |
| 1.212 | voestalpine AG | Bank of America Merrill Lynch | 3.428 | 267 | Groupe Bruxelles Lambert SA | Morgan Stanley | 399 |
| 223 | voestalpine AG | Morgan Stanley | 48 | 26 | Intervest Offices & Warehouses NV (REIT) | Goldman Sachs | 8 |
| 104 | Wienerberger AG | Bank of America Merrill Lynch | 196 | (287) | KBC Ancora | Bank of America Merrill Lynch | (800) |
| 2.091 | Wienerberger AG | Goldman Sachs | 3.942 | (193) | KBC Ancora | Goldman Sachs | (326) |
| (63) | Zumtobel Group AG | Bank of America Merrill Lynch | 5 | 117 | KBC Group NV | Goldman Sachs | 436 |
| | | | 8.998 | 176 | KBC Group NV | Morgan Stanley | (117) |
| | | | | (39) | Kinopolis Group NV | Bank of America Merrill Lynch | (24) |
| | | | | (41) | Kinopolis Group NV | Goldman Sachs | (25) |
| | | | | (15) | Melexis NV | Bank of America Merrill Lynch | (82) |
| | | | | 10 | Montea NV (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 16 |
| Belgien | | | | 12 | Montea NV (REIT) | Goldman Sachs | 19 |
| 446 | Ackermans & van Haaren NV | Bank of America Merrill Lynch | (2.709) | (213) | Ontex Group NV | Bank of America Merrill Lynch | (28) |
| 286 | Ackermans & van Haaren NV | Goldman Sachs | (2.649) | | | | |
| 225 | Ackermans & van Haaren NV | Morgan Stanley | (714) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------------------------|----------------------------------|-----------------|---|---------------------------|--|-----------------|---|
| Belgien Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| (88) | Orange Belgium SA | Bank of America | | 934 | AltaGas Ltd | Morgan Stanley | 491 |
| | | Merrill Lynch | (47) | 973 | Altius Minerals Corp | Goldman Sachs | 208 |
| (45) | Orange Belgium SA | Goldman Sachs | (24) | (475) | Altus Group Ltd | Bank of America | |
| 2.200 | Proximus SADP | Goldman Sachs | (837) | | | Merrill Lynch | (484) |
| 2.148 | Proximus SADP | Morgan Stanley | (299) | (120) | Altus Group Ltd | Goldman Sachs | (112) |
| 89 | Recticel SA | Goldman Sachs | 25 | 238 | ARC Resources Ltd | Bank of America | |
| 8 | Retail Estates NV (REIT) | Goldman Sachs | 23 | | | Merrill Lynch | 308 |
| 122 | Shurgard Self Storage SA | Bank of America | | 3.817 | ARC Resources Ltd | Morgan Stanley | 3.562 |
| | | Merrill Lynch | 144 | (537) | Argonaut Gold Inc | Bank of America | |
| 1.122 | Shurgard Self Storage SA | Goldman Sachs | 1.322 | | | Merrill Lynch | 27 |
| (155) | Sofina SA | Goldman Sachs | 9.199 | 36 | Aritzia Inc | Bank of America | |
| (104) | Sofina SA | Morgan Stanley | 3.432 | | | Merrill Lynch | (46) |
| 362 | Solvay SA | Goldman Sachs | 464 | 86 | Aritzia Inc | Goldman Sachs | (110) |
| 213 | Solvay SA | Morgan Stanley | 87 | 200 | Aritzia Inc | Morgan Stanley | 152 |
| (925) | Telenet Group Holding NV | Bank of America | | (50) | Artis (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 541 | | | Merrill Lynch | (26) |
| (2.429) | Telenet Group Holding NV | Goldman Sachs | 991 | (318) | Artis (REIT) | Goldman Sachs | (163) |
| (412) | Telenet Group Holding NV | Morgan Stanley | 150 | (2.169) | Atco Ltd 'I' | Morgan Stanley | 4.028 |
| 80 | Tessenderlo Group SA | Bank of America | | (446) | ATS Automation Tooling Systems Inc | Goldman Sachs | (1.319) |
| | | Merrill Lynch | — | | | Goldman Sachs | 34 |
| 114 | Tessenderlo Group SA | Goldman Sachs | — | (114) | AutoCanada Inc | Goldman Sachs | (63) |
| (163) | UCB SA | Morgan Stanley | 143 | 1.069 | B2Gold Corp | Goldman Sachs | (531) |
| 320 | Umicore SA | Bank of America | | 2.633 | B2Gold Corp | Morgan Stanley | |
| | | Merrill Lynch | 531 | (34) | Badger Infrastructure Solutions Ltd | Bank of America | |
| 558 | Umicore SA | Goldman Sachs | 927 | (1.306) | Ballard Power Systems Inc | Merrill Lynch | 9 |
| 691 | Umicore SA | Morgan Stanley | 866 | | | Bank of America | |
| (11) | Van de Velde NV | Goldman Sachs | 9 | 244 | Bank of Montreal | Merrill Lynch | (1.085) |
| 61 | VGP NV | Bank of America | | 1.166 | Bank of Nova Scotia | Goldman Sachs | 746 |
| | | Merrill Lynch | (132) | | | Bank of America | |
| 87 | VGP NV | Goldman Sachs | (451) | 545 | Bank of Nova Scotia | Merrill Lynch | 4.188 |
| 137 | Warehouses De Pauw CVA (REIT) | Bank of America | | 687 | Bank of Nova Scotia | Goldman Sachs | 1.639 |
| | | Merrill Lynch | (126) | (617) | Bausch Health Cos Inc | Morgan Stanley | 2.048 |
| 322 | Warehouses De Pauw CVA (REIT) | Goldman Sachs | (297) | (221) | Bausch Health Cos Inc | Goldman Sachs | 776 |
| 1.360 | Warehouses De Pauw CVA (REIT) | Morgan Stanley | (1.399) | 3.568 | Baytex Energy Corp | Morgan Stanley | (63) |
| (9) | Xior Student Housing NV (REIT) | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 14 | 558 | Baytex Energy Corp | Merrill Lynch | 1.580 |
| | | | 15.475 | 2.742 | Baytex Energy Corp | Goldman Sachs | 247 |
| | | | | 26 | BCE Inc | Morgan Stanley | 1.323 |
| | | | | 483 | BCE Inc | Goldman Sachs | 37 |
| | | | | (706) | BlackBerry Ltd | Morgan Stanley | 256 |
| | | | | 305 | Boardwalk (REIT) | Goldman Sachs | (357) |
| | | | | | | Bank of America | |
| 52 | Absolute Software Corp | Goldman Sachs | 46 | 160 | Boardwalk (REIT) | Merrill Lynch | 121 |
| (294) | Advantage Energy Ltd | Bank of America | | 25.012 | Bombardier Inc 'B' | Goldman Sachs | 63 |
| | | Merrill Lynch | (230) | | | Bank of America | |
| (227) | Advantage Energy Ltd | Goldman Sachs | (177) | 12.981 | Bombardier Inc 'B' | Merrill Lynch | 989 |
| 1.093 | Aecon Group Inc | Bank of America | | 165 | Boralex Inc 'A' | Goldman Sachs | 513 |
| | | Merrill Lynch | 17 | 284 | Boralex Inc 'A' | Goldman Sachs | (114) |
| 831 | Aecon Group Inc | Goldman Sachs | 13 | (101) | Boyd Group Services Inc | Morgan Stanley | (124) |
| (489) | Ag Growth International Inc | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (828) | (53) | Boyd Group Services Inc | Merrill Lynch | (332) |
| (261) | Ag Growth International Inc | Goldman Sachs | (442) | (1.796) | Brookfield Asset Management Inc 'A' | Goldman Sachs | (174) |
| (1.383) | Agnico Eagle Mines Ltd | Goldman Sachs | (2.352) | | | Morgan Stanley | (5.727) |
| 1.683 | Air Canada | Bank of America | | (10) | Brookfield Asset Management Reinsurance Partners Ltd 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.063 | (18) | Brookfield Asset Management Reinsurance Partners Ltd 'A' | Merrill Lynch | (22) |
| 3.824 | Air Canada | Goldman Sachs | 4.688 | 715 | Brookfield Infrastructure Corp 'A' | Goldman Sachs | (40) |
| 1.506 | Air Canada | Morgan Stanley | 2.084 | | | Bank of America | |
| 123 | AirBoss of America Corp | Bank of America | | 186 | Brookfield Infrastructure Corp 'A' | Merrill Lynch | (1.486) |
| | | Merrill Lynch | 89 | 524 | Brookfield Infrastructure Corp 'A' | Goldman Sachs | (262) |
| 78 | AirBoss of America Corp | Goldman Sachs | 57 | 294 | BRP Inc | Morgan Stanley | (2.756) |
| 6.837 | Alamos Gold Inc 'A' | Bank of America | | 405 | BRP Inc | Bank of America | 1.415 |
| | | Merrill Lynch | 3.244 | | | Merrill Lynch | (859) |
| 916 | Alamos Gold Inc 'A' | Morgan Stanley | (159) | | | Goldman Sachs | |
| 138 | Algonquin Power & Utilities Corp | Goldman Sachs | (24) | | | | |
| 1.507 | Algonquin Power & Utilities Corp | Morgan Stanley | (334) | | | | |
| (1.063) | Alimentation Couche-Tard Inc | Morgan Stanley | (2.245) | | | | |
| (1.802) | Allied Properties (REIT) | Morgan Stanley | 171 | | | | |
| 158 | AltaGas Ltd | Goldman Sachs | 144 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|---|---------------------------|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Kanada Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| 2.647 | CAE Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.334 | (376) | Cogeco Communications Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.243) |
| 2.259 | CAE Inc | Goldman Sachs | 3.698 | (276) | Cogeco Communications Inc | Goldman Sachs | (983) |
| 2.305 | CAE Inc | Morgan Stanley | 3.354 | (332) | Cogeco Inc | Bank of America Merrill Lynch | (975) |
| 344 | Calibre Mining Corp | Bank of America Merrill Lynch | 35 | (96) | Cogeco Inc | Goldman Sachs | (271) |
| (648) | Cameco Corp | Goldman Sachs | (1.425) | (19) | Colliers International Group Inc | Goldman Sachs | (95) |
| (72) | Cameco Corp | Morgan Stanley | (79) | (98) | Colliers International Group Inc | Morgan Stanley | (626) |
| 101 | Canaccord Genuity Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6 | (3) | Constellation Software Inc | Bank of America Merrill Lynch | (94) |
| (629) | Canacol Energy Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (179) | (55) | Constellation Software Inc | Morgan Stanley | (1.857) |
| (1.377) | Canacol Energy Ltd | Goldman Sachs | (392) | (893) | Converge Technology Solutions Corp | Bank of America Merrill Lynch | (600) |
| 233 | Canada Goose Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (61) | (646) | Converge Technology Solutions Corp | Goldman Sachs | (434) |
| 1.844 | Canada Goose Holdings Inc | Goldman Sachs | (481) | (299) | Corus Entertainment Inc 'B' | Goldman Sachs | (85) |
| (1.382) | Canadian Apartment Properties (REIT) | Goldman Sachs | (536) | 10.078 | Crescent Point Energy Corp | Goldman Sachs | 13.471 |
| (664) | Canadian Apartment Properties (REIT) | Morgan Stanley | 41 | 443 | Crescent Point Energy Corp | Morgan Stanley | 340 |
| 41 | Canadian Imperial Bank of Commerce | Goldman Sachs | 44 | (892) | Crombie (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (167) |
| 264 | Canadian Imperial Bank of Commerce | Morgan Stanley | (54) | 736 | CT (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 64 |
| 281 | Canadian National Railway Co | Goldman Sachs | (22) | 710 | CT (REIT) | Goldman Sachs | 62 |
| 180 | Canadian National Railway Co | Morgan Stanley | 483 | (2.758) | Denison Mines Corp | Bank of America Merrill Lynch | (458) |
| 111 | Canadian Natural Resources Ltd | Goldman Sachs | 179 | (176) | dentalcorp Holdings Ltd | Goldman Sachs | 63 |
| (114) | Canadian Pacific Railway Ltd | Morgan Stanley | (179) | 54 | Descartes Systems Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (20) |
| (365) | Canadian Tire Corp Ltd 'A' | Morgan Stanley | (2.434) | 872 | Descartes Systems Group Inc | Morgan Stanley | 428 |
| 2.161 | Canadian Utilities Ltd 'A' | Goldman Sachs | 171 | (1.026) | Dollarama Inc | Morgan Stanley | (3.222) |
| 626 | Canadian Utilities Ltd 'A' | Morgan Stanley | (223) | (1.698) | Dream Industrial (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 134 |
| 377 | Canadian Western Bank | Bank of America Merrill Lynch | (518) | (4.878) | Dream Industrial (REIT) | Morgan Stanley | (424) |
| 554 | Canadian Western Bank | Goldman Sachs | (757) | (13) | DREAM Unlimited Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 5 |
| (523) | Canfor Corp | Bank of America Merrill Lynch | (736) | (583) | Dundee Precious Metals Inc | Goldman Sachs | (216) |
| (1.423) | Canfor Corp | Goldman Sachs | (2.003) | (742) | Dye & Durham Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.579) |
| (608) | Capital Power Corp | Morgan Stanley | 24 | (1.338) | Dye & Durham Ltd | Goldman Sachs | (2.847) |
| (6.809) | Capstone Mining Corp | Morgan Stanley | (269) | (175) | ECN Capital Corp | Goldman Sachs | 12 |
| 164 | Cargojet Inc | Goldman Sachs | 268 | 645 | Eldorado Gold Corp | Bank of America Merrill Lynch | (15) |
| 52 | Cargojet Inc | Morgan Stanley | 163 | 2.370 | Eldorado Gold Corp | Goldman Sachs | (56) |
| (616) | Cascades Inc | Bank of America Merrill Lynch | 141 | (3.509) | Element Fleet Management Corp | Morgan Stanley | (694) |
| (710) | Cascades Inc | Goldman Sachs | 163 | 110 | Emera Inc | Bank of America Merrill Lynch | (28) |
| 102 | CCL Industries Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (48) | 123 | Emera Inc | Goldman Sachs | (128) |
| 739 | CCL Industries Inc 'B' | Morgan Stanley | (53) | 1.019 | Emera Inc | Morgan Stanley | (1.144) |
| (1.715) | Celestica Inc | Goldman Sachs | (41) | (2.179) | Empire Co Ltd 'A' | Morgan Stanley | (1.224) |
| 289 | Cenovus Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 773 | 278 | Enbridge Inc | Bank of America Merrill Lynch | 321 |
| 757 | Cenovus Energy Inc | Goldman Sachs | 2.024 | 2.960 | Enbridge Inc | Goldman Sachs | 3.137 |
| 903 | Cenovus Energy Inc | Morgan Stanley | 1.528 | 1.812 | Enbridge Inc | Morgan Stanley | 1.634 |
| (6.066) | Centerra Gold Inc | Goldman Sachs | 1.199 | (455) | Endeavour Mining Plc | Bank of America Merrill Lynch | 40 |
| 1.335 | CGI Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.453 | 541 | Endeavour Silver Corp | Goldman Sachs | 17 |
| 116 | CGI Inc | Morgan Stanley | 148 | 564 | Enerflex Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 134 |
| (129) | Choice Properties (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 2 | 304 | Enerflex Ltd | Goldman Sachs | 72 |
| (156) | Chorus Aviation Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6) | (420) | Energy Fuels Inc | Bank of America Merrill Lynch | (246) |
| 205 | CI Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 284 | (1.829) | Energy Fuels Inc | Goldman Sachs | (1.070) |
| 135 | CI Financial Corp | Goldman Sachs | 187 | 2.472 | Enerplus Corp | Morgan Stanley | 3.871 |
| 2.225 | CI Financial Corp | Morgan Stanley | 1.390 | (27) | Enghouse Systems Ltd | Goldman Sachs | (26) |
| 757 | Cineplex Inc | Goldman Sachs | 24 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--------------------------------------|----------------------------------|---|---------------------------|--------------------------------|----------------------------------|---|
| Kanada Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| 276 | Equinox Gold Corp | Bank of America Merrill Lynch | 129 | 538 | Hydro One Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (13) |
| 2.105 | Equinox Gold Corp | Goldman Sachs | 982 | 510 | Hydro One Ltd | Goldman Sachs | (12) |
| 354 | Equitable Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.274 | 1.793 | Hydro One Ltd | Morgan Stanley | (652) |
| 684 | Equitable Group Inc | Goldman Sachs | 2.461 | (1.839) | iA Financial Corp Inc | Morgan Stanley | 1.004 |
| (53) | ERO Copper Corp | Goldman Sachs | (62) | 238 | IGM Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | 361 |
| 626 | Evertz Technologies Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (253) | 903 | IGM Financial Inc | Goldman Sachs | 1.371 |
| 709 | Evertz Technologies Ltd | Goldman Sachs | (286) | 527 | IGM Financial Inc | Morgan Stanley | 934 |
| (993) | Exchange Income Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.669) | 500 | Imperial Oil Ltd | Morgan Stanley | 1.728 |
| (9.952) | Extendicare Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.023) | 2.824 | Innergex Renewable Energy Inc | Goldman Sachs | (558) |
| (41) | Fairfax Financial Holdings Ltd | Morgan Stanley | (856) | 3.393 | Innergex Renewable Energy Inc | Morgan Stanley | (456) |
| (1.044) | Fiera Capital Corp | Bank of America Merrill Lynch | (543) | 58 | Intact Financial Corp | Morgan Stanley | 73 |
| (1.019) | Fiera Capital Corp | Goldman Sachs | (500) | (547) | Interfor Corp | Bank of America Merrill Lynch | 368 |
| (1.823) | Finning International Inc | Morgan Stanley | (1.341) | (393) | Interfor Corp | Goldman Sachs | 264 |
| 385 | First Majestic Silver Corp | Bank of America Merrill Lynch | (27) | 2.208 | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (524) |
| 4.612 | First Majestic Silver Corp | Goldman Sachs | (388) | 1.336 | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | Goldman Sachs | (317) |
| 3.805 | First Majestic Silver Corp | Morgan Stanley | (572) | 2.316 | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | Morgan Stanley | (311) |
| 216 | First National Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 121 | (3.385) | J55 Capital Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.794) |
| 152 | First National Financial Corp | Goldman Sachs | 96 | (5.139) | J55 Capital Corp | Goldman Sachs | (2.723) |
| (1.118) | First Quantum Minerals Ltd | Morgan Stanley | (857) | 101 | K92 Mining Inc | Goldman Sachs | 48 |
| 193 | FirstService Corp | Goldman Sachs | (206) | 1.008 | Kelt Exploration Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 470 |
| (111) | Fortis Inc | Goldman Sachs | 115 | 3.295 | Kelt Exploration Ltd | Goldman Sachs | 1.538 |
| (827) | Fortis Inc | Morgan Stanley | 1.099 | 987 | Keyera Corp | Bank of America Merrill Lynch | 358 |
| 14 | Franco-Nevada Corp | Bank of America Merrill Lynch | 77 | 1.338 | Keyera Corp | Goldman Sachs | 465 |
| 568 | Franco-Nevada Corp | Goldman Sachs | 2.705 | 1.345 | Keyera Corp | Morgan Stanley | 905 |
| 67 | Franco-Nevada Corp | Morgan Stanley | 46 | 3.170 | Killam Apartment (REIT) | Goldman Sachs | 176 |
| 40 | Freehold Royalties Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 34 | 77 | Kinaxis Inc | Bank of America Merrill Lynch | (55) |
| 3.500 | Freehold Royalties Ltd | Goldman Sachs | 3.017 | 175 | Kinaxis Inc | Goldman Sachs | (126) |
| (108) | GDI Integrated Facility Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | (50) | 333 | Kinaxis Inc | Morgan Stanley | 1.169 |
| 29 | George Weston Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 9 | (571) | Kinross Gold Corp | Goldman Sachs | (104) |
| 352 | George Weston Ltd | Goldman Sachs | 956 | (2.783) | Kinross Gold Corp | Morgan Stanley | 396 |
| 201 | George Weston Ltd | Morgan Stanley | 500 | (207) | Labrador Iron Ore Royalty Corp | Goldman Sachs | (308) |
| 916 | GFL Environmental Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.229 | (176) | Largo Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1 |
| 1.311 | GFL Environmental Inc | Goldman Sachs | 1.805 | (1.411) | Largo Inc | Goldman Sachs | 11 |
| 501 | GFL Environmental Inc | Morgan Stanley | 477 | 9 | Lassonde Industries Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (38) |
| 812 | Gibson Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 469 | 6 | Lassonde Industries Inc 'A' | Goldman Sachs | (25) |
| 254 | Gibson Energy Inc | Goldman Sachs | 162 | 15 | Laurentian Bank of Canada | Bank of America Merrill Lynch | 10 |
| 949 | Gibson Energy Inc | Morgan Stanley | 477 | 100 | Laurentian Bank of Canada | Goldman Sachs | 65 |
| (213) | Gildan Activewear Inc | Goldman Sachs | 79 | (253) | LifeWorks Inc | Bank of America Merrill Lynch | (122) |
| (242) | Gildan Activewear Inc | Morgan Stanley | (314) | (2.040) | Lightspeed Commerce Inc | Goldman Sachs | (11.242) |
| 1.030 | Great-West Lifeco Inc | Bank of America Merrill Lynch | 777 | (501) | Lightspeed Commerce Inc | Morgan Stanley | (2.179) |
| 1.533 | Great-West Lifeco Inc | Goldman Sachs | 1.396 | 53 | Linamar Corp | Goldman Sachs | 177 |
| (8.506) | H&R (REIT) | Morgan Stanley | (3.868) | (2.575) | Loblaw Cos Ltd | Morgan Stanley | (7.733) |
| 167 | Headwater Exploration Inc | Bank of America Merrill Lynch | 34 | 75 | Lundin Mining Corp | Bank of America Merrill Lynch | 49 |
| (1.932) | HLS Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.202) | 491 | Lundin Mining Corp | Goldman Sachs | 322 |
| 101 | Home Capital Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 117 | 654 | Lundin Mining Corp | Morgan Stanley | 140 |
| 227 | Home Capital Group Inc | Goldman Sachs | 408 | (253) | MAG Silver Corp | Goldman Sachs | (320) |
| (3.510) | Hudbay Minerals Inc | Goldman Sachs | (1.055) | (418) | Magna International Inc | Goldman Sachs | (1.396) |
| (3.694) | Hut 8 Mining Corp | Bank of America Merrill Lynch | (351) | (868) | Magna International Inc | Morgan Stanley | (2.842) |
| (1.250) | Hut 8 Mining Corp | Goldman Sachs | (119) | (1.866) | Manulife Financial Corp | Goldman Sachs | (539) |
| | | | | (949) | Manulife Financial Corp | Morgan Stanley | (365) |
| | | | | (134) | Maple Leaf Foods Inc | Bank of America Merrill Lynch | (17) |
| | | | | (953) | Maple Leaf Foods Inc | Goldman Sachs | (259) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--|-------------------------------|---|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|---|
| Kanada Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| (1.233) | Martinrea International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (624) | 744 | Parex Resources Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.571 |
| (1.075) | Martinrea International Inc | Goldman Sachs | (544) | 866 | Parex Resources Inc | Goldman Sachs | 1.829 |
| (574) | MDA Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (118) | 1.097 | Parex Resources Inc | Morgan Stanley | 2.265 |
| (160) | MDA Ltd | Goldman Sachs | (33) | (185) | Park Lawn Corp | Bank of America Merrill Lynch | (129) |
| (2.700) | MEG Energy Corp | Morgan Stanley | (1.580) | (50) | Park Lawn Corp | Goldman Sachs | (38) |
| (475) | Methanex Corp | Goldman Sachs | (1.268) | (115) | Parkland Corp | Bank of America Merrill Lynch | (40) |
| (700) | Methanex Corp | Morgan Stanley | (2.068) | (131) | Parkland Corp | Goldman Sachs | (123) |
| (441) | Metro Inc | Bank of America Merrill Lynch | 467 | 675 | Pason Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (27) |
| (1.247) | Metro Inc | Goldman Sachs | 1.322 | 330 | Pason Systems Inc | Goldman Sachs | (13) |
| (535) | Metro Inc | Morgan Stanley | (801) | 1.775 | Pembina Pipeline Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.727 |
| 135 | Morguard Corp | Goldman Sachs | 182 | 71 | Pembina Pipeline Corp | Goldman Sachs | 11 |
| 106 | Morguard North American Residential (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (11) | 756 | Pembina Pipeline Corp | Morgan Stanley | 494 |
| 117 | Morguard North American Residential (REIT) | Goldman Sachs | (12) | (161) | Pet Valu Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (80) |
| (113) | MTY Food Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (54) | (193) | Peyto Exploration & Development Corp | Bank of America Merrill Lynch | (219) |
| (505) | Mullen Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 192 | (170) | Peyto Exploration & Development Corp | Goldman Sachs | (195) |
| (702) | Mullen Group Ltd | Goldman Sachs | 267 | (332) | Pollard Banknote Ltd | Goldman Sachs | 158 |
| (177) | NanoXplore Inc | Bank of America Merrill Lynch | (196) | (3.075) | Power Corp of Canada | Morgan Stanley | (2.213) |
| (661) | National Bank of Canada | Bank of America Merrill Lynch | (2.627) | 688 | PrairieSky Royalty Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 359 |
| (683) | National Bank of Canada | Goldman Sachs | (2.181) | 1.936 | PrairieSky Royalty Ltd | Goldman Sachs | 1.011 |
| (40) | Neighbourly Pharmacy Inc | Goldman Sachs | 47 | 236 | Premium Brands Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (112) |
| (16.574) | New Gold Inc | Goldman Sachs | — | 97 | Premium Brands Holdings Corp | Goldman Sachs | (46) |
| (1.002) | Newcrest Mining Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (289) | (52) | Primaris (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (5) |
| (222) | Newcrest Mining Ltd | Morgan Stanley | 83 | (235) | Primaris (REIT) | Goldman Sachs | (11) |
| 4.957 | NexGen Energy Ltd | Morgan Stanley | 980 | (1.640) | Primo Water Corp | Goldman Sachs | 246 |
| (69) | NFI Group Inc | Goldman Sachs | 43 | (1.806) | Primo Water Corp | Morgan Stanley | (386) |
| (1.220) | North West Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 116 | (171) | Quebecor Inc 'B' | Goldman Sachs | (55) |
| (121) | North West Co Inc | Goldman Sachs | 11 | (1.025) | Quebecor Inc 'B' | Morgan Stanley | (8) |
| 221 | Northland Power Inc | Morgan Stanley | (105) | (962) | Real Matters Inc | Bank of America Merrill Lynch | (403) |
| 3.796 | NorthWest Healthcare Properties (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 691 | (277) | Real Matters Inc | Goldman Sachs | (116) |
| 365 | NorthWest Healthcare Properties (REIT) | Goldman Sachs | 66 | (1.451) | Restaurant Brands International Inc | Goldman Sachs | (354) |
| 2.231 | Novagold Resources Inc | Bank of America Merrill Lynch | 318 | (1.728) | Restaurant Brands International Inc | Morgan Stanley | (2.326) |
| 3.911 | Novagold Resources Inc | Goldman Sachs | 557 | (148) | Richelieu Hardware Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (345) |
| (205) | Nutrien Ltd | Morgan Stanley | 715 | (2.042) | RioCan (REIT) | Morgan Stanley | (646) |
| (95) | Nuvei Corp | Goldman Sachs | (621) | (470) | Ritchie Bros Auctioneers Inc | Goldman Sachs | 533 |
| (404) | Nuvei Corp | Morgan Stanley | (2.917) | (859) | Rogers Communications Inc 'B' | Goldman Sachs | (34) |
| 303 | NuVista Energy Ltd | Goldman Sachs | 292 | 277 | Royal Bank of Canada | Bank of America Merrill Lynch | 991 |
| (216) | OceanaGold Corp | Bank of America Merrill Lynch | (53) | 136 | Royal Bank of Canada | Goldman Sachs | 435 |
| (6.106) | OceanaGold Corp | Goldman Sachs | (1.497) | 24 | Royal Bank of Canada | Morgan Stanley | 60 |
| (555) | Onex Corp | Morgan Stanley | (1.611) | (502) | Russel Metals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (161) |
| (2.257) | Open Text Corp | Goldman Sachs | (4.784) | (390) | Russel Metals Inc | Goldman Sachs | (106) |
| (796) | Open Text Corp | Morgan Stanley | (863) | (283) | Sandstorm Gold Ltd | Goldman Sachs | (98) |
| (92) | Orla Mining Ltd | Goldman Sachs | 13 | 2.845 | Saputo Inc | Bank of America Merrill Lynch | 631 |
| 1.036 | Osisko Gold Royalties Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 688 | 1.229 | Saputo Inc | Goldman Sachs | (57) |
| 696 | Osisko Gold Royalties Ltd | Goldman Sachs | 462 | 1.325 | Saputo Inc | Morgan Stanley | 807 |
| 1.828 | Osisko Gold Royalties Ltd | Morgan Stanley | (853) | 51 | Savaria Corp | Goldman Sachs | 36 |
| 167 | Osisko Mining Inc | Goldman Sachs | (4) | 820 | Seabridge Gold Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6 |
| 1.609 | Ovintiv Inc | Bank of America Merrill Lynch | 18.831 | 461 | Seabridge Gold Inc | Goldman Sachs | 4 |
| 790 | Ovintiv Inc | Goldman Sachs | 9.678 | 88 | Secure Energy Services Inc | Goldman Sachs | 29 |
| 2.869 | Ovintiv Inc | Morgan Stanley | 23.700 | | | | |
| (464) | Pan American Silver Corp | Goldman Sachs | (136) | | | | |
| (130) | Pan American Silver Corp | Morgan Stanley | 52 | | | | |
| (136) | Paramount Resources Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (541) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|---|---------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---|
| Kanada Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| (3.355) | Shaw Communications Inc 'B' | Goldman Sachs | (3.251) | (764) | Tourmaline Oil Corp | Morgan Stanley | (2.132) |
| (64) | Sienna Senior Living Inc | Bank of America Merrill Lynch | (11) | (614) | TransAlta Renewables Inc | Bank of America Merrill Lynch | 126 |
| 30 | Sierra Wireless Inc | Bank of America Merrill Lynch | 24 | (556) | TransAlta Renewables Inc | Goldman Sachs | 114 |
| 1.717 | Silvercorp Metals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 136 | (44) | Transcontinental Inc 'A' | Goldman Sachs | (9) |
| 665 | Silvercorp Metals Inc | Goldman Sachs | 53 | (3.276) | Tricon Residential Inc | Goldman Sachs | 2.436 |
| (76) | SilverCrest Metals Inc | Goldman Sachs | (36) | (36) | Trisura Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 5 |
| 1.336 | Slate Grocery 'U' (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 380 | 519 | Turquoise Hill Resources Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 8 |
| 996 | Slate Grocery 'U' (REIT) | Goldman Sachs | 284 | 1.076 | Vermilion Energy Inc | Goldman Sachs | 1.770 |
| (636) | Sleep Country Canada Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 458 | (44) | Victoria Gold Corp | Bank of America Merrill Lynch | (26) |
| (1.254) | SmartCentres (REIT) | Morgan Stanley | (337) | 3.629 | Village Farms International Inc* | Goldman Sachs | (12.202) |
| (130) | SNC-Lavalin Group Inc | Morgan Stanley | 11 | (160) | Wesdome Gold Mines Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (54) |
| 14 | Spin Master Corp | Bank of America Merrill Lynch | 5 | (190) | Wesdome Gold Mines Ltd | Goldman Sachs | (25) |
| (508) | SSR Mining Inc | Goldman Sachs | (52) | (234) | West Fraser Timber Co Ltd | Goldman Sachs | (674) |
| 42 | Stantec Inc | Bank of America Merrill Lynch | 63 | (650) | West Fraser Timber Co Ltd | Morgan Stanley | (2.519) |
| 448 | Stantec Inc | Goldman Sachs | 639 | (231) | Westport Fuel Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5) |
| 507 | Stantec Inc | Morgan Stanley | 477 | (36) | Westshore Terminals Investment Corp | Goldman Sachs | 5 |
| (1.403) | Stelco Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.708) | (493) | Wheaton Precious Metals Corp | Goldman Sachs | 250 |
| (92) | Stella-Jones Inc | Goldman Sachs | (20) | (905) | Whitecap Resources Inc | Bank of America Merrill Lynch | (651) |
| (1.936) | Summit Industrial Income (REIT) | Goldman Sachs | (174) | (1.654) | Whitecap Resources Inc | Morgan Stanley | (1.413) |
| (1.068) | Summit Industrial Income (REIT) | Morgan Stanley | 11 | (23) | Winpak Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 61 |
| (227) | Sun Life Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | (48) | (164) | Winpak Ltd | Goldman Sachs | 433 |
| (3.485) | Sun Life Financial Inc | Morgan Stanley | 3.804 | 410 | WSP Global Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.056 |
| (188) | Suncor Energy Inc | Goldman Sachs | (665) | 159 | WSP Global Inc | Goldman Sachs | 786 |
| 1.187 | SunOpta Inc | Bank of America Merrill Lynch | 535 | 81 | WSP Global Inc | Morgan Stanley | 184 |
| 896 | SunOpta Inc | Goldman Sachs | 404 | 4.886 | Yamana Gold Inc | Morgan Stanley | 386 |
| (944) | Superior Plus Corp | Bank of America Merrill Lynch | (164) | | | | 41.457 |
| (272) | Superior Plus Corp | Goldman Sachs | (47) | Dänemark | | | |
| 1.543 | Tamarack Valley Energy Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 757 | 865 | ALK-Abello A/S | Goldman Sachs | 1.138 |
| 703 | Tamarack Valley Energy Ltd | Goldman Sachs | 345 | 847 | Alm Brand A/S | Bank of America Merrill Lynch | 43 |
| 446 | TC Energy Corp | Goldman Sachs | 356 | (2.588) | Ambu A/S 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (2.427) |
| 1.078 | TC Energy Corp | Morgan Stanley | (495) | (292) | Ambu A/S 'B' | Goldman Sachs | (368) |
| 1.485 | Teck Resources Ltd 'B' | Morgan Stanley | 2.284 | 4 | AP Moller - Maersk A/S 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 236 |
| 15 | TECSYS Inc | Bank of America Merrill Lynch | 46 | (5) | AP Moller - Maersk A/S 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (60) |
| 1.621 | TELUS Corp | Bank of America Merrill Lynch | (29) | (3) | AP Moller - Maersk A/S 'B' | Morgan Stanley | 164 |
| 6.296 | TELUS Corp | Goldman Sachs | (896) | (307) | Carlsberg A/S 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 875 |
| 226 | TELUS Corp | Morgan Stanley | 55 | (397) | Carlsberg A/S 'B' | Morgan Stanley | (1.578) |
| 258 | TFI International Inc | Goldman Sachs | (157) | (24) | Chemometec A/S | Bank of America Merrill Lynch | (252) |
| 61 | TFI International Inc | Morgan Stanley | 169 | (120) | Chr Hansen Holding A/S | Bank of America Merrill Lynch | 117 |
| (91) | Thomson Reuters Corp | Goldman Sachs | 114 | (235) | Chr Hansen Holding A/S | Morgan Stanley | (47) |
| (2.064) | Timbercreek Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (441) | 233 | Coloplast A/S 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (286) |
| (347) | TMX Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (213) | 401 | Coloplast A/S 'B' | Goldman Sachs | (780) |
| (88) | TMX Group Ltd | Goldman Sachs | (60) | 61 | Coloplast A/S 'B' | Morgan Stanley | 44 |
| 1.952 | Topaz Energy Corp | Bank of America Merrill Lynch | 31 | 166 | D/S Norden A/S | Bank of America Merrill Lynch | 359 |
| 1.683 | Topaz Energy Corp | Goldman Sachs | 27 | 104 | D/S Norden A/S | Goldman Sachs | 225 |
| (409) | Topicus.com Inc | Morgan Stanley | 1.307 | 1.512 | Danske Bank A/S | Bank of America Merrill Lynch | 730 |
| (168) | Torex Gold Resources Inc | Goldman Sachs | (21) | 1.066 | Danske Bank A/S | Morgan Stanley | 284 |
| (965) | Toromont Industries Ltd | Morgan Stanley | (1.748) | 567 | Demant A/S | Morgan Stanley | 1.502 |
| 403 | Toronto-Dominion Bank | Bank of America Merrill Lynch | 1.452 | | | | |
| 132 | Toronto-Dominion Bank | Goldman Sachs | 337 | | | | |
| 170 | Toronto-Dominion Bank | Morgan Stanley | 507 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|---|-----------------------------|--------------------------|----------------------------------|---|
| Dänemark Fortsetzung | | | | Dänemark Fortsetzung | | | |
| 32 | Dfds A/S | Goldman Sachs | 1 | 893 | Tryg A/S | Morgan Stanley | 669 |
| 74 | Drilling Co of 1972 A/S | Bank of America Merrill Lynch | 117 | 566 | Vestas Wind Systems A/S | Bank of America Merrill Lynch | 2.202 |
| 20 | Drilling Co of 1972 A/S | Goldman Sachs | 32 | 192 | Vestas Wind Systems A/S | Goldman Sachs | 234 |
| (174) | DSV PANALPINA A/S | Bank of America Merrill Lynch | (1.328) | (359) | Zealand Pharma A/S | Bank of America Merrill Lynch | (1.419) |
| (74) | DSV PANALPINA A/S | Morgan Stanley | (160) | | | | 2.042 |
| 414 | FLSmith & Co A/S | Bank of America Merrill Lynch | 620 | Finnland | | | |
| 918 | FLSmith & Co A/S | Goldman Sachs | 1.375 | (731) | Aktia Bank Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (196) |
| 55 | Genmab A/S | Bank of America Merrill Lynch | 9 | (948) | Aktia Bank Oyj | Goldman Sachs | (254) |
| 257 | GN Store Nord A/S | Bank of America Merrill Lynch | 1.162 | 98 | Anora Group Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (9) |
| 222 | GN Store Nord A/S | Goldman Sachs | 1.004 | 560 | Cargotec Oyj | Bank of America Merrill Lynch | 1.680 |
| 94 | GN Store Nord A/S | Morgan Stanley | 575 | 828 | Cargotec Oyj | Goldman Sachs | 2.484 |
| 336 | H Lundbeck A/S | Bank of America Merrill Lynch | 336 | 104 | Caverion Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (2) |
| 928 | H Lundbeck A/S | Goldman Sachs | 929 | (72) | Citycon Oyj | Goldman Sachs | (3) |
| 1.654 | H Lundbeck A/S | Morgan Stanley | 917 | (231) | Elisa Oyj | Bank of America Merrill Lynch | 267 |
| (118) | ISS A/S | Bank of America Merrill Lynch | (35) | (256) | Elisa Oyj | Goldman Sachs | 296 |
| (745) | ISS A/S | Morgan Stanley | (21) | (398) | Elisa Oyj | Morgan Stanley | 341 |
| 447 | Jyske Bank A/S Reg | Morgan Stanley | 669 | (4.107) | Fortum Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (976) |
| (501) | Matas A/S | Bank of America Merrill Lynch | (588) | (2.843) | Fortum Oyj | Goldman Sachs | (310) |
| (407) | Netcompany Group A/S | Bank of America Merrill Lynch | (1.925) | (1.820) | Fortum Oyj | Morgan Stanley | 320 |
| (129) | NeuroSearch A/S | Goldman Sachs | 130 | 20 | Harvia Oyj | Goldman Sachs | 7 |
| (146) | Nilfisk Holding A/S | Bank of America Merrill Lynch | (27) | (1.171) | Huhtamaki Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (1.480) |
| (33) | NNIT A/S | Bank of America Merrill Lynch | (7) | (1.119) | Huhtamaki Oyj | Goldman Sachs | (1.414) |
| 99 | Novo Nordisk A/S 'B' | Goldman Sachs | 138 | (581) | Huhtamaki Oyj | Morgan Stanley | (753) |
| 284 | Novo Nordisk A/S 'B' | Morgan Stanley | 703 | (184) | Kamux Corp | Bank of America Merrill Lynch | (85) |
| 405 | Novozymes A/S 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 226 | (337) | Kamux Corp | Goldman Sachs | (155) |
| (560) | Orsted A/S | Bank of America Merrill Lynch | (1.408) | (515) | Kemira Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (320) |
| (188) | Orsted A/S | Morgan Stanley | (257) | (795) | Kemira Oyj | Goldman Sachs | (494) |
| (354) | Pandora A/S | Morgan Stanley | (1.927) | (1.080) | Kesko Oyj 'B' | Morgan Stanley | (479) |
| 434 | Per Aarsleff Holding A/S | Bank of America Merrill Lynch | (719) | (950) | Kojamo Oyj | Goldman Sachs | (377) |
| 210 | Per Aarsleff Holding A/S | Goldman Sachs | (348) | (1.680) | Kojamo Oyj | Morgan Stanley | 36 |
| (318) | Ringkjoebing Landbobank A/S | Bank of America Merrill Lynch | (2.061) | 181 | Kone Oyj 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (40) |
| (169) | ROCKWOOL A/S 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (3.468) | 222 | Konecranes Oyj | Bank of America Merrill Lynch | 526 |
| (380) | Royal Unibrew A/S | Bank of America Merrill Lynch | 744 | 609 | Konecranes Oyj | Goldman Sachs | 1.442 |
| (180) | Royal Unibrew A/S | Morgan Stanley | (570) | (1.063) | Metsa Board Oyj 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 296 |
| (950) | Scandinavian Tobacco Group A/S 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 684 | (3.555) | Metsa Board Oyj 'B' | Goldman Sachs | 990 |
| 14 | Schouw & Co A/S | Bank of America Merrill Lynch | 44 | 2.302 | Metso Outotec Oyj | Morgan Stanley | 829 |
| 272 | SimCorp A/S | Bank of America Merrill Lynch | 1.285 | 279 | Musti Group Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (230) |
| 246 | SimCorp A/S | Goldman Sachs | 1.162 | 232 | Musti Group Oyj | Goldman Sachs | (191) |
| 55 | SimCorp A/S | Morgan Stanley | 260 | (312) | Neste Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (809) |
| 93 | Spar Nord Bank A/S | Bank of America Merrill Lynch | 68 | (461) | Neste Oyj | Goldman Sachs | (1.315) |
| 392 | Spar Nord Bank A/S | Goldman Sachs | 200 | (327) | Neste Oyj | Morgan Stanley | (634) |
| 134 | Sydbank A/S | Bank of America Merrill Lynch | 28 | 82 | Nokia Oyj ^{III} | Bank of America Merrill Lynch | — |
| (143) | Topdanmark A/S | Bank of America Merrill Lynch | 91 | 1.428 | Nokia Oyj | Goldman Sachs | 6 |
| 872 | Tryg A/S | Bank of America Merrill Lynch | 678 | 6.242 | Nokia Oyj | Morgan Stanley | 471 |
| 1.413 | Tryg A/S | Goldman Sachs | 1.099 | 4.493 | Nokian Renkaat Oyj | Bank of America Merrill Lynch | 421 |
| | | | | 3.416 | Nokian Renkaat Oyj | Goldman Sachs | 380 |
| | | | | 1.001 | Nokian Renkaat Oyj | Morgan Stanley | (247) |
| | | | | (322) | Oriola Oyj 'B' | Goldman Sachs | 3 |
| | | | | (1.476) | Orion Oyj 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (2.340) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--------------------------|-----------------|---|-------------------------------|--|-----------------|---|
| Finnland Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | | |
| (394) | Orion Oyj 'B' | Morgan Stanley | (30) | 1.089 | ALD SA | Bank of America | |
| 3.052 | Outokumpu Oyj | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (770) |
| | | Merrill Lynch | 1.632 | 4.136 | ALD SA | Goldman Sachs | (2.924) |
| 3.746 | Outokumpu Oyj | Goldman Sachs | 1.807 | 2.033 | ALD SA | Morgan Stanley | (1.394) |
| 11.155 | Outokumpu Oyj | Morgan Stanley | 3.728 | (155) | Alstom SA | Bank of America | |
| (88) | Puuhilo Oyj | Goldman Sachs | 124 | | | Merrill Lynch | (207) |
| (14) | QT Group Oyj | Bank of America | | (906) | Alstom SA | Morgan Stanley | (905) |
| | | Merrill Lynch | (19) | (36) | Altarea SCA (REIT) | Bank of America | |
| (86) | QT Group Oyj | Goldman Sachs | (118) | | | Merrill Lynch | 339 |
| (41) | QT Group Oyj | Morgan Stanley | (54) | (157) | Altarea SCA (REIT) | Goldman Sachs | 1.480 |
| (35) | Remedy Entertainment Oyj | Bank of America | | 105 | Alten SA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (11) | | | Merrill Lynch | 472 |
| (196) | Remedy Entertainment Oyj | Goldman Sachs | (63) | 155 | Alten SA | Goldman Sachs | 697 |
| (10) | Revenio Group Oyj | Bank of America | | 290 | Amundi SA | Morgan Stanley | 746 |
| | | Merrill Lynch | (36) | (1.121) | Aramis Group SAS | Bank of America | |
| 471 | Sampo Oyj 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (84) |
| | | Merrill Lynch | (1.584) | (1.475) | Aramis Group SAS | Goldman Sachs | (111) |
| 1.433 | Sampo Oyj 'A' | Morgan Stanley | (74) | 321 | Arkema SA | Morgan Stanley | (258) |
| (2.519) | Sanoma Oyj | Bank of America | | 1.068 | Atos SE | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (864) | | | Merrill Lynch | 1.613 |
| (229) | Sanoma Oyj | Goldman Sachs | (78) | 376 | Atos SE | Goldman Sachs | 568 |
| (35) | Spinnova Oyj | Goldman Sachs | (19) | 728 | Atos SE | Morgan Stanley | (585) |
| (863) | Stora Enso Oyj 'R' | Morgan Stanley | 231 | 231 | AXA SA | Bank of America | |
| 58 | Talenom Oyj | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 90 |
| | | Merrill Lynch | 52 | 570 | AXA SA | Morgan Stanley | (12) |
| 173 | TietoEVERY Oyj | Goldman Sachs | 104 | (24) | Believe SA | Goldman Sachs | (4) |
| 788 | Tokmanni Group Corp | Bank of America | | (43) | BioMerieux | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (474) | | | Merrill Lynch | (415) |
| 371 | Tokmanni Group Corp | Goldman Sachs | (150) | (21) | BioMerieux | Morgan Stanley | (159) |
| (445) | UPM-Kymmene Oyj | Bank of America | | (745) | BNP Paribas SA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (582) | | | Merrill Lynch | (1.028) |
| (1.033) | UPM-Kymmene Oyj | Goldman Sachs | (898) | (351) | BNP Paribas SA | Goldman Sachs | (357) |
| (3.695) | UPM-Kymmene Oyj | Morgan Stanley | (2.177) | (3.606) | BNP Paribas SA | Morgan Stanley | (4.404) |
| 262 | Uponor Oyj | Bank of America | | (13.426) | Bollere SE | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 202 | | | Merrill Lynch | (2.190) |
| 366 | Uponor Oyj | Goldman Sachs | 282 | (3.876) | Bollere SE | Goldman Sachs | (748) |
| 546 | Valmet Oyj | Bank of America | | (6.253) | Bollere SE | Morgan Stanley | (322) |
| | | Merrill Lynch | 328 | 653 | Bouygues SA | Bank of America | |
| 790 | Valmet Oyj | Goldman Sachs | 474 | | | Merrill Lynch | 329 |
| 1.179 | Valmet Oyj | Morgan Stanley | 1.099 | 314 | Bouygues SA | Goldman Sachs | 158 |
| 3.434 | Wartsila Oyj Abp | Bank of America | | 166 | Bouygues SA | Morgan Stanley | 23 |
| | | Merrill Lynch | 1.471 | (125) | Bureau Veritas SA | Bank of America | |
| 11.148 | Wartsila Oyj Abp | Goldman Sachs | 6.892 | | | Merrill Lynch | (65) |
| 3.825 | Wartsila Oyj Abp | Morgan Stanley | 492 | (1.005) | Bureau Veritas SA | Morgan Stanley | (463) |
| 2.496 | YIT Oyj | Bank of America | | (17) | Capgemini SE | Goldman Sachs | 61 |
| | | Merrill Lynch | 310 | (27) | Carmila SA (REIT) | Bank of America | |
| 5.255 | YIT Oyj | Goldman Sachs | 653 | | | Merrill Lynch | 20 |
| | | | 10.332 | 2.729 | Carrefour SA | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (3.587) |
| | | | | 2.000 | Carrefour SA | Goldman Sachs | (1.330) |
| | | | | 4.923 | Carrefour SA | Morgan Stanley | (2.812) |
| | | | | (1.189) | Cellectis SA | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (764) |
| | | | | (245) | Cellectis SA | Goldman Sachs | (157) |
| | | | | 3 | Cie de L'Odet SE | Morgan Stanley | (58) |
| | | | | (218) | Cie de Saint-Gobain | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (509) |
| | | | | (323) | Cie de Saint-Gobain | Morgan Stanley | (758) |
| | | | | 33 | Cie des Alpes | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 21 |
| | | | | (327) | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | Bank of America | |
| | | | | (490) | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | Merrill Lynch | (263) |
| | | | | | | Goldman Sachs | (394) |
| | | | | (1.048) | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | Morgan Stanley | (4.098) |
| | | | | 620 | Cie Plastic Omnium SA | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 1.063 |
| | | | | 1.800 | Cie Plastic Omnium SA | Goldman Sachs | 3.085 |
| | | | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|------------------------------|-------------------------------|---|-------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|---|
| Frankreich Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | | |
| 1.106 | Cie Plastic Omnium SA | Morgan Stanley | 1.090 | (167) | Gaztransport Et Technigaz SA | Morgan Stanley | 1.023 |
| 234 | Coface SA | Bank of America Merrill Lynch | (286) | 100 | Gecina SA (REIT) | Morgan Stanley | 158 |
| 394 | Coface SA | Goldman Sachs | (481) | (6.980) | Getlink SE | Morgan Stanley | 2.617 |
| 530 | Covivio (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 387 | 31 | Hermes International | Morgan Stanley | 1.943 |
| 584 | Covivio (REIT) | Goldman Sachs | 456 | 490 | ICADE (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.500) |
| 260 | Covivio (REIT) | Morgan Stanley | (292) | 345 | ICADE (REIT) | Goldman Sachs | (1.109) |
| 499 | Credit Agricole SA | Bank of America Merrill Lynch | (259) | 639 | ICADE (REIT) | Morgan Stanley | (1.951) |
| 858 | Credit Agricole SA | Morgan Stanley | (493) | 55 | ID Logistics Group | Bank of America Merrill Lynch | 236 |
| (498) | Danone SA | Goldman Sachs | 971 | 30 | ID Logistics Group | Goldman Sachs | 129 |
| (672) | Danone SA | Morgan Stanley | 147 | 327 | Imerys SA | Bank of America Merrill Lynch | 14 |
| 162 | Dassault Aviation SA | Bank of America Merrill Lynch | 347 | 244 | Imerys SA | Goldman Sachs | 10 |
| 77 | Dassault Aviation SA | Goldman Sachs | 165 | 882 | Interparfums SA | Goldman Sachs | 2.457 |
| 219 | Dassault Aviation SA | Morgan Stanley | 1.290 | 119 | Ipsen SA | Goldman Sachs | — |
| 243 | Dassault Systemes SE | Bank of America Merrill Lynch | 387 | (12) | IPSOS | Goldman Sachs | (14) |
| 57 | Dassault Systemes SE | Goldman Sachs | 91 | (179) | JCDecaux SA | Bank of America Merrill Lynch | (27) |
| 315 | Dassault Systemes SE | Morgan Stanley | 289 | (263) | JCDecaux SA | Goldman Sachs | (39) |
| (1.449) | Derichebourg SA | Bank of America Merrill Lynch | 1.824 | (14) | Kaufman & Broad SA | Goldman Sachs | 4 |
| (504) | Derichebourg SA | Goldman Sachs | 634 | (77) | Kering SA | Bank of America Merrill Lynch | (4.284) |
| 366 | Eiffage SA | Bank of America Merrill Lynch | 400 | (25) | Kering SA | Goldman Sachs | (810) |
| 754 | Eiffage SA | Goldman Sachs | 915 | 1.079 | Klepierre SA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (771) |
| 2.024 | Electricite de France SA | Bank of America Merrill Lynch | (711) | 1.991 | Klepierre SA (REIT) | Goldman Sachs | (976) |
| 366 | Electricite de France SA | Goldman Sachs | (79) | 1.558 | Klepierre SA (REIT) | Morgan Stanley | (1.305) |
| 2.000 | Elior Group SA | Bank of America Merrill Lynch | (167) | (120) | Korian SA | Bank of America Merrill Lynch | 94 |
| 1.614 | Elior Group SA | Goldman Sachs | (168) | (575) | Korian SA | Goldman Sachs | 450 |
| (326) | Elis SA | Bank of America Merrill Lynch | (97) | 271 | La Francaise des Jeux SAEM | Bank of America Merrill Lynch | (128) |
| (331) | Elis SA | Goldman Sachs | (72) | 247 | La Francaise des Jeux SAEM | Goldman Sachs | 13 |
| 7.621 | Engie SA | Bank of America Merrill Lynch | 1.526 | 249 | La Francaise des Jeux SAEM | Morgan Stanley | (128) |
| 3.553 | Engie SA | Goldman Sachs | (520) | 121 | Legrand SA | Bank of America Merrill Lynch | 298 |
| 6.201 | Engie SA | Morgan Stanley | (2.883) | 267 | Legrand SA | Goldman Sachs | 658 |
| 8 | Equasens | Bank of America Merrill Lynch | 34 | 20 | Legrand SA | Morgan Stanley | 21 |
| 28 | Eramet | Goldman Sachs | 96 | (23) | LNA Sante SA | Bank of America Merrill Lynch | (11) |
| 46 | Esker SA | Bank of America Merrill Lynch | 79 | (9) | L'Oreal SA | Bank of America Merrill Lynch | (12) |
| 72 | Esker SA | Goldman Sachs | 123 | (140) | L'Oreal SA | Goldman Sachs | (187) |
| (63) | EssilorLuxottica SA | Bank of America Merrill Lynch | (191) | (71) | L'Oreal SA | Morgan Stanley | (1.175) |
| (641) | EssilorLuxottica SA | Goldman Sachs | (681) | (34) | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | Bank of America Merrill Lynch | (1.159) |
| (323) | EssilorLuxottica SA | Morgan Stanley | (294) | (22) | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | Goldman Sachs | (1.102) |
| 558 | Eurazeo SE | Bank of America Merrill Lynch | 606 | (24) | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | Morgan Stanley | (949) |
| 207 | Eurazeo SE | Goldman Sachs | 155 | (861) | Maisons du Monde SA | Bank of America Merrill Lynch | 4.778 |
| 581 | Eurazeo SE | Morgan Stanley | 685 | (253) | Maisons du Monde SA | Goldman Sachs | 1.404 |
| (1.868) | Euroapi SA | Goldman Sachs | (1.166) | 214 | Manitou BF SA | Goldman Sachs | 275 |
| (223) | Eurofins Scientific SE | Goldman Sachs | (564) | (30) | McPhy Energy SA | Bank of America Merrill Lynch | 22 |
| (343) | Euronext NV | Morgan Stanley | (1.580) | (256) | McPhy Energy SA | Goldman Sachs | 188 |
| (1.072) | Eutelsat Communications SA | Bank of America Merrill Lynch | (134) | (1.735) | Mercialys SA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (706) |
| (1.040) | Eutelsat Communications SA | Goldman Sachs | (165) | (803) | Mercialys SA (REIT) | Goldman Sachs | (364) |
| 2.761 | Exclusive Networks SA | Bank of America Merrill Lynch | (3.490) | (21) | Mersen SA | Goldman Sachs | (37) |
| 365 | Faurecia SE | Goldman Sachs | 1.384 | (1.023) | Metropole Television SA | Bank of America Merrill Lynch | (669) |
| 653 | Faurecia SE | Morgan Stanley | 1.497 | (25) | Metropole Television SA | Goldman Sachs | (16) |
| (12) | Fnac Darty SA | Goldman Sachs | 12 | (484) | Neoen SA | Morgan Stanley | 550 |
| (188) | Gaztransport Et Technigaz SA | Bank of America Merrill Lynch | 302 | | | | |
| (129) | Gaztransport Et Technigaz SA | Goldman Sachs | 359 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|--------------------------|-------------------------------|---|-------------------------------|----------------------------|-------------------------------|---|
| Frankreich Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | | |
| 144 | Nexans SA | Bank of America Merrill Lynch | 2.484 | (348) | STMicroelectronics NV | Bank of America Merrill Lynch | (121) |
| 741 | Nexity SA | Bank of America Merrill Lynch | (2.270) | (1.753) | STMicroelectronics NV | Goldman Sachs | (549) |
| 452 | Nexity SA | Goldman Sachs | (1.421) | (247) | STMicroelectronics NV | Morgan Stanley | (205) |
| (2.655) | Orange SA | Goldman Sachs | 216 | (315) | Technip Energies NV | Bank of America Merrill Lynch | (26) |
| (2.352) | Orange SA | Morgan Stanley | 126 | (591) | Technip Energies NV | Goldman Sachs | 92 |
| 246 | Orpea SA | Goldman Sachs | (561) | (55) | Teleperformance | Morgan Stanley | (171) |
| 87 | Pernod Ricard SA | Bank of America Merrill Lynch | 454 | (457) | Television Francaise 1 | Bank of America Merrill Lynch | (69) |
| 22 | Pernod Ricard SA | Morgan Stanley | (2) | 43 | Thales SA | Bank of America Merrill Lynch | (60) |
| 252 | Publicis Groupe SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.085) | 378 | Thales SA | Morgan Stanley | (385) |
| 361 | Publicis Groupe SA | Goldman Sachs | (1.555) | (377) | TotalEnergies SE | Goldman Sachs | (1.543) |
| 184 | Publicis Groupe SA | Morgan Stanley | (631) | (57) | Trigano SA | Bank of America Merrill Lynch | 55 |
| (29) | Quadiant SA | Bank of America Merrill Lynch | (27) | (40) | Trigano SA | Goldman Sachs | 39 |
| 152 | Remy Cointreau SA | Bank of America Merrill Lynch | (456) | 102 | Ubisoft Entertainment SA | Bank of America Merrill Lynch | 479 |
| 158 | Remy Cointreau SA | Goldman Sachs | (474) | 42 | Ubisoft Entertainment SA | Goldman Sachs | 197 |
| 127 | Remy Cointreau SA | Morgan Stanley | 558 | 66 | Ubisoft Entertainment SA | Morgan Stanley | 11 |
| 480 | Renault SA | Bank of America Merrill Lynch | 34 | (2.457) | Universal Music Group BV | Morgan Stanley | 250 |
| (1.549) | Rexel SA | Bank of America Merrill Lynch | (2.423) | 308 | Valeo SA | Bank of America Merrill Lynch | 836 |
| (433) | Rexel SA | Morgan Stanley | (195) | 986 | Valeo SA | Goldman Sachs | 2.678 |
| 1.437 | Rubis SCA | Morgan Stanley | 1.047 | (168) | Vallourec SA | Bank of America Merrill Lynch | 175 |
| 31 | Safran SA | Goldman Sachs | (2) | (1.777) | Vallourec SA | Morgan Stanley | 1.266 |
| 591 | Safran SA | Morgan Stanley | 190 | (795) | Veolia Environnement SA | Goldman Sachs | (511) |
| (226) | Sanofi | Bank of America Merrill Lynch | 402 | (2.528) | Veolia Environnement SA | Morgan Stanley | (650) |
| (226) | Sanofi | Goldman Sachs | 802 | (855) | Verallia SA | Bank of America Merrill Lynch | (447) |
| (493) | Sanofi | Morgan Stanley | 2.482 | (709) | Verallia SA | Goldman Sachs | (362) |
| (62) | Sartorius Stedim Biotech | Bank of America Merrill Lynch | (1.561) | 1.240 | Vicat SA | Bank of America Merrill Lynch | 664 |
| (85) | Sartorius Stedim Biotech | Goldman Sachs | (2.140) | 1.098 | Vicat SA | Goldman Sachs | 588 |
| (38) | Sartorius Stedim Biotech | Morgan Stanley | (586) | 38 | Vilmorin & Cie SA | Bank of America Merrill Lynch | 24 |
| (265) | Schneider Electric SE | Bank of America Merrill Lynch | (454) | 25 | Vilmorin & Cie SA | Goldman Sachs | 16 |
| (1.407) | Schneider Electric SE | Goldman Sachs | (3.805) | 986 | Vinci SA | Bank of America Merrill Lynch | (926) |
| (1.303) | Schneider Electric SE | Morgan Stanley | (3.605) | 1.938 | Vinci SA | Goldman Sachs | (4.888) |
| (237) | SEB SA | Bank of America Merrill Lynch | 1.168 | 203 | Vinci SA | Morgan Stanley | 84 |
| (149) | SEB SA | Goldman Sachs | 734 | 5 | Virbac SA | Bank of America Merrill Lynch | 91 |
| (272) | SEB SA | Morgan Stanley | 466 | 10 | Virbac SA | Goldman Sachs | 182 |
| 1.146 | SES SA | Goldman Sachs | 466 | 2.911 | Vivendi SE | Morgan Stanley | (296) |
| 50 | SES-imagotag SA | Bank of America Merrill Lynch | 198 | (1.304) | Volitalia SA Reg | Bank of America Merrill Lynch | (552) |
| 71 | SES-imagotag SA | Goldman Sachs | 281 | 141 | Wendel SE | Goldman Sachs | 826 |
| 2.060 | SMCP SA | Bank of America Merrill Lynch | 452 | 252 | Wendel SE | Morgan Stanley | 1.386 |
| 1.961 | SMCP SA | Goldman Sachs | 431 | (603) | Worldline SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.318) |
| (26) | Societe BIC SA | Bank of America Merrill Lynch | 114 | (1.060) | Worldline SA | Morgan Stanley | (136) |
| (10) | Societe BIC SA | Goldman Sachs | 41 | (465) | X-Fab Silicon Foundries SE | Bank of America Merrill Lynch | (229) |
| 1.666 | Societe Generale SA | Bank of America Merrill Lynch | 2.003 | (67) | X-Fab Silicon Foundries SE | Goldman Sachs | (33) |
| 306 | Societe Generale SA | Goldman Sachs | 606 | | | | (37.484) |
| 2.496 | Societe Generale SA | Morgan Stanley | (1.094) | Deutschland | | | |
| (190) | Sodexo SA | Morgan Stanley | 484 | 343 | 1&1 Drillisch AG | Bank of America Merrill Lynch | 11 |
| (132) | SOITEC | Morgan Stanley | (35) | 734 | 1&1 Drillisch AG | Goldman Sachs | 24 |
| 15 | Somfy SA | Bank of America Merrill Lynch | (26) | 724 | 1&1 Drillisch AG | Morgan Stanley | 217 |
| (23) | Sopra Steria Group | Bank of America Merrill Lynch | (202) | (116) | Aareal Bank AG | Bank of America Merrill Lynch | (82) |
| (19) | Sopra Steria Group | Goldman Sachs | (167) | (58) | About You Holding SE | Bank of America Merrill Lynch | 20 |
| 536 | SPIE SA | Bank of America Merrill Lynch | 448 | (108) | About You Holding SE | Goldman Sachs | (3) |
| 556 | SPIE SA | Goldman Sachs | 465 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------|---|-----------------|---|--------------------------------|---------------------------------|-----------------|---|
| Deutschland Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| 9 | Adesso SE | Bank of America | | 339 | CANCOM SE | Goldman Sachs | 708 |
| | | Merrill Lynch | 44 | (143) | Carl Zeiss Meditec AG | Bank of America | |
| 105 | Adesso SE | Goldman Sachs | 517 | | | Merrill Lynch | (743) |
| (105) | Adidas AG | Bank of America | | (186) | Carl Zeiss Meditec AG | Goldman Sachs | (966) |
| | | Merrill Lynch | (1.392) | (117) | Carl Zeiss Meditec AG | Morgan Stanley | (389) |
| (520) | Adidas AG | Morgan Stanley | (5.225) | 23 | Cewe Stiftung & Co KGaA | Bank of America | |
| (18) | Allianz SE Reg | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 91 |
| | | Merrill Lynch | 24 | 7 | Cewe Stiftung & Co KGaA | Goldman Sachs | 28 |
| (125) | Allianz SE Reg | Goldman Sachs | 535 | 8.352 | Commerzbank AG | Bank of America | |
| (37) | Allianz SE Reg | Morgan Stanley | 164 | | | Merrill Lynch | 13.922 |
| (5) | Amadeus Fire AG | Bank of America | | 4.126 | Commerzbank AG | Goldman Sachs | 6.877 |
| | | Merrill Lynch | (42) | 7.499 | Commerzbank AG | Morgan Stanley | 2.699 |
| 540 | Aroundtown SA | Bank of America | | 67 | CompuGroup Medical SE & Co KGaA | | |
| | | Merrill Lynch | (197) | | | Goldman Sachs | 176 |
| 10.951 | Aroundtown SA | Morgan Stanley | (5.185) | (14) | Continental AG | Goldman Sachs | (93) |
| 28 | Atoss Software AG | Bank of America | | (247) | Continental AG | Morgan Stanley | (1.058) |
| | | Merrill Lynch | 150 | (201) | Covestro AG | Goldman Sachs | (122) |
| 39 | Atoss Software AG | Goldman Sachs | 209 | 47 | CropEnergies AG | Bank of America | |
| (65) | AURELIUS Equity Opportu- nities SE & Co KGaA | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (84) |
| (53) | AURELIUS Equity Opportu- nities SE & Co KGaA | Merrill Lynch | (178) | 51 | CropEnergies AG | Goldman Sachs | (11) |
| (62) | Aurubis AG | Goldman Sachs | (145) | 186 | CTS Eventim AG & Co KGaA | | |
| | | Bank of America | (185) | 342 | Daimler Truck Holding AG | Morgan Stanley | (648) |
| (62) | Aurubis AG | Merrill Lynch | (185) | | | Bank of America | 295 |
| (147) | Aurubis AG | Goldman Sachs | 60 | 1.126 | Daimler Truck Holding AG | Merrill Lynch | 1.044 |
| (1.511) | Auto1 Group SE | Morgan Stanley | (1.805) | 394 | Daimler Truck Holding AG | Goldman Sachs | 566 |
| | | Merrill Lynch | (1.635) | 7 | Datagroup SE | Morgan Stanley | |
| (1.369) | Auto1 Group SE | Goldman Sachs | (1.635) | | | Bank of America | 39 |
| (1.333) | Auto1 Group SE | Morgan Stanley | (179) | 10 | Datagroup SE | Merrill Lynch | 56 |
| (407) | BASF SE | Bank of America | | (1.346) | Delivery Hero SE | Goldman Sachs | |
| | | Merrill Lynch | (928) | | | Bank of America | (8.818) |
| (213) | BASF SE | Goldman Sachs | (472) | (570) | Delivery Hero SE | Goldman Sachs | (3.664) |
| (2.387) | BASF SE | Morgan Stanley | (3.527) | (1.522) | Delivery Hero SE | Morgan Stanley | (9.784) |
| (5) | Basler AG | Bank of America | | 43 | Dermapharm Holding SE | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (79) | | | Merrill Lynch | (39) |
| (478) | Bayer AG Reg | Morgan Stanley | (609) | 64 | Dermapharm Holding SE | Goldman Sachs | (58) |
| 43 | Bayerische Motoren Werke AG | Bank of America | | 3.363 | Deutsche Bank AG Reg | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 103 | | | Merrill Lynch | 3.898 |
| 625 | Bayerische Motoren Werke AG | Goldman Sachs | 1.841 | 2.674 | Deutsche Bank AG Reg | Goldman Sachs | 3.356 |
| 62 | Bayerische Motoren Werke AG | Morgan Stanley | 144 | 2.832 | Deutsche Bank AG Reg | Morgan Stanley | 1.347 |
| (192) | Bayerische Motoren Werke AG (Pref) | Goldman Sachs | (833) | (16) | Deutsche Beteiligungs AG | Bank of America | |
| (181) | BayWa AG | Bank of America | (145) | | | Merrill Lynch | (27) |
| (340) | BayWa AG | Merrill Lynch | (273) | 41 | Deutsche EuroShop AG | Goldman Sachs | 274 |
| (815) | Bechtle AG | Bank of America | (914) | (1.498) | Deutsche Lufthansa AG Reg | | |
| | | Merrill Lynch | (278) | | | Goldman Sachs | (167) |
| (385) | Bechtle AG | Goldman Sachs | (126) | 368 | Deutsche Pfandbriefbank AG | Bank of America | (247) |
| (427) | Bechtle AG | Morgan Stanley | 217 | 132 | Deutsche Pfandbriefbank AG | Merrill Lynch | (40) |
| 30 | Befesa SA | Bank of America | 362 | (3.317) | Deutsche Post AG Reg | Goldman Sachs | |
| | | Merrill Lynch | (113) | | | Bank of America | (1.047) |
| 50 | Befesa SA | Goldman Sachs | (86) | (572) | Deutsche Post AG Reg | Merrill Lynch | 57 |
| 377 | Beiersdorf AG | Bank of America | 6 | (2.132) | Deutsche Post AG Reg | Goldman Sachs | (382) |
| | | Merrill Lynch | 6 | (156) | Deutsche Telekom AG Reg | Morgan Stanley | (86) |
| 288 | Beiersdorf AG | Goldman Sachs | (86) | | | Merrill Lynch | (4.574) |
| 296 | Beiersdorf AG | Morgan Stanley | (77) | (7.138) | Deutsche Telekom AG Reg | Bank of America | |
| (32) | Bike24 Holding AG | Goldman Sachs | (346) | (242) | Deutsche Wohnen SE | Morgan Stanley | 125 |
| 335 | Bilfinger SE | Bank of America | 674 | | | Merrill Lynch | 62 |
| | | Merrill Lynch | 216 | | | Goldman Sachs | 397 |
| 372 | Bilfinger SE | Goldman Sachs | 189 | (37) | DIC Asset AG | Morgan Stanley | 156 |
| (119) | Borussia Dortmund GmbH & Co KGaA | Bank of America | (43) | (8) | Draegerwerk AG & Co KGaA | Bank of America | (5) |
| | | Merrill Lynch | 85 | | | Merrill Lynch | — |
| 36 | Brenntag SE | Bank of America | (104) | | Draegerwerk AG & Co KGaA | Goldman Sachs | — |
| | | Merrill Lynch | | | | Bank of America | |
| 516 | CANCOM SE | Bank of America | 1.056 | | Draegerwerk AG & Co KGaA (Pref) | Merrill Lynch | (28) |
| | | Merrill Lynch | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------|--|-------------------------------|---|--------------------------------|---------------------------------|-------------------------------|---|
| Deutschland Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| 282 | Duerr AG | Bank of America Merrill Lynch | 248 | (2.249) | Hamborner AG (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (120) |
| 489 | Duerr AG | Goldman Sachs | 430 | (1.078) | Hamborner AG (REIT) | Goldman Sachs | (58) |
| (62) | DWS Group GmbH & Co KGaA | Goldman Sachs | (89) | 77 | Hamburger Hafen und Logistik AG | Bank of America Merrill Lynch | 35 |
| (195) | DWS Group GmbH & Co KGaA | Morgan Stanley | 33 | 30 | Hamburger Hafen und Logistik AG | Goldman Sachs | 14 |
| 5.010 | E.ON SE | Bank of America Merrill Lynch | (2.186) | 247 | Hannover Rueck SE | Morgan Stanley | 198 |
| 5.057 | E.ON SE | Goldman Sachs | (2.707) | (75) | HeidelbergCement AG | Goldman Sachs | 29 |
| 2.654 | E.ON SE | Morgan Stanley | (1.788) | 242 | Heidelberger Druckmaschinen AG | Goldman Sachs | 32 |
| 122 | Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG | Bank of America Merrill Lynch | 193 | (295) | Hella GmbH & Co KGaA | Goldman Sachs | (779) |
| 171 | Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG | Goldman Sachs | 273 | (223) | Hella GmbH & Co KGaA | Morgan Stanley | (494) |
| 4 | Einhell Germany AG (Pref) | Goldman Sachs | 14 | 327 | HelloFresh SE | Morgan Stanley | 23 |
| 8 | Elmos Semiconductor SE | Bank of America Merrill Lynch | 2 | 34 | Henkel AG & Co KGaA | Bank of America Merrill Lynch | (31) |
| 535 | ElringKlinger AG | Bank of America Merrill Lynch | 338 | 224 | Henkel AG & Co KGaA | Goldman Sachs | (204) |
| 1.319 | ElringKlinger AG | Goldman Sachs | 834 | 76 | Henkel AG & Co KGaA | Morgan Stanley | 8 |
| 477 | Encavis AG | Bank of America Merrill Lynch | 453 | (225) | Henkel AG & Co KGaA (Pref) | Bank of America Merrill Lynch | 145 |
| 470 | Encavis AG | Goldman Sachs | 498 | (297) | Henkel AG & Co KGaA (Pref) | Goldman Sachs | (162) |
| 237 | Encavis AG | Morgan Stanley | (18) | (71) | Henkel AG & Co KGaA (Pref) | Morgan Stanley | (18) |
| 10 | Energiekontor AG | Goldman Sachs | 88 | 1.533 | Hensoldt AG | Goldman Sachs | 82 |
| 586 | Evonik Industries AG | Morgan Stanley | (383) | 500 | HOCHTIEF AG | Goldman Sachs | 782 |
| (415) | Evotec SE | Bank of America Merrill Lynch | (809) | 914 | HOCHTIEF AG | Morgan Stanley | 372 |
| (719) | Evotec SE | Morgan Stanley | (840) | (1.111) | Home24 SE | Bank of America Merrill Lynch | (475) |
| (303) | Fielmann AG | Bank of America Merrill Lynch | (818) | (2.906) | Home24 SE | Goldman Sachs | (1.242) |
| (205) | Fielmann AG | Goldman Sachs | (553) | (76) | Hornbach Holding AG & Co KGaA | Bank of America Merrill Lynch | (106) |
| (604) | Fielmann AG | Morgan Stanley | (2.096) | (33) | Hornbach Holding AG & Co KGaA | Goldman Sachs | (46) |
| (350) | flatexDEGIRO AG | Bank of America Merrill Lynch | (135) | 138 | HUGO BOSS AG | Goldman Sachs | (229) |
| (1.240) | flatexDEGIRO AG | Goldman Sachs | (478) | 232 | HUGO BOSS AG | Morgan Stanley | 316 |
| 54 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide | Bank of America Merrill Lynch | 211 | 10 | Hypoport SE | Bank of America Merrill Lynch | (11) |
| 543 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide | Goldman Sachs | 2.117 | (311) | Indus Holding AG | Bank of America Merrill Lynch | (583) |
| 710 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide | Morgan Stanley | 1.415 | (311) | Indus Holding AG | Goldman Sachs | (583) |
| 452 | Freenet AG | Bank of America Merrill Lynch | 575 | (70) | Infineon Technologies AG | Bank of America Merrill Lynch | (16) |
| 2.642 | Freenet AG | Goldman Sachs | 3.925 | (506) | Infineon Technologies AG | Morgan Stanley | (485) |
| 2.181 | Freenet AG | Morgan Stanley | 2.640 | (445) | Instone Real Estate Group SE | Bank of America Merrill Lynch | (610) |
| (187) | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | Goldman Sachs | 20 | (424) | Instone Real Estate Group SE | Goldman Sachs | (581) |
| (100) | Fresenius SE & Co KGaA | Bank of America Merrill Lynch | (30) | (57) | Jenoptik AG | Bank of America Merrill Lynch | (44) |
| (295) | Fresenius SE & Co KGaA | Goldman Sachs | 11 | (36) | Jenoptik AG | Goldman Sachs | (33) |
| (614) | Fresenius SE & Co KGaA | Morgan Stanley | 46 | (43) | JOST Werke AG | Bank of America Merrill Lynch | (90) |
| 378 | FUCHS PETROLUB SE (Pref) | Bank of America Merrill Lynch | 364 | (46) | JOST Werke AG | Goldman Sachs | (96) |
| 352 | FUCHS PETROLUB SE (Pref) | Goldman Sachs | 339 | 99 | Jungheinrich AG (Pref) | Bank of America Merrill Lynch | 221 |
| 1.678 | FUCHS PETROLUB SE (Pref) | Morgan Stanley | 3.020 | 136 | Jungheinrich AG (Pref) | Goldman Sachs | 303 |
| (221) | GEA Group AG | Morgan Stanley | (246) | 743 | K+S AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (2.307) |
| 55 | Gerresheimer AG | Morgan Stanley | 130 | 127 | K+S AG Reg | Goldman Sachs | (237) |
| 402 | GFT Technologies SE | Bank of America Merrill Lynch | 3.553 | 459 | K+S AG Reg | Morgan Stanley | 90 |
| 259 | GFT Technologies SE | Goldman Sachs | 2.260 | 176 | KION Group AG | Bank of America Merrill Lynch | 94 |
| (2.038) | Global Fashion Group SA | Bank of America Merrill Lynch | (114) | 113 | KION Group AG | Goldman Sachs | 85 |
| (1.132) | Global Fashion Group SA | Goldman Sachs | (63) | 193 | KION Group AG | Morgan Stanley | 52 |
| (952) | Grand City Properties SA | Bank of America Merrill Lynch | (135) | 1.158 | Kloekner & Co SE | Goldman Sachs | 1.265 |
| (488) | Grand City Properties SA | Goldman Sachs | (96) | 58 | Knorr-Bremse AG | Bank of America Merrill Lynch | 79 |
| | | | | 246 | Knorr-Bremse AG | Morgan Stanley | (358) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------|-------------------------|-----------------|---|--------------------------------|-------------------------|-----------------|---|
| Deutschland Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| (26) | Koenig & Bauer AG | Goldman Sachs | (21) | (206) | QIAGEN NV | Bank of America | |
| 35 | Krones AG | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 170 |
| | | Merrill Lynch | 124 | 57 | Rational AG | Bank of America | |
| 238 | Krones AG | Goldman Sachs | 841 | | | Merrill Lynch | 3.969 |
| 149 | LANXESS AG | Goldman Sachs | 1.199 | 50 | Rational AG | Morgan Stanley | 3.080 |
| 260 | LANXESS AG | Morgan Stanley | 1.805 | 371 | Rheinmetall AG | Morgan Stanley | 994 |
| 469 | LEG Immobilien AG | Bank of America | | 513 | RTL Group SA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (2.001) | | | Merrill Lynch | 703 |
| 215 | LEG Immobilien AG | Goldman Sachs | (968) | 547 | RTL Group SA | Goldman Sachs | 750 |
| 167 | LEG Immobilien AG | Morgan Stanley | (635) | 381 | RTL Group SA | Morgan Stanley | 294 |
| (238) | Medios AG | Goldman Sachs | (676) | 1.592 | RWE AG | Bank of America | |
| (89) | Mercedes-Benz Group AG | Goldman Sachs | (195) | | | Merrill Lynch | (1.168) |
| (264) | Merck KGaA | Bank of America | | 409 | RWE AG | Morgan Stanley | (985) |
| | | Merrill Lynch | (394) | 119 | S&T AG | Bank of America | |
| (140) | Merck KGaA | Goldman Sachs | (397) | | | Merrill Lynch | (48) |
| (198) | Merck KGaA | Morgan Stanley | 379 | 986 | S&T AG | Goldman Sachs | (401) |
| (166) | METRO AG | Bank of America | | (118) | SAF-Holland SE | Goldman Sachs | (21) |
| | | Merrill Lynch | (19) | 51 | Salzgitter AG | Bank of America | |
| (658) | METRO AG | Morgan Stanley | (367) | | | Merrill Lynch | 229 |
| (105) | Mister Spex SE | Goldman Sachs | (32) | 332 | Salzgitter AG | Goldman Sachs | 1.494 |
| 3.562 | MLP SE | Goldman Sachs | 1.679 | 65 | Salzgitter AG | Morgan Stanley | 71 |
| (91) | MorphoSys AG | Bank of America | | (52) | Sartorius AG (Pref) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (278) | | | Merrill Lynch | (1.833) |
| 23 | MTU Aero Engines AG | Goldman Sachs | 108 | (24) | Sartorius AG (Pref) | Morgan Stanley | (828) |
| 172 | MTU Aero Engines AG | Morgan Stanley | 544 | 3.652 | Schaeffler AG (Pref) | Goldman Sachs | 1.271 |
| 63 | Muenchener | | | 411 | Scout24 AG | Goldman Sachs | 731 |
| | Rueckversicherungs- | | | 123 | Scout24 AG | Morgan Stanley | 53 |
| | Gesellschaft AG in | | | (6) | Secunet Security | Bank of America | |
| | Muenchen Reg | Bank of America | 81 | | Networks AG | Merrill Lynch | 42 |
| 66 | Muenchener | | | (5) | Secunet Security | | |
| | Rueckversicherungs- | | | | Networks AG | Goldman Sachs | 35 |
| | Gesellschaft AG in | | | (1.047) | SGL Carbon SE | Bank of America | |
| | Muenchen Reg | Goldman Sachs | 183 | | | Merrill Lynch | (538) |
| 32 | Muenchener | | | (3.065) | SGL Carbon SE | Goldman Sachs | (1.576) |
| | Rueckversicherungs- | | | (418) | Shop Apotheke Europe NV | Goldman Sachs | (7.344) |
| | Gesellschaft AG in | | | 205 | Siemens AG Reg | Morgan Stanley | 1.427 |
| | Muenchen Reg | Morgan Stanley | 158 | 181 | Siemens Energy AG | Bank of America | |
| 5 | Nagarro SE | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 211 |
| | | Merrill Lynch | 52 | 233 | Siemens Energy AG | Goldman Sachs | 180 |
| 84 | Nagarro SE | Goldman Sachs | 332 | 1.721 | Siemens Energy AG | Morgan Stanley | 2.092 |
| 339 | Nemetschek SE | Bank of America | | (349) | Siemens Healthineers AG | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.010 | | | Merrill Lynch | (314) |
| 430 | Nemetschek SE | Goldman Sachs | 1.281 | (724) | Siemens Healthineers AG | Goldman Sachs | (652) |
| 406 | Nemetschek SE | Morgan Stanley | 1.061 | (257) | Siltronic AG | Goldman Sachs | (1.005) |
| (3) | New Work SE | Bank of America | | (25) | Sixt SE | Goldman Sachs | (169) |
| | | Merrill Lynch | (6) | (7) | Sixt SE (Pref) | Bank of America | |
| 1.788 | Nordex SE | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (17) |
| | | Merrill Lynch | (256) | 28 | SMA Solar Technology AG | Bank of America | |
| 992 | Nordex SE | Goldman Sachs | 80 | | | Merrill Lynch | 34 |
| 932 | Nordex SE | Morgan Stanley | (688) | 299 | SMA Solar Technology AG | Goldman Sachs | 365 |
| 271 | Norma Group SE | Bank of America | | 127 | Software AG | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (81) | | | Merrill Lynch | 294 |
| 648 | Norma Group SE | Goldman Sachs | (194) | 140 | Software AG | Goldman Sachs | 324 |
| (171) | PATRIZIA AG | Bank of America | | (40) | Stabilus SE | Goldman Sachs | (165) |
| | | Merrill Lynch | 132 | 45 | Steico SE | Bank of America | |
| (1.105) | PATRIZIA AG | Goldman Sachs | 852 | | | Merrill Lynch | (202) |
| 37 | Pfeiffer Vacuum | Bank of America | | 61 | Steico SE | Goldman Sachs | (314) |
| | Technology AG | Merrill Lynch | (24) | (6) | STO SE & Co KGaA (Pref) | Goldman Sachs | 31 |
| 28 | Pfeiffer Vacuum | | | (8) | STRATEC SE | Goldman Sachs | (24) |
| | Technology AG | Goldman Sachs | (18) | 19 | Stroer SE & Co KGaA | Bank of America | |
| (1.159) | PNE AG | Goldman Sachs | (795) | | | Merrill Lynch | (41) |
| 65 | Porsche Automobil | Bank of America | | 99 | Suedzucker AG | Bank of America | |
| | Holding SE (Pref) | Merrill Lynch | 21 | | | Merrill Lynch | (34) |
| 445 | Porsche Automobil | | | (840) | SUSE SA | Goldman Sachs | 1.224 |
| | Holding SE (Pref) | Morgan Stanley | 1.230 | (62) | SUSE SA | Morgan Stanley | (9) |
| 806 | ProSiebenSat.1 Media SE | Goldman Sachs | 72 | 602 | Symrise AG | Bank of America | |
| 463 | ProSiebenSat.1 Media SE | Morgan Stanley | 37 | | | Merrill Lynch | 128 |
| (120) | Puma SE | Bank of America | | 293 | Symrise AG | Goldman Sachs | 295 |
| | | Merrill Lynch | (458) | 80 | Symrise AG | Morgan Stanley | (47) |
| (20) | PVA TePla AG | Goldman Sachs | (27) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------|--------------------------------------|----------------------------------|---|-----------------|--|----------------------------------|---|
| Deutschland Fortsetzung | | | | Hongkong | | | |
| (26) | Synlab AG | Goldman Sachs | (48) | 11.400 | AIA Group Ltd | Morgan Stanley | 3.051 |
| 203 | TAG Immobilien AG | Bank of America Merrill Lynch | (304) | 1.600 | ASM Pacific Technology Ltd | Goldman Sachs | (826) |
| 1.216 | TAG Immobilien AG | Goldman Sachs | (1.279) | 2.000 | ASM Pacific Technology Ltd | Morgan Stanley | (38) |
| 507 | TAG Immobilien AG | Morgan Stanley | (782) | 1.200 | Bank of East Asia Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 12 |
| (358) | Takkt AG | Bank of America Merrill Lynch | 138 | 9.600 | Bank of East Asia Ltd | Goldman Sachs | 98 |
| (1.296) | Takkt AG | Goldman Sachs | 500 | 7.000 | Bank of East Asia Ltd | Morgan Stanley | 54 |
| 807 | Talanx AG | Bank of America Merrill Lynch | (242) | (14.500) | BOC Hong Kong Holdings Ltd | Goldman Sachs | (1.386) |
| 731 | Talanx AG | Goldman Sachs | (219) | 12.500 | Budweiser Brewing Co APAC Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.927 |
| 457 | Talanx AG | Morgan Stanley | (166) | 8.600 | Budweiser Brewing Co APAC Ltd | Goldman Sachs | 1.326 |
| 1.980 | TeamViewer AG | Bank of America Merrill Lynch | 1.135 | 11.100 | Budweiser Brewing Co APAC Ltd | Morgan Stanley | 1.712 |
| 24 | TeamViewer AG | Goldman Sachs | 14 | 2.000 | Cafe de Coral Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 41 |
| (18.921) | Telefonica Deutschland Holding AG | Bank of America Merrill Lynch | 892 | 2.000 | Cathay Pacific Airways Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 107 |
| 2.525 | thyssenkrupp AG | Goldman Sachs | 2.369 | 26.000 | Cathay Pacific Airways Ltd | Goldman Sachs | 1.392 |
| 397 | Traton SE | Bank of America Merrill Lynch | 272 | (9.000) | Champion (REIT) | Goldman Sachs | (161) |
| 851 | Traton SE | Goldman Sachs | 583 | 5.400 | Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd | Goldman Sachs | 550 |
| 229 | Traton SE | Morgan Stanley | 179 | 2.200 | Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd | Morgan Stanley | 275 |
| (580) | Uniper SE | Bank of America Merrill Lynch | 224 | (15.000) | CK Asset Holdings Ltd | Goldman Sachs | 2.876 |
| (1.109) | Uniper SE | Goldman Sachs | 428 | (13.500) | CK Hutchison Holdings Ltd | Goldman Sachs | (1.806) |
| (1.192) | Uniper SE | Morgan Stanley | 1.302 | (7.500) | CK Infrastructure Holdings Ltd | Goldman Sachs | 1.843 |
| (412) | United Internet AG Reg | Goldman Sachs | 93 | (12.500) | CLP Holdings Ltd | Goldman Sachs | (3.345) |
| (1.028) | United Internet AG Reg | Morgan Stanley | (1.277) | 2.000 | Comba Telecom Systems Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 18 |
| 649 | Vantage Towers AG | Bank of America Merrill Lynch | 69 | 14.400 | Dah Sing Banking Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 606 |
| 127 | Vantage Towers AG | Morgan Stanley | 87 | 92.400 | Dah Sing Banking Group Ltd | Goldman Sachs | 3.886 |
| 37 | VERBIO Vereinigte BioEnergie AG | Bank of America Merrill Lynch | 11 | 8.800 | Dah Sing Financial Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 841 |
| 75 | VERBIO Vereinigte BioEnergie AG | Goldman Sachs | (176) | 15.200 | Dah Sing Financial Holdings Ltd | Goldman Sachs | 1.453 |
| 72 | VERBIO Vereinigte BioEnergie AG | Morgan Stanley | (31) | 5.000 | EC Healthcare | Bank of America Merrill Lynch | 172 |
| 15 | Vitesco Technologies Group AG | Goldman Sachs | 35 | 17.000 | EC Healthcare | Goldman Sachs | 585 |
| (115) | Volkswagen AG | Goldman Sachs | (2.162) | (19.800) | ESR Cayman Ltd | Goldman Sachs | (757) |
| (51) | Volkswagen AG | Morgan Stanley | (1.063) | 2.000 | First Pacific Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 92 |
| (139) | Volkswagen AG (Pref) | Bank of America Merrill Lynch | (1.340) | 16.000 | First Pacific Co Ltd | Goldman Sachs | 734 |
| (134) | Volkswagen AG (Pref) | Goldman Sachs | (1.161) | 28.000 | First Pacific Co Ltd | Morgan Stanley | 428 |
| (205) | Volkswagen AG (Pref) | Morgan Stanley | (1.300) | (28.000) | Fortune (REIT) | Goldman Sachs | (785) |
| (1.826) | Vonovia SE | Bank of America Merrill Lynch | (2.954) | (11.000) | Fosun Tourism Group | Goldman Sachs | (1.178) |
| (518) | Vonovia SE | Goldman Sachs | (838) | (9.000) | Galaxy Entertainment Group Ltd | Goldman Sachs | (57) |
| (1.506) | Vonovia SE | Morgan Stanley | (807) | (3.000) | Guotai Junan International Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (15) |
| (34) | Vossloh AG | Bank of America Merrill Lynch | 49 | 10.000 | Haitong International Securities Group Ltd | Morgan Stanley | (13) |
| (12) | Vossloh AG | Goldman Sachs | 17 | (2.000) | Hang Lung Group Ltd | Goldman Sachs | (36) |
| 48 | Wacker Chemie AG | Bank of America Merrill Lynch | 406 | 4.000 | Hang Lung Properties Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 133 |
| 65 | Wacker Chemie AG | Goldman Sachs | 278 | 7.000 | Hang Lung Properties Ltd | Morgan Stanley | 89 |
| 76 | Wacker Chemie AG | Morgan Stanley | 440 | (2.600) | Hang Seng Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 497 |
| (38) | Wacker Neuson SE | Bank of America Merrill Lynch | (22) | (1.000) | Hang Seng Bank Ltd | Goldman Sachs | 191 |
| (1.844) | Westwing Group AG | Goldman Sachs | (40) | 10.500 | Health & Happiness H&H International Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 134 |
| (57) | Wuestenrot & Wuerttembergische AG | Bank of America Merrill Lynch | 41 | 20.500 | Health & Happiness H&H International Holdings Ltd | Goldman Sachs | 261 |
| 140 | Zalando SE | Morgan Stanley | 349 | (13.000) | Henderson Land Development Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.519) |
| (126) | Zeal Network SE | Bank of America Merrill Lynch | (256) | (10.000) | Henderson Land Development Co Ltd | Goldman Sachs | (1.975) |
| (73) | Zeal Network SE | Goldman Sachs | (149) | | | | |
| | | | (10.116) | | | | |
| Gibraltar | | | | | | | |
| 3.582 | 888 Holdings Plc | Goldman Sachs | 830 | | | | |
| | | | 830 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|----------------------------------|---|-----------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| 22.000 | HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | (813) | (4.000) | Pacific Textiles Holdings Ltd | Goldman Sachs | (31) |
| 10.000 | HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd (Unit) | Goldman Sachs | (370) | (127.000) | PCCW Ltd | Goldman Sachs | 4.208 |
| 9.000 | HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd (Unit) | Morgan Stanley | (310) | (9.500) | Power Assets Holdings Ltd | Goldman Sachs | 4.116 |
| (1.500) | HKBN Ltd | Goldman Sachs | (162) | 3.000 | PRADA SpA | Bank of America Merrill Lynch | 1.013 |
| (35.000) | HKT Trust & HKT Ltd (Unit) | Goldman Sachs | 2.052 | 7.500 | PRADA SpA | Goldman Sachs | 2.533 |
| (16.000) | Hong Kong & China Gas Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (877) | 3.000 | PRADA SpA | Morgan Stanley | 1.281 |
| (35.000) | Hong Kong & China Gas Co Ltd | Goldman Sachs | (1.918) | (16.000) | Prosperity (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (61) |
| (700) | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | Goldman Sachs | (1.160) | (64.000) | Prosperity (REIT) | Goldman Sachs | (245) |
| (3.000) | Hongkong & Shanghai Hotels Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (99) | (2.000) | Realord Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | 31 |
| (2.500) | Hongkong & Shanghai Hotels Ltd | Goldman Sachs | (83) | 20.000 | Sa Sa International Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 153 |
| 3.000 | Hysan Development Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 38 | 238.000 | Sa Sa International Holdings Ltd | Goldman Sachs | 1.820 |
| 6.000 | Hysan Development Co Ltd | Goldman Sachs | 76 | (7.600) | Sands China Ltd | Goldman Sachs | 659 |
| 6.000 | Hysan Development Co Ltd | Morgan Stanley | (306) | 4.000 | Shangri-La Asia Ltd | Morgan Stanley | 168 |
| (16.500) | JS Global Lifestyle Co Ltd | Goldman Sachs | 1.177 | 80.000 | Shun Tak Holdings Ltd | Morgan Stanley | 510 |
| (10.000) | Kerry Logistics Network Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (382) | (2.013) | Sino Land Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (46) |
| 5.500 | Kerry Properties Ltd | Goldman Sachs | 105 | (66.214) | Sino Land Co Ltd | Goldman Sachs | (218) |
| 1.000 | Kerry Properties Ltd | Goldman Sachs | 19 | (13.200) | Sisram Medical Ltd | Goldman Sachs | (1.228) |
| 600 | Link (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 203 | 15.000 | SITC International Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 3.727 |
| 6.800 | Link (REIT) | Goldman Sachs | 2.296 | 1.500 | Sun Hung Kai Properties Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 306 |
| 6.750 | L'Occitane International SA | Bank of America Merrill Lynch | 1.290 | 2.000 | Sun Hung Kai Properties Ltd | Goldman Sachs | 408 |
| 2.500 | L'Occitane International SA | Goldman Sachs | 478 | 1.000 | Sun Hung Kai Properties Ltd | Morgan Stanley | 121 |
| 1.000 | Luk Fook Holdings International Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 110 | (14.000) | SUNeVision Holdings Ltd | Goldman Sachs | 321 |
| 4.000 | Luk Fook Holdings International Ltd | Goldman Sachs | 438 | 10.000 | Swire Pacific Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 4.524 |
| (28.000) | Man Wah Holdings Ltd | Goldman Sachs | (2.819) | 11.500 | Swire Pacific Ltd 'A' | Morgan Stanley | 3.297 |
| (4.000) | MECOM Power and Construction Ltd | Goldman Sachs | (7) | 26.400 | Swire Properties Ltd | Morgan Stanley | (135) |
| (200) | MECOM Power and Construction Ltd | Goldman Sachs | (8) | 3.000 | Techtronic Industries Co Ltd | Goldman Sachs | 688 |
| (79.000) | Melco International Development Ltd | Goldman Sachs | (1.611) | 170.000 | United Energy Group Ltd | Goldman Sachs | 4.766 |
| (3.000) | Melco International Development Ltd | Morgan Stanley | (103) | 164.000 | United Energy Group Ltd | Morgan Stanley | 627 |
| 28.400 | MGM China Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (543) | (2.000) | Value Partners Group Ltd | Goldman Sachs | (110) |
| 6.000 | MGM China Holdings Ltd | Goldman Sachs | (115) | (3.000) | Vesync Co Ltd | Goldman Sachs | (103) |
| 9.600 | MGM China Holdings Ltd | Morgan Stanley | 135 | (4.000) | Vitasoy International Holdings Ltd | Morgan Stanley | (82) |
| (19.000) | MTR Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.332 | (40.000) | Vobile Group Ltd | Morgan Stanley | (204) |
| (3.500) | MTR Corp Ltd | Goldman Sachs | 245 | (3.300) | VTech Holdings Ltd | Goldman Sachs | (1.745) |
| 4.000 | New World Development Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 561 | (49.673) | WH Group Ltd | Goldman Sachs | (3.355) |
| 3.000 | New World Development Co Ltd | Goldman Sachs | 421 | (1.000) | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (18) |
| 2.000 | New World Development Co Ltd | Morgan Stanley | 127 | (3.000) | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | Morgan Stanley | (146) |
| 9.000 | Nissin Foods Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 333 | 10.000 | Wynn Macau Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 115 |
| 13.000 | Nissin Foods Co Ltd | Goldman Sachs | 480 | 12.000 | Wynn Macau Ltd | Goldman Sachs | 138 |
| (21.000) | NWS Holdings Ltd | Goldman Sachs | (2.355) | 6.800 | Wynn Macau Ltd | Morgan Stanley | 225 |
| 47.000 | Pacific Basin Shipping Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.318 | 1.000 | Xinyi Glass Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 265 |
| 40.000 | Pacific Basin Shipping Ltd | Morgan Stanley | (816) | 6.000 | Xinyi Glass Holdings Ltd | Morgan Stanley | 581 |
| | | | | 10.500 | Yue Yuen Industrial Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (241) |
| | | | | 27.000 | Yue Yuen Industrial Holdings Ltd | Goldman Sachs | (619) |
| | | | | 36.500 | Yue Yuen Industrial Holdings Ltd | Morgan Stanley | 1.954 |
| | | | | (4.000) | Zensun Enterprises Ltd | Goldman Sachs | (102) |
| | | | | | | | 39.730 |
| | | | | Irland | | | |
| | | | | (6.112) | AIB Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.046) |
| | | | | (7.702) | AIB Group Plc | Goldman Sachs | (1.311) |
| | | | | (294) | CRH Plc | Bank of America Merrill Lynch | (487) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|---------------------------|-----------------|---|---------------------------|--|-----------------|---|
| Irland Fortsetzung | | | | Israel Fortsetzung | | | |
| (77) | CRH Plc | Goldman Sachs | (98) | 4 | Electra Ltd | Bank of America | |
| 182 | Dalata Hotel Group Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 17 |
| | | Merrill Lynch | 54 | 722 | Energix-Renewable | Bank of America | |
| (349) | Flutter Entertainment Plc | Goldman Sachs | (3.533) | | Energies Ltd | Merrill Lynch | (23) |
| 1.949 | Glanbia Plc | Bank of America | | 6.819 | Enlight Renewable | | |
| | | Merrill Lynch | (2.401) | | Energy Ltd | Morgan Stanley | (998) |
| 2.775 | Glanbia Plc | Morgan Stanley | (654) | 12 | FIBI Holdings Ltd | Bank of America | |
| (2.620) | Glenveagh Properties Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (5) |
| | | Merrill Lynch | 98 | (2.048) | First International Bank | | |
| (13.194) | Glenveagh Properties Plc | Goldman Sachs | 495 | | Of Israel Ltd | Goldman Sachs | (307) |
| (19.963) | Hibernia Plc (REIT) | Bank of America | | (414) | Fiverr International Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 337 | | | Merrill Lynch | (2.240) |
| 253 | Kerry Group Plc 'A' | Goldman Sachs | (164) | (225) | Fiverr International Ltd | Goldman Sachs | (1.217) |
| 364 | Kerry Group Plc 'A' | Morgan Stanley | (936) | (648) | Fiverr International Ltd | Morgan Stanley | (2.527) |
| 590 | Kingspan Group Plc | Bank of America | | (5) | Formula Systems 1985 Ltd ^{tr} | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.112 | | | Merrill Lynch | — |
| 212 | Kingspan Group Plc | Goldman Sachs | 400 | (17) | Fox Wixel Ltd | Goldman Sachs | (131) |
| 408 | Kingspan Group Plc | Morgan Stanley | 1.792 | (1.621) | G City Ltd | Goldman Sachs | 1.866 |
| 2.627 | Origin Enterprises Plc | Bank of America | | 1.843 | Gav-Yam Lands Corp Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 211 | | | Merrill Lynch | (663) |
| 1.691 | Origin Enterprises Plc | Goldman Sachs | 136 | 312 | Gav-Yam Lands Corp Ltd | Goldman Sachs | (112) |
| (942) | Ryanair Holdings Plc | Bank of America | | 734 | Gav-Yam Lands Corp Ltd | Morgan Stanley | 440 |
| | | Merrill Lynch | 71 | 161 | Harel Insurance Investments | | |
| (1.635) | Smurfit Kappa Group Plc | Bank of America | | | & Financial Services Ltd | Goldman Sachs | 42 |
| | | Merrill Lynch | (1.220) | 695 | Harel Insurance Investments | | |
| (959) | Smurfit Kappa Group Plc | Goldman Sachs | (699) | | & Financial Services Ltd | Morgan Stanley | 44 |
| 803 | Uniphar Plc | Bank of America | | 19 | Hilan Ltd | Goldman Sachs | 26 |
| | | Merrill Lynch | 413 | (2.112) | ICL Group Ltd | Goldman Sachs | 937 |
| 1.981 | Uniphar Plc | Goldman Sachs | 1.019 | 112 | Isracard Ltd | Goldman Sachs | (53) |
| | | | (6.411) | 617 | Israel Canada T.R Ltd | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 91 |
| | | | | 970 | Israel Canada T.R Ltd | Goldman Sachs | 69 |
| | | | | 43 | Israel Corp Ltd | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (1.716) |
| | | | | 17 | Israel Corp Ltd | Goldman Sachs | (775) |
| | | | | 55 | Israel Corp Ltd | Morgan Stanley | (955) |
| | | | | 5.610 | Israel Discount Bank Ltd 'A' | Morgan Stanley | (1.783) |
| | | | | 22 | Isras Investment Co Ltd | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (83) |
| | | | | 18 | Isras Investment Co Ltd | Goldman Sachs | (118) |
| | | | | (746) | Kenon Holdings Ltd | Morgan Stanley | (693) |
| | | | | 69 | Matrix IT Ltd | Goldman Sachs | (50) |
| | | | | (2.284) | Maytronics Ltd | Goldman Sachs | (4.053) |
| | | | | 22 | Mega Or Holdings Ltd | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 13 |
| | | | | 24 | Menora Mivtachim | | |
| | | | | | Holdings Ltd | Goldman Sachs | 33 |
| | | | | 4.724 | Mivne Real Estate KD Ltd | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (340) |
| | | | | 1.671 | Mivne Real Estate KD Ltd | Goldman Sachs | (70) |
| | | | | 1.918 | Mivne Real Estate KD Ltd | Morgan Stanley | (138) |
| | | | | 181 | Mizrahi Tefahot Bank Ltd | Goldman Sachs | (33) |
| | | | | 62 | Mizrahi Tefahot Bank Ltd | Morgan Stanley | (2) |
| | | | | (1.749) | Naphtha Israel Petroleum | Bank of America | |
| | | | | | Corp Ltd | Merrill Lynch | (786) |
| | | | | (253) | Nayax Ltd | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (70) |
| | | | | 15 | Nova Ltd | Goldman Sachs | 105 |
| | | | | (4.927) | Oil Refineries Ltd | Goldman Sachs | 74 |
| | | | | 50 | One Software | Bank of America | |
| | | | | | Technologies Ltd | Merrill Lynch | 57 |
| | | | | 81 | One Software | | |
| | | | | | Technologies Ltd | Goldman Sachs | 68 |
| | | | | 966 | OPC Energy Ltd | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 307 |
| | | | | 2.027 | OPC Energy Ltd | Goldman Sachs | 438 |
| | | | | 879 | OPC Energy Ltd | Morgan Stanley | (29) |
| | | | | 76 | Partner Communications | Bank of America | |
| | | | | | Co Ltd | Merrill Lynch | (3) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--|-----------------|---|----------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|
| Israel Fortsetzung | | | | Italien Fortsetzung | | | |
| 145 | Paz Oil Co Ltd | Bank of America | | 385 | Banca Generali SpA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (665) | | | Merrill Lynch | 37 |
| 114 | Paz Oil Co Ltd | Goldman Sachs | (646) | 90 | Banca Generali SpA | Goldman Sachs | 9 |
| (584) | Perion Network Ltd | Bank of America | | 275 | Banca Generali SpA | Morgan Stanley | (27) |
| | | Merrill Lynch | (273) | 6.859 | Banca Mediolanum SpA | Bank of America | |
| (194) | Perion Network Ltd | Goldman Sachs | 130 | | | Merrill Lynch | 1.323 |
| 1.108 | Phoenix Holdings Ltd | Bank of America | | 2.425 | Banca Mediolanum SpA | Goldman Sachs | 468 |
| | | Merrill Lynch | 638 | 2.249 | Banca Mediolanum SpA | Morgan Stanley | (29) |
| 1.511 | Phoenix Holdings Ltd | Goldman Sachs | 599 | (3.190) | Banca Popolare di Sondrio | | |
| 2.006 | Phoenix Holdings Ltd | Morgan Stanley | (1.822) | | SCPA | Goldman Sachs | (417) |
| 12 | Prashkovsky Investments and Construction Ltd | Bank of America | | (6.696) | Banco BPM SpA | Morgan Stanley | (940) |
| | | Merrill Lynch | (42) | 93 | Biesse SpA | Bank of America | |
| 5 | Property & Building Corp Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1 |
| | | Merrill Lynch | (111) | 171 | Biesse SpA | Goldman Sachs | 2 |
| 7 | Property & Building Corp Ltd | Goldman Sachs | (34) | 42.314 | BPER Banca | Morgan Stanley | 5.235 |
| 6 | Rami Levy Chain Stores Hashikma Marketing 2006 Ltd | Bank of America | | (416) | Brembo SpA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 19 | 962 | Brunello Cucinelli SpA | Merrill Lynch | (58) |
| 18 | Retailors Ltd | Bank of America | | 1.305 | Buzzi Unicem SpA | Goldman Sachs | (969) |
| | | Merrill Lynch | (6) | (20) | Carel Industries SpA | Morgan Stanley | 447 |
| (82) | Sapiens International Corp NV | Goldman Sachs | (45) | 208 | Cementir Holding NV | Bank of America | (5) |
| (141) | Shapir Engineering and Industry Ltd | Goldman Sachs | 16 | 134 | Cementir Holding NV | Bank of America | |
| (741) | Shapir Engineering and Industry Ltd | Morgan Stanley | 98 | (5.807) | CNH Industrial NV | Merrill Lynch | 7 |
| 12 | Shikun & Binui Ltd | Bank of America | | | | Goldman Sachs | 4 |
| | | Merrill Lynch | (6) | (744) | CNH Industrial NV | Bank of America | (591) |
| 879 | Shikun & Binui Ltd | Goldman Sachs | (327) | (2.133) | Credito Emiliano SpA | Goldman Sachs | (76) |
| 1.988 | Shikun & Binui Ltd | Morgan Stanley | (959) | (1.817) | Credito Emiliano SpA | Bank of America | (914) |
| (9.749) | Shufersal Ltd | Goldman Sachs | 6.400 | 17 | Danieli & C Officine Meccaniche SpA | Merrill Lynch | (779) |
| (1.418) | Strauss Group Ltd | Goldman Sachs | (540) | 429 | Datalogic SpA | Goldman Sachs | 75 |
| 22 | Summit Real Estate Holdings Ltd | Goldman Sachs | (12) | | | Bank of America | |
| 7 | Tadiran Group Ltd | Bank of America | | 402 | Datalogic SpA | Merrill Lynch | 138 |
| | | Merrill Lynch | 23 | 1.353 | Davide Campari-Milano NV | Goldman Sachs | 129 |
| (1.123) | Teva Pharmaceutical Industries Ltd | Bank of America | | 3.078 | Davide Campari-Milano NV | Goldman Sachs | (428) |
| | | Merrill Lynch | (1.266) | 88 | De' Longhi SpA | Morgan Stanley | 336 |
| (4.343) | Teva Pharmaceutical Industries Ltd | Goldman Sachs | (1.323) | 517 | De' Longhi SpA | Bank of America | |
| 67 | YH Dimri Construction & Development Ltd | Bank of America | | (115) | DiaSorin SpA | Merrill Lynch | 59 |
| | | Merrill Lynch | 272 | (261) | DiaSorin SpA | Morgan Stanley | 812 |
| 68 | YH Dimri Construction & Development Ltd | Goldman Sachs | 416 | (122) | Digital Bros SpA | Goldman Sachs | (277) |
| | | | (15.241) | (107) | Digital Bros SpA | Morgan Stanley | (1.468) |
| | | | | 9 | Digital Value SpA | Bank of America | |
| | | | | (4.255) | doValue SpA | Merrill Lynch | 9 |
| (14.573) | A2A SpA | Bank of America | | (1.120) | doValue SpA | Bank of America | (2.461) |
| | | Merrill Lynch | 565 | 341 | EI.En. SpA | Merrill Lynch | (648) |
| (1.214) | A2A SpA | Goldman Sachs | 37 | (2.153) | Enav SpA | Goldman Sachs | 88 |
| (35) | ACEA SpA | Goldman Sachs | (39) | (474) | Enav SpA | Bank of America | |
| 465 | Amplifon SpA | Bank of America | | 12.644 | Enel SpA | Merrill Lynch | (189) |
| | | Merrill Lynch | (1.196) | | | Goldman Sachs | (42) |
| 423 | Amplifon SpA | Goldman Sachs | (1.088) | 16.041 | Enel SpA | Merrill Lynch | 1.002 |
| 490 | Amplifon SpA | Morgan Stanley | (189) | 7.956 | Enel SpA | Goldman Sachs | 1.272 |
| (564) | Anima Holding SpA | Goldman Sachs | 64 | (863) | Eni SpA | Morgan Stanley | (614) |
| (239) | Arnoldo Mondadori Editore SpA | Bank of America | | (16) | ERG SpA | Goldman Sachs | (449) |
| | | Merrill Lynch | (2) | 106 | Esprinet SpA | Goldman Sachs | 15 |
| 361 | Assicurazioni Generali SpA | Goldman Sachs | (342) | (981) | EXOR NV | Bank of America | |
| 1.675 | Assicurazioni Generali SpA | Morgan Stanley | (897) | (72) | EXOR NV | Merrill Lynch | (19) |
| 1.050 | Atlantia SpA | Goldman Sachs | (450) | 26 | Ferrari NV | Goldman Sachs | (3.607) |
| 958 | Atlantia SpA | Morgan Stanley | 62 | | | Morgan Stanley | (151) |
| (1.164) | Autogrill SpA | Morgan Stanley | (292) | 33 | Ferrari NV | Bank of America | |
| 117 | Azimut Holding SpA | Bank of America | | 79 | Ferrari NV | Merrill Lynch | (57) |
| | | Merrill Lynch | (58) | (517) | Fila SpA | Goldman Sachs | 41 |
| 603 | Azimut Holding SpA | Goldman Sachs | (297) | | | Morgan Stanley | 317 |
| 756 | Azimut Holding SpA | Morgan Stanley | 194 | | | Goldman Sachs | (61) |
| 1.310 | Banca Farmafactoring SpA | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 547 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------------------------|--|-------------------------------|---|----------------------------|---------------------------------------|-------------------------------|---|
| Italien Fortsetzung | | | | Italien Fortsetzung | | | |
| 988 | Fincantieri SpA | Bank of America Merrill Lynch | 14 | (2.032) | RAI Way SpA | Goldman Sachs | 229 |
| (2.204) | FinecoBank Banca Fineco SpA | Bank of America Merrill Lynch | (1.605) | 269 | Reply SpA | Bank of America Merrill Lynch | 1.758 |
| (1.264) | FinecoBank Banca Fineco SpA | Goldman Sachs | (921) | 372 | Reply SpA | Goldman Sachs | 2.431 |
| (2.155) | FinecoBank Banca Fineco SpA | Morgan Stanley | (1.004) | 18 | Salcef SpA | Goldman Sachs | 30 |
| (274) | Gruppo MutuiOnline SpA | Bank of America Merrill Lynch | (76) | (214) | Salvatore Ferragamo SpA | Bank of America Merrill Lynch | (71) |
| (126) | Gruppo MutuiOnline SpA | Goldman Sachs | (35) | 58 | Sanlorenzo SpA | Bank of America Merrill Lynch | (208) |
| (2.981) | GVS SpA | Bank of America Merrill Lynch | (1.198) | 172 | Sanlorenzo SpA | Goldman Sachs | (617) |
| (829) | GVS SpA | Goldman Sachs | (333) | (986) | Saras SpA | Goldman Sachs | (195) |
| (2.024) | Hera SpA | Bank of America Merrill Lynch | 56 | 129 | Seco SpA | Bank of America Merrill Lynch | 57 |
| (3.775) | Hera SpA | Goldman Sachs | 274 | 431 | Seco SpA | Goldman Sachs | 192 |
| (5.000) | Hera SpA | Morgan Stanley | 339 | 285 | Sesa SpA | Goldman Sachs | 1.130 |
| (213) | Illimity Bank SpA | Bank of America Merrill Lynch | 9 | 346 | Snam SpA | Bank of America Merrill Lynch | (55) |
| (108) | Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA (REIT) | Goldman Sachs | 6 | 4.700 | Snam SpA | Goldman Sachs | (718) |
| (2.503) | Infrastrutture Wireless Italiane SpA | Bank of America Merrill Lynch | (630) | 468 | Snam SpA | Morgan Stanley | (22) |
| (3.895) | Infrastrutture Wireless Italiane SpA | Morgan Stanley | (793) | (4.326) | Societa Cattolica di Assicurazioni SC | Goldman Sachs | (3.233) |
| (373) | Interpump Group SpA | Bank of America Merrill Lynch | (817) | (4.004) | Stellantis NV | Bank of America Merrill Lynch | (618) |
| (467) | Interpump Group SpA | Morgan Stanley | (1.427) | (1.892) | Stellantis NV | Goldman Sachs | (292) |
| (627) | Iren SpA | Bank of America Merrill Lynch | 4 | (1.115) | Terna Rete Elettrica Nazionale SpA | Bank of America Merrill Lynch | (24) |
| 1.639 | Italgas SpA | Bank of America Merrill Lynch | (571) | (10.746) | Terna Rete Elettrica Nazionale SpA | Goldman Sachs | (230) |
| 1.646 | Italgas SpA | Goldman Sachs | (573) | 1.493 | Tinexta SpA | Goldman Sachs | 5.278 |
| 5.442 | Italgas SpA | Morgan Stanley | (1.078) | (35) | Tod's SpA | Goldman Sachs | (25) |
| (6.791) | Iveco Group NV | Bank of America Merrill Lynch | (3.761) | 2.349 | UniCredit SpA | Bank of America Merrill Lynch | 2.929 |
| (1.001) | Iveco Group NV | Goldman Sachs | (554) | 228 | UniCredit SpA | Goldman Sachs | 284 |
| (5.821) | Iveco Group NV | Morgan Stanley | (1.758) | 6.225 | UniCredit SpA | Morgan Stanley | 3.103 |
| (2.207) | Juventus Football Club SpA | Goldman Sachs | (161) | (1.729) | Unipol Gruppo SpA | Bank of America Merrill Lynch | (128) |
| 946 | Leonardo SpA | Bank of America Merrill Lynch | 323 | (1.163) | Unipol Gruppo SpA | Goldman Sachs | (86) |
| 1.693 | Leonardo SpA | Morgan Stanley | 336 | (3.820) | Unipol Gruppo SpA | Morgan Stanley | (421) |
| 1.466 | Maire Technimont SpA | Bank of America Merrill Lynch | 439 | 4.788 | UnipolSai Assicurazioni SpA | Bank of America Merrill Lynch | (400) |
| 5.484 | Maire Technimont SpA | Goldman Sachs | 2.229 | 8.117 | UnipolSai Assicurazioni SpA | Goldman Sachs | (678) |
| 2.908 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | Bank of America Merrill Lynch | (1.202) | 9.855 | UnipolSai Assicurazioni SpA | Morgan Stanley | 169 |
| 3.096 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | Goldman Sachs | (1.280) | 19.773 | Webuild SpA | Bank of America Merrill Lynch | 424 |
| 3.372 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | Morgan Stanley | (159) | 8.668 | Webuild SpA | Goldman Sachs | 186 |
| 819 | MFE-MediaForEurope NV 'B' | Goldman Sachs | (1) | 278 | Wiit SpA | Bank of America Merrill Lynch | 488 |
| 984 | Moncler SpA | Morgan Stanley | 2.456 | 311 | Wiit SpA | Goldman Sachs | 546 |
| (733) | Nexi SpA | Morgan Stanley | (130) | (63) | Zignago Vetro SpA | Bank of America Merrill Lynch | (76) |
| 741 | OVS SpA | Bank of America Merrill Lynch | 87 | | | | (11.695) |
| 13.984 | OVS SpA | Goldman Sachs | 1.648 | Japan | | | |
| 27 | Pharmanutra SpA | Bank of America Merrill Lynch | 72 | 1.600 | 77 Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.255 |
| 75 | Pharmanutra SpA | Goldman Sachs | 201 | 700 | 77 Bank Ltd | Goldman Sachs | 549 |
| (1.849) | Pirelli & C SpA | Morgan Stanley | (162) | 1.000 | ABC-Mart Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.010 |
| (1.733) | Poste Italiane SpA | Bank of America Merrill Lynch | (1.023) | 300 | ABC-Mart Inc | Goldman Sachs | 303 |
| (7.526) | Poste Italiane SpA | Morgan Stanley | (3.185) | 300 | ABC-Mart Inc | Morgan Stanley | 326 |
| 77 | Prysmian SpA | Goldman Sachs | 212 | 12.100 | Acom Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 94 |
| (2.021) | RAI Way SpA | Bank of America Merrill Lynch | 227 | 27.700 | Acom Co Ltd | Goldman Sachs | 215 |
| | | | | 4 | Activia Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | — |
| | | | | 2 | Activia Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (109) |
| | | | | 2.800 | Adastria Co Ltd | Goldman Sachs | 391 |
| | | | | (3.300) | ADEKA Corp | Goldman Sachs | (3.280) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--|-------------------------------|---|--------------------------|---------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (6) | Advance Residence Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (625) | (600) | Alpen Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (149) |
| (18) | Advance Residence Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (1.957) | (200) | Alpen Co Ltd | Goldman Sachs | (50) |
| (1) | Advance Residence Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (93) | (300) | Alpha Systems Inc | Goldman Sachs | (827) |
| (300) | Advantest Corp | Bank of America Merrill Lynch | (746) | 2.200 | Alps Alpine Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.025 |
| (200) | Advantest Corp | Goldman Sachs | (666) | (100) | Altech Corp | Goldman Sachs | (66) |
| (1.800) | Aeon Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (533) | 11.700 | Amada Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 2.275 |
| (1.600) | Aeon Co Ltd | Morgan Stanley | (232) | 1.000 | Amada Co Ltd | Goldman Sachs | 182 |
| 1.000 | Aeon Delight Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 200 | 2.500 | Amada Co Ltd | Morgan Stanley | 116 |
| 1.000 | Aeon Delight Co Ltd | Goldman Sachs | 172 | 1.000 | Amano Corp | Bank of America Merrill Lynch | 466 |
| 2.500 | AEON Financial Service Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 582 | 900 | Amano Corp | Goldman Sachs | 419 |
| 2.300 | AEON Financial Service Co Ltd | Goldman Sachs | 536 | 500 | Amano Corp | Morgan Stanley | 349 |
| 4.900 | AEON Financial Service Co Ltd | Morgan Stanley | 152 | (1.300) | ANA Holdings Inc | Goldman Sachs | (692) |
| (1.800) | Aeon Hokkaido Corp | Bank of America Merrill Lynch | (98) | 1.700 | Anicom Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 92 |
| (13) | AEON Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (505) | 7.900 | Anicom Holdings Inc | Goldman Sachs | 429 |
| (35) | AEON Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (1.142) | 100 | Anritsu Corp | Bank of America Merrill Lynch | (33) |
| (3.000) | Aeon Mall Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 144 | 2.500 | Anritsu Corp | Goldman Sachs | (835) |
| (4.700) | Aeon Mall Co Ltd | Goldman Sachs | 280 | 900 | Anritsu Corp | Morgan Stanley | (126) |
| (4.000) | Aeon Mall Co Ltd | Morgan Stanley | 204 | 6.000 | AOKI Holdings Inc | Goldman Sachs | 606 |
| (100) | AGC Inc | Bank of America Merrill Lynch | (19) | 1.200 | Aozora Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 411 |
| (500) | AGC Inc | Morgan Stanley | (136) | 1.700 | Aozora Bank Ltd | Goldman Sachs | 1.003 |
| 800 | Ai Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 186 | 2.400 | Aozora Bank Ltd | Morgan Stanley | 342 |
| 1.700 | Ai Holdings Corp | Goldman Sachs | 411 | 400 | Arata Corp | Bank of America Merrill Lynch | 839 |
| 1.000 | Aica Kogyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.639) | 100 | Arata Corp | Goldman Sachs | 210 |
| 900 | Aica Kogyo Co Ltd | Goldman Sachs | (1.475) | (200) | Arcland Sakamoto Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | — |
| 400 | Aica Kogyo Co Ltd | Morgan Stanley | (491) | (500) | Arcland Sakamoto Co Ltd | Goldman Sachs | — |
| (1.700) | Aichi Corp | Bank of America Merrill Lynch | (251) | 600 | Arcland Service Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 126 |
| (1.100) | Aichi Corp | Goldman Sachs | (162) | 1.400 | Arcland Service Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 282 |
| 800 | Aichi Steel Corp | Bank of America Merrill Lynch | 665 | 100 | Arcs Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (64) |
| 1.400 | Aichi Steel Corp | Goldman Sachs | 1.163 | (500) | Ariake Japan Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 485 |
| (100) | Aida Engineering Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 53 | (200) | Ariake Japan Co Ltd | Goldman Sachs | 194 |
| (8.300) | Aiful Corp | Bank of America Merrill Lynch | — | (200) | Ariake Japan Co Ltd | Morgan Stanley | 272 |
| (15.800) | Aiful Corp | Goldman Sachs | — | 700 | ARTERIA Networks Corp | Bank of America Merrill Lynch | (65) |
| (1.500) | Ain Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.281) | 1.700 | ARTERIA Networks Corp | Goldman Sachs | (158) |
| (200) | Ain Holdings Inc | Goldman Sachs | (171) | (100) | As One Corp | Morgan Stanley | 357 |
| (500) | Air Water Inc | Bank of America Merrill Lynch | 113 | 100 | Asahi Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | (269) |
| (1.900) | Air Water Inc | Morgan Stanley | (207) | 1.500 | Asahi Group Holdings Ltd | Morgan Stanley | 1.223 |
| (1.400) | Airtrip Corp | Bank of America Merrill Lynch | (805) | (200) | Asahi Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (31) |
| (100) | Airtrip Corp | Goldman Sachs | (57) | (400) | Asahi Intecc Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 217 |
| (700) | Aisin Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.147) | (1.800) | Asahi Intecc Co Ltd | Morgan Stanley | 643 |
| (300) | Aisin Corp | Goldman Sachs | (920) | 100 | Asahi Kasei Corp | Goldman Sachs | 12 |
| (300) | Aisin Corp | Morgan Stanley | (513) | 2.600 | Asahi Kasei Corp | Morgan Stanley | (151) |
| 100 | Ajinomoto Co Inc | Goldman Sachs | (12) | (300) | Asics Corp | Bank of America Merrill Lynch | 126 |
| 300 | Ajinomoto Co Inc | Morgan Stanley | (123) | (1.600) | Asics Corp | Goldman Sachs | 64 |
| 1.000 | Alfresa Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 295 | (1.200) | Asics Corp | Morgan Stanley | 755 |
| 700 | Alfresa Holdings Corp | Goldman Sachs | 207 | (2.100) | ASKUL Corp | Bank of America Merrill Lynch | 408 |
| 2.100 | Alfresa Holdings Corp | Morgan Stanley | (701) | (400) | ASKUL Corp | Goldman Sachs | 78 |
| | | | | (1.500) | ASKUL Corp | Morgan Stanley | 82 |
| | | | | 1.300 | Astellas Pharma Inc | Goldman Sachs | 1.075 |
| | | | | 1.400 | Astellas Pharma Inc | Morgan Stanley | 756 |
| | | | | (400) | Atom Corp | Bank of America Merrill Lynch | 9 |
| | | | | (3.600) | Atom Corp | Goldman Sachs | 84 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|----------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|---------------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (300) | Autobacs Seven Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (12) | 800 | Capcom Co Ltd | Morgan Stanley | 528 |
| (600) | Autobacs Seven Co Ltd | Goldman Sachs | (23) | 1.800 | Casio Computer Co Ltd | Morgan Stanley | (210) |
| 1.300 | Avex Inc | Bank of America Merrill Lynch | 458 | (500) | CellSource Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (466) |
| 2.700 | Avex Inc | Goldman Sachs | 1.044 | (100) | CellSource Co Ltd | Goldman Sachs | (93) |
| (2.900) | Awa Bank Ltd | Goldman Sachs | 563 | (1.500) | Central Glass Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.306) |
| 200 | Axial Retailing Inc | Goldman Sachs | (109) | (1.000) | Central Glass Co Ltd | Goldman Sachs | (1.315) |
| 400 | Azbil Corp | Bank of America Merrill Lynch | 730 | (100) | Central Japan Railway Co | Morgan Stanley | 501 |
| 1.100 | Azbil Corp | Goldman Sachs | 2.008 | 100 | Change Inc | Goldman Sachs | 33 |
| 500 | Azbil Corp | Morgan Stanley | 427 | (1.400) | Chiba Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 370 |
| 100 | Bandai Namco Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 684 | (3.200) | Chiba Bank Ltd | Goldman Sachs | 845 |
| 200 | Bandai Namco Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.368 | (1.500) | Chiba Bank Ltd | Morgan Stanley | 105 |
| 400 | Bandai Namco Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.218 | 200 | Chiyoda Corp | Bank of America Merrill Lynch | 31 |
| (800) | Bank of Kyoto Ltd | Morgan Stanley | (1.802) | (100) | Chofu Seisakusho Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 33 |
| 100 | BayCurrent Consulting Inc | Bank of America Merrill Lynch | (893) | 1.500 | Chubu Electric Power Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (291) |
| 500 | Belc Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (349) | 2.300 | Chubu Electric Power Co Inc | Morgan Stanley | (429) |
| 400 | Belc Co Ltd | Goldman Sachs | (280) | 100 | Chudenko Corp | Goldman Sachs | 5 |
| 700 | Bell System24 Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 82 | 300 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (55) |
| 1.300 | Bell System24 Holdings Inc | Goldman Sachs | 151 | 500 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | 171 |
| 2.200 | Belluna Co Ltd | Goldman Sachs | 51 | 1.300 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | Morgan Stanley | (824) |
| (1.700) | Benefit One Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.670) | 1.200 | Chugoku Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 121 |
| (1.200) | Benefit One Inc | Goldman Sachs | (1.193) | 2.200 | Chugoku Bank Ltd | Goldman Sachs | 222 |
| (1.200) | Benefit One Inc | Morgan Stanley | 443 | 1.200 | Chugoku Bank Ltd | Morgan Stanley | 168 |
| 200 | Benesse Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (48) | 4.700 | Chugoku Electric Power Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.132) |
| 4.500 | Benesse Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.360) | 2.800 | Chugoku Electric Power Co Inc | Goldman Sachs | (674) |
| 400 | Benesse Holdings Inc | Morgan Stanley | (121) | 1.700 | Chugoku Electric Power Co Inc | Morgan Stanley | (304) |
| 800 | BeNext-Yumeshin Group Co | Bank of America Merrill Lynch | 155 | 100 | Chugoku Marine Paints Ltd | Goldman Sachs | (15) |
| 700 | BeNext-Yumeshin Group Co | Goldman Sachs | 136 | 8.500 | CI Takiron Corp | Goldman Sachs | (264) |
| 200 | Bengo4.com Inc | Bank of America Merrill Lynch | 194 | (400) | Citizen Watch Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (29) |
| 1.100 | Bengo4.com Inc | Goldman Sachs | 1.068 | (1.100) | Citizen Watch Co Ltd | Goldman Sachs | (43) |
| (2.300) | Bic Camera Inc | Bank of America Merrill Lynch | (768) | (500) | CKD Corp | Bank of America Merrill Lynch | (326) |
| (200) | Bic Camera Inc | Goldman Sachs | (67) | 1.000 | Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.608) |
| (300) | Bic Camera Inc | Morgan Stanley | (65) | 3.000 | Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc | Goldman Sachs | (4.823) |
| (900) | BIPROGY Inc | Bank of America Merrill Lynch | (119) | 3.300 | Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.717) |
| (1.000) | BIPROGY Inc | Goldman Sachs | (132) | (5.700) | COLOPL Inc | Goldman Sachs | (1.328) |
| (1.000) | BIPROGY Inc | Morgan Stanley | 489 | (200) | Colowide Co Ltd | Goldman Sachs | 77 |
| (100) | BML Inc | Bank of America Merrill Lynch | (16) | (2) | Comforia Residential Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (150) |
| (2.800) | BML Inc | Goldman Sachs | (435) | (2) | Comforia Residential Inc (REIT) | Goldman Sachs | (140) |
| (1.200) | Broadleaf Co Ltd | Goldman Sachs | (289) | 1.300 | COMSYS Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (231) |
| (500) | Brother Industries Ltd | Goldman Sachs | (722) | 600 | COMSYS Holdings Corp | Goldman Sachs | (141) |
| (1.100) | Brother Industries Ltd | Morgan Stanley | (709) | 5.400 | COMSYS Holdings Corp | Morgan Stanley | (2.534) |
| (100) | Bunka Shutter Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (13) | 1.200 | Comture Corp | Bank of America Merrill Lynch | 913 |
| (700) | Bunka Shutter Co Ltd | Goldman Sachs | (92) | 1.600 | Comture Corp | Goldman Sachs | 1.218 |
| (1.100) | Bushiroad Inc | Bank of America Merrill Lynch | 478 | (14.600) | Concordia Financial Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.020 |
| 3.600 | Calbee Inc | Goldman Sachs | (3.746) | (1.200) | Concordia Financial Group Ltd | Goldman Sachs | 84 |
| 1.200 | Canon Electronics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 531 | | | | |
| 1.000 | Canon Electronics Inc | Goldman Sachs | 443 | | | | |
| (1.000) | Canon Inc | Morgan Stanley | (295) | | | | |
| (200) | Canon Marketing Japan Inc | Bank of America Merrill Lynch | (57) | | | | |
| (200) | Canon Marketing Japan Inc | Goldman Sachs | (57) | | | | |
| (900) | Canon Marketing Japan Inc | Morgan Stanley | (35) | | | | |
| 700 | Capcom Co Ltd | Goldman Sachs | 1.033 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------|--|---|--------------------------|---|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (100) | CONEXIO Corp | Bank of America Merrill Lynch | 9 | (300) | Daio Paper Corp | Morgan Stanley | (63) |
| 400 | Cosmo Energy Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 190 | 2.200 | Daiseki Co Ltd | Goldman Sachs | 683 |
| 100 | Cosmos Pharmaceutical Corp | Bank of America Merrill Lynch | 815 | (3.800) | Daishi Hokuetsu Financial Group Inc | Goldman Sachs | (1.623) |
| 500 | Cosmos Pharmaceutical Corp | Goldman Sachs | 4.077 | 200 | Daito Trust Construction Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 280 |
| 300 | Cosmos Pharmaceutical Corp | Goldman Sachs | 4.077 | 100 | Daito Trust Construction Co Ltd | Goldman Sachs | 140 |
| 1 | CRE Logistics Inc (REIT) | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch | 1.864 | 600 | Daiwa House Industry Co Ltd | Goldman Sachs | 37 |
| 2 | CRE Logistics Inc (REIT) | Goldman Sachs | 163 | 900 | Daiwa House Industry Co Ltd | Morgan Stanley | (720) |
| (600) | Create Restaurants Holdings Inc | Goldman Sachs | (210) | (7) | Daiwa House Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (3) |
| 300 | Create SD Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 5 | (10) | Daiwa House Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 5 |
| 1.000 | Create SD Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 8 | (20) | Daiwa House Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (176) |
| (2.800) | Credit Saison Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 216 | (100) | Daiwa Industries Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 23 |
| (2.700) | Credit Saison Co Ltd | Goldman Sachs | 145 | (12) | Daiwa Office Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 2.889 |
| (2.800) | Credit Saison Co Ltd | Morgan Stanley | 645 | (1) | Daiwa Office Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 241 |
| 100 | Curves Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 4 | (2) | Daiwa Office Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | 357 |
| (1.000) | CyberAgent Inc | Bank of America Merrill Lynch | (23) | (2.300) | Daiwa Securities Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (243) |
| (3.500) | CyberAgent Inc | Goldman Sachs | (82) | (1.100) | Daiwa Securities Group Inc | Goldman Sachs | (61) |
| 800 | Cybozu Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.330) | (6.600) | Daiwa Securities Group Inc | Morgan Stanley | (128) |
| 900 | Cybozu Inc | Goldman Sachs | (1.496) | (1) | Daiwa Securities Living Investments Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (26) |
| (1.700) | Dai Nippon Printing Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (449) | (700) | Daiwabo Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (250) |
| (1.200) | Dai Nippon Printing Co Ltd | Goldman Sachs | (317) | (500) | Daiwabo Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (179) |
| (1.300) | Daicel Corp | Bank of America Merrill Lynch | (81) | (100) | DCM Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (6) |
| (6.500) | Daicel Corp | Goldman Sachs | (404) | (1.200) | Demae-Can Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 690 |
| (2.500) | Daicel Corp | Morgan Stanley | (291) | 200 | DeNA Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 73 |
| 100 | Dai-Dan Co Ltd | Goldman Sachs | 84 | 600 | DeNA Co Ltd | Goldman Sachs | 130 |
| 400 | Daido Steel Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 419 | 1.100 | DeNA Co Ltd | Morgan Stanley | (1.070) |
| 100 | Daido Steel Co Ltd | Goldman Sachs | 105 | (1.500) | Denka Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 874 |
| 400 | Daido Steel Co Ltd | Morgan Stanley | 249 | (1.000) | Denka Co Ltd | Goldman Sachs | 582 |
| 100 | Daifuku Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (16) | 400 | Denso Corp | Morgan Stanley | 842 |
| 1.200 | Daifuku Co Ltd | Goldman Sachs | (186) | 500 | Dentsu Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 351 |
| (100) | Daihen Corp | Goldman Sachs | (249) | 800 | Dentsu Group Inc | Goldman Sachs | (2.074) |
| 300 | Daiho Corp | Bank of America Merrill Lynch | 58 | 1.900 | Dentsu Group Inc | Morgan Stanley | (3.393) |
| 100 | Daiho Corp | Goldman Sachs | 19 | (400) | Descente Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (114) |
| (500) | Daiichi Jitsugyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (718) | (300) | Descente Ltd | Goldman Sachs | (178) |
| (600) | Daiichi Jitsugyo Co Ltd | Goldman Sachs | (862) | (100) | Descente Ltd | Morgan Stanley | (135) |
| (900) | Dai-ichi Life Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (616) | (400) | Dexerials Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.040) |
| (500) | Dai-ichi Life Holdings Inc | Goldman Sachs | (230) | (600) | Dexerials Corp | Morgan Stanley | (1.502) |
| (1.400) | Dai-ichi Life Holdings Inc | Morgan Stanley | (717) | 800 | DIC Corp | Goldman Sachs | 186 |
| (2.100) | Daiichi Sankyo Co Ltd | Goldman Sachs | (888) | 900 | DIC Corp | Morgan Stanley | (70) |
| (800) | Daiichi Sankyo Co Ltd | Morgan Stanley | (4) | 200 | Digital Arts Inc | Bank of America Merrill Lynch | 171 |
| (500) | Daiichikoshu Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (893) | 200 | Digital Arts Inc | Goldman Sachs | 171 |
| (100) | Daiichikoshu Co Ltd | Morgan Stanley | (120) | (100) | Digital Garage Inc | Goldman Sachs | 140 |
| 300 | Daiken Corp | Bank of America Merrill Lynch | (9) | 500 | Dip Corp | Bank of America Merrill Lynch | (272) |
| 2.100 | Daiken Corp | Goldman Sachs | (65) | 100 | Dip Corp | Goldman Sachs | (54) |
| (400) | Daiki Aluminium Industry Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 163 | 1.300 | Direct Marketing MiX Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.636) |
| (500) | Daiki Aluminium Industry Co Ltd | Goldman Sachs | (22) | 700 | Direct Marketing MiX Inc | Goldman Sachs | (881) |
| (900) | Daio Paper Corp | Bank of America Merrill Lynch | (203) | 100 | Disco Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.228 |
| (900) | Daio Paper Corp | Goldman Sachs | (195) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--------------------------------------|----------------------------------|---|--------------------------|--|----------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 100 | Disco Corp | Morgan Stanley | 1.320 | (1.700) | Fancl Corp | Morgan Stanley | 475 |
| 1.700 | DMG Mori Co Ltd | Goldman Sachs | 2.297 | (500) | FANUC Corp | Goldman Sachs | (4.291) |
| 5.300 | DMG Mori Co Ltd | Morgan Stanley | 2.634 | (100) | Fast Retailing Co Ltd | Goldman Sachs | (1.646) |
| 1.800 | Doshisha Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 559 | (200) | Fast Retailing Co Ltd | Morgan Stanley | (2.449) |
| 2.300 | Doshisha Co Ltd | Goldman Sachs | 714 | 1.200 | FCC Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (37) |
| 1.500 | Doutor Nichires Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (114) | 6.500 | FCC Co Ltd | Goldman Sachs | (202) |
| 3.100 | Doutor Nichires Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (241) | (200) | Ferrotec Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (305) |
| 100 | Dowa Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (28) | (300) | Financial Products Group Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (340) |
| (200) | DTS Corp | Bank of America Merrill Lynch | (139) | (500) | Financial Products Group Co Ltd | Goldman Sachs | (567) |
| (400) | DTS Corp | Goldman Sachs | (270) | (200) | Food & Life Cos Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 631 |
| (300) | Duskin Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 77 | (500) | Food & Life Cos Ltd | Goldman Sachs | 1.577 |
| (1.800) | Duskin Co Ltd | Goldman Sachs | 461 | (300) | Food & Life Cos Ltd | Morgan Stanley | 184 |
| (100) | DyDo Group Holdings Inc | Goldman Sachs | 151 | 1.200 | FP Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.016 |
| (100) | Eagle Industry Co Ltd | Goldman Sachs | (48) | 400 | FP Corp | Goldman Sachs | 339 |
| 100 | Earth Corp | Bank of America Merrill Lynch | (109) | 600 | FP Corp | Morgan Stanley | 214 |
| 300 | East Japan Railway Co | Goldman Sachs | 98 | 600 | Freee KK | Morgan Stanley | (1.561) |
| 100 | East Japan Railway Co | Morgan Stanley | (83) | (1) | Frontier Real Estate Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (233) |
| 500 | Ebara Corp | Goldman Sachs | 78 | (100) | Fuji Co Ltd | Goldman Sachs | 46 |
| 600 | Ebara Corp | Morgan Stanley | (326) | 200 | Fuji Corp | Bank of America Merrill Lynch | 141 |
| 500 | EDION Corp | Bank of America Merrill Lynch | 31 | 100 | Fuji Corp | Goldman Sachs | 71 |
| 700 | EDION Corp | Goldman Sachs | 43 | (400) | Fuji Electric Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.305) |
| 100 | eGuarantee Inc | Bank of America Merrill Lynch | 182 | (200) | Fuji Electric Co Ltd | Goldman Sachs | (565) |
| 200 | Eisai Co Ltd | Morgan Stanley | (444) | (1.300) | Fuji Electric Co Ltd | Morgan Stanley | (2.322) |
| 100 | Eizo Corp | Goldman Sachs | 62 | (1.900) | Fuji Kyuko Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (738) |
| 1.300 | Elan Corp | Bank of America Merrill Lynch | 666 | 600 | Fuji Media Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 135 |
| 1.700 | Elan Corp | Goldman Sachs | 871 | 800 | Fuji Media Holdings Inc | Goldman Sachs | (18) |
| 100 | Elecom Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (16) | 900 | Fuji Media Holdings Inc | Morgan Stanley | 107 |
| 400 | Elecom Co Ltd | Goldman Sachs | (62) | (700) | Fuji Oil Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 555 |
| 1.700 | Electric Power Development Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (937) | (900) | Fuji Oil Holdings Inc | Goldman Sachs | 713 |
| 500 | Electric Power Development Co Ltd | Goldman Sachs | (276) | (2.000) | Fuji Oil Holdings Inc | Morgan Stanley | 823 |
| 200 | Electric Power Development Co Ltd | Morgan Stanley | (70) | 1.700 | Fuji Seal International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (292) |
| (2.800) | EM Systems Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 2.305 | 2.000 | Fuji Seal International Inc | Goldman Sachs | (336) |
| 100 | en Japan Inc | Bank of America Merrill Lynch | (52) | (100) | Fuji Soft Inc | Goldman Sachs | (419) |
| 3.500 | en Japan Inc | Goldman Sachs | (1.821) | (200) | Fujicco Co Ltd | Goldman Sachs | 43 |
| (2.100) | ENEOS Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (390) | 1.000 | FUJIFILM Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 788 |
| (11.600) | ENEOS Holdings Inc | Morgan Stanley | (468) | 100 | FUJIFILM Holdings Corp | Goldman Sachs | 201 |
| (1.100) | eRex Co Ltd | Goldman Sachs | 1.128 | 600 | FUJIFILM Holdings Corp | Morgan Stanley | 916 |
| 100 | ES-Con Japan Ltd | Goldman Sachs | 25 | (1.900) | Fujikura Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (679) |
| (900) | ESPEC Corp | Bank of America Merrill Lynch | (594) | (5.700) | Fujikura Ltd | Goldman Sachs | (1.984) |
| (300) | ESPEC Corp | Goldman Sachs | (198) | 600 | Fujimi Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.584 |
| (100) | euglena Co Ltd | Goldman Sachs | 30 | 500 | Fujimi Inc | Goldman Sachs | 1.320 |
| (1.800) | Exedy Corp | Bank of America Merrill Lynch | (587) | 100 | Fujimori Kogyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 47 |
| (500) | Exedy Corp | Goldman Sachs | (163) | (200) | Fujio Food Group Inc | Goldman Sachs | 4 |
| 2.600 | EXEO Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (380) | (1.800) | Fujitec Co Ltd | Goldman Sachs | (1.650) |
| 1.800 | EXEO Group Inc | Goldman Sachs | (120) | (2.500) | Fujitsu General Ltd | Morgan Stanley | (2.369) |
| 3.800 | EXEO Group Inc | Morgan Stanley | (518) | 300 | Fujitsu Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 117 |
| (800) | Ezaki Glico Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 324 | 200 | Fujitsu Ltd | Goldman Sachs | (299) |
| (300) | Ezaki Glico Co Ltd | Goldman Sachs | 128 | 100 | Fujitsu Ltd | Morgan Stanley | (307) |
| (1.200) | Ezaki Glico Co Ltd | Morgan Stanley | 906 | 100 | Fukui Computer Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (27) |
| | | | | 100 | Fukui Computer Holdings Inc | Goldman Sachs | (27) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-----------------|---|--------------------------|------------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 1 | Fukuoka Corp (REIT) | Goldman Sachs | 56 | 3.400 | Gunma Bank Ltd | Bank of America | |
| (2.400) | Fukuoka Financial Group Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (16) |
| | | Merrill Lynch | 1.156 | 4.000 | Gunma Bank Ltd | Goldman Sachs | (12) |
| (1.000) | Fukuoka Financial Group Inc | Goldman Sachs | 482 | 100 | Gunze Ltd | Bank of America | |
| (1.200) | Fukuoka Financial Group Inc | Morgan Stanley | 242 | | | Merrill Lynch | (16) |
| (300) | Fukushima Galilei Co Ltd | Bank of America | | 500 | H.U. Group Holdings Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 349 | | | Merrill Lynch | (167) |
| (500) | Fukushima Galilei Co Ltd | Goldman Sachs | 582 | 300 | H.U. Group Holdings Inc | Goldman Sachs | (100) |
| (1.300) | Fukuyama Transporting Co Ltd | Bank of America | | 1.000 | H.U. Group Holdings Inc | Morgan Stanley | (39) |
| | | Merrill Lynch | 1.716 | (200) | H2O Retailing Corp | Bank of America | |
| 500 | FULLCAST Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (4) | | | Merrill Lynch | (109) |
| 1.200 | Funai Soken Holdings Inc | Bank of America | | (400) | H2O Retailing Corp | Goldman Sachs | (217) |
| | | Merrill Lynch | 1.072 | (3.700) | Hachijuni Bank Ltd | Bank of America | |
| 2.100 | Funai Soken Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.876 | | | Merrill Lynch | (374) |
| (100) | Furukawa Co Ltd | Goldman Sachs | (15) | (1.400) | Hachijuni Bank Ltd | Goldman Sachs | (141) |
| 1.100 | Furukawa Electric Co Ltd | Bank of America | | (27.800) | Hachijuni Bank Ltd | Morgan Stanley | (3.023) |
| | | Merrill Lynch | (376) | (700) | Hakuhodo DY Holdings Inc | Bank of America | |
| 500 | Furukawa Electric Co Ltd | Goldman Sachs | (171) | | | Merrill Lynch | 408 |
| 1.000 | Furukawa Electric Co Ltd | Morgan Stanley | 47 | (1.900) | Hakuhodo DY Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.107 |
| 400 | Fuso Chemical Co Ltd | Bank of America | | (600) | Hakuhodo DY Holdings Inc | Morgan Stanley | 89 |
| | | Merrill Lynch | 171 | 200 | Halows Co Ltd | Bank of America | |
| 100 | Fuso Chemical Co Ltd | Goldman Sachs | 43 | | | Merrill Lynch | 163 |
| 100 | Future Corp | Goldman Sachs | (19) | 100 | Halows Co Ltd | Goldman Sachs | 82 |
| (300) | Fuyo General Lease Co Ltd | Morgan Stanley | 23 | 100 | Hamakyorex Co Ltd | Bank of America | |
| 400 | G-7 Holdings Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 68 |
| | | Merrill Lynch | 65 | 300 | Hamamatsu Photonics KK | Goldman Sachs | 722 |
| 100 | Genky DrugStores Co Ltd | Goldman Sachs | 252 | 200 | Hamamatsu Photonics KK | Morgan Stanley | 171 |
| (100) | Geo Holdings Corp | Goldman Sachs | (30) | (400) | Hankyu Hanshin | | |
| (4.200) | giftee Inc | Goldman Sachs | 881 | | | Morgan Stanley | 280 |
| 1.100 | Giken Ltd | Bank of America | | (20) | Hankyu Hanshin Inc (REIT) | Goldman Sachs | (404) |
| | | Merrill Lynch | 769 | 200 | Hanwa Co Ltd | Bank of America | |
| 1.600 | Giken Ltd | Goldman Sachs | 1.118 | | | Merrill Lynch | (12) |
| (1) | Global One Real Estate Investment Corp (REIT) | | | 100 | Hanwa Co Ltd | Goldman Sachs | (6) |
| | | Goldman Sachs | 2 | 100 | Harmonic Drive Systems Inc | Bank of America | |
| (2.700) | GLOBERIDE Inc | Goldman Sachs | (1.929) | | | Merrill Lynch | (47) |
| 500 | Glory Ltd | Goldman Sachs | 74 | 200 | Harmonic Drive Systems Inc | Goldman Sachs | (93) |
| (21) | GLP J- (REIT) | Bank of America | | (3.200) | Haseko Corp | Goldman Sachs | (596) |
| | | Merrill Lynch | 734 | (4.500) | Haseko Corp | Morgan Stanley | 140 |
| (7) | GLP J- (REIT) | Goldman Sachs | 18 | 2.200 | Hazama Ando Corp | Bank of America | |
| (15) | GLP J- (REIT) | Morgan Stanley | 174 | | | Merrill Lynch | (247) |
| (100) | GMO Financial Gate Inc | Goldman Sachs | 761 | 1.600 | Hazama Ando Corp | Goldman Sachs | (182) |
| 100 | GMO Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | (5) | (800) | HEALIOS KK | Bank of America | |
| 100 | GMO GlobalSign Holdings KK | | | | | Merrill Lynch | 2.852 |
| (1.400) | GMO internet Inc | Bank of America | | (1.300) | Heiwa Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 174 | | | Merrill Lynch | (616) |
| (700) | GMO internet Inc | Goldman Sachs | 87 | (800) | Heiwa Corp | Goldman Sachs | (379) |
| (400) | GMO internet Inc | Morgan Stanley | 230 | (800) | Heiwa Corp | Morgan Stanley | (174) |
| 100 | GMO Payment Gateway Inc | Bank of America | | 100 | Heiwa Real Estate Co Ltd | Bank of America | |
| 200 | GMO Payment Gateway Inc | Merrill Lynch | 78 | | | Merrill Lynch | (12) |
| | | Goldman Sachs | 155 | 1 | Heiwa Real Estate Inc (REIT) | Bank of America | |
| (1.000) | GNI Group Ltd | Goldman Sachs | (1.716) | 1.000 | Heiwado Co Ltd | Bank of America | |
| 1.700 | Goldcrest Co Ltd | Goldman Sachs | 1.083 | | | Merrill Lynch | (520) |
| (600) | Goldwin Inc | Bank of America | | (100) | Hiday Hidaka Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (4.613) | | | Merrill Lynch | (10) |
| (1.000) | Goldwin Inc | Goldman Sachs | (7.688) | (200) | Hikari Tsushin Inc | Goldman Sachs | (1.553) |
| (2.700) | GS Yuasa Corp | Bank of America | | (100) | Hikari Tsushin Inc | Morgan Stanley | (163) |
| | | Merrill Lynch | 565 | (1.900) | Hino Motors Ltd | Bank of America | |
| (1.600) | GS Yuasa Corp | Goldman Sachs | 436 | | | Merrill Lynch | (753) |
| (800) | GS Yuasa Corp | Morgan Stanley | 402 | (4.000) | Hino Motors Ltd | Goldman Sachs | (1.584) |
| (400) | G-Tekt Corp | Bank of America | | (3.300) | Hino Motors Ltd | Morgan Stanley | (359) |
| | | Merrill Lynch | (65) | (100) | Hirata Corp | Bank of America | |
| (400) | G-Tekt Corp | Goldman Sachs | (65) | | | Merrill Lynch | (54) |
| (2.000) | GungHo Online Entertainment Inc | Bank of America | | (200) | Hirata Corp | Goldman Sachs | (109) |
| | | Merrill Lynch | (3.013) | (900) | Hirogin Holdings Inc | Bank of America | |
| (900) | GungHo Online Entertainment Inc | Morgan Stanley | 384 | | | Merrill Lynch | (63) |
| | | | | (17.300) | Hirogin Holdings Inc | Morgan Stanley | (134) |
| | | | | 100 | Hirose Electric Co Ltd | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 450 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------------|-----------------|---|--------------------------|---|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 200 | Hirose Electric Co Ltd | Morgan Stanley | 1.274 | (7.100) | Hyakugo Bank Ltd | Goldman Sachs | 221 |
| (1.200) | HIS Co Ltd | Goldman Sachs | (2.283) | (500) | Ibiden Co Ltd | Bank of America | |
| 900 | Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc | Goldman Sachs | (524) | (1.500) | Ibiden Co Ltd | Merrill Lynch | (19) |
| 2.300 | Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc | Morgan Stanley | (2.947) | (1.500) | Ibiden Co Ltd | Goldman Sachs | (324) |
| 2.400 | Hitachi Construction Machinery Co Ltd | Goldman Sachs | 3.392 | (200) | Ichibanya Co Ltd | Morgan Stanley | (5) |
| 300 | Hitachi Construction Machinery Co Ltd | Morgan Stanley | 238 | (200) | Ichibanya Co Ltd | Bank of America | |
| 100 | Hitachi Ltd | Bank of America | | | Ichigo Inc | Merrill Lynch | 93 |
| 100 | Hitachi Ltd | Merrill Lynch | 37 | (7.200) | Ichigo Inc | Bank of America | |
| (4.700) | Hitachi Metals Ltd | Goldman Sachs | 81 | (10.100) | Ichigo Inc | Merrill Lynch | (447) |
| (500) | Hitachi Transport System Ltd | Morgan Stanley | (840) | (2) | Ichigo Office Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (628) |
| (500) | Hitachi Transport System Ltd | Bank of America | (155) | (100) | Ichikoh Industries Ltd | Bank of America | (26) |
| (200) | Hogy Medical Co Ltd | Merrill Lynch | (39) | (100) | Idec Corp | Goldman Sachs | (1) |
| (100) | Hogy Medical Co Ltd | Goldman Sachs | 116 | (1.400) | Idemitsu Kosan Co Ltd | Bank of America | |
| (300) | Hokkaido Electric Power Co Inc | Bank of America | 58 | (2.100) | Idemitsu Kosan Co Ltd | Merrill Lynch | (682) |
| (900) | Hokkaido Electric Power Co Inc | Merrill Lynch | 16 | 600 | IDOM Inc | Goldman Sachs | (1.337) |
| (400) | Hokkoku Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 49 | | IDOM Inc | Bank of America | |
| (3.500) | Hokuetsu Corp | Bank of America | (245) | 1.800 | IDOM Inc | Merrill Lynch | 75 |
| (4.800) | Hokuetsu Corp | Merrill Lynch | (335) | 400 | IHI Corp | Goldman Sachs | 252 |
| (100) | Hokuhoku Financial Group Inc | Goldman Sachs | 15 | (900) | Iida Group Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 373 |
| (1.100) | Hokuhoku Financial Group Inc | Bank of America | 162 | | Iino Kaiun Kaisha Ltd | Bank of America | |
| (1.700) | Hokuriku Electric Power Co | Merrill Lynch | 370 | 100 | Inaba Denki Sangyo Co Ltd | Merrill Lynch | 105 |
| (1.900) | Hokuriku Electric Power Co | Goldman Sachs | 413 | (400) | Inaba Denki Sangyo Co Ltd | Bank of America | (19) |
| (300) | Hokuto Corp | Bank of America | 56 | (300) | Inabata & Co Ltd | Merrill Lynch | (140) |
| (2.300) | Hokuto Corp | Merrill Lynch | 503 | (600) | Inabata & Co Ltd | Goldman Sachs | (105) |
| 3.600 | Honda Motor Co Ltd | Goldman Sachs | 137 | (700) | Inabata & Co Ltd | Bank of America | (457) |
| 400 | Honda Motor Co Ltd | Bank of America | 56 | (57) | Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT) | Merrill Lynch | (533) |
| 2.900 | Honda Motor Co Ltd | Merrill Lynch | (193) | (4) | Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT) | Bank of America | |
| (500) | Horiba Ltd | Goldman Sachs | (1.398) | (4) | Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT) | Merrill Lynch | (1.828) |
| (600) | Horiba Ltd | Bank of America | (979) | (4) | Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (171) |
| 1 | Hoshino Resorts Inc (REIT) | Merrill Lynch | 16 | 300 | Infocom Corp | Morgan Stanley | (112) |
| 200 | Hoshizaki Corp | Goldman Sachs | (93) | 300 | Infocom Corp | Bank of America | |
| 200 | Hoshizaki Corp | Bank of America | (93) | 1.400 | Infocom Corp | Merrill Lynch | 221 |
| (900) | Hosiden Corp | Merrill Lynch | (358) | 3.700 | Infomart Corp | Goldman Sachs | 1.033 |
| (1.300) | Hosiden Corp | Goldman Sachs | (535) | | Infomart Corp | Bank of America | |
| (1.400) | Hosokawa Micon Corp | Bank of America | (2.599) | 3.200 | Infomart Corp | Merrill Lynch | 13 |
| (2.300) | House Foods Group Inc | Merrill Lynch | 2.694 | 300 | Information Services International-Dentsu Ltd | Goldman Sachs | 106 |
| (900) | House Foods Group Inc | Goldman Sachs | 956 | 300 | Information Services International-Dentsu Ltd | Bank of America | 35 |
| (2.600) | House Foods Group Inc | Merrill Lynch | 2.552 | 600 | Information Services International-Dentsu Ltd | Goldman Sachs | 35 |
| 100 | Hoya Corp | Bank of America | 827 | | INFRONEER Holdings Inc | Morgan Stanley | (233) |
| 100 | Hoya Corp | Merrill Lynch | 827 | (76) | INPex Corp | Bank of America | 18 |
| (900) | Hulic Co Ltd | Goldman Sachs | (175) | (300) | Inpex Corp | Bank of America | |
| (2.400) | Hulic Co Ltd | Merrill Lynch | (407) | | Inpex Corp | Merrill Lynch | (381) |
| (300) | Hulic Co Ltd | Goldman Sachs | (9) | (4.400) | Inpex Corp | Goldman Sachs | (6.852) |
| (1) | Hulic Inc (REIT) | Morgan Stanley | (30) | 100 | Insourc Co Ltd | Bank of America | |
| (4.000) | Hyakugo Bank Ltd | Bank of America | 124 | 800 | Internet Initiative Japan Inc | Merrill Lynch | 186 |
| | | Merrill Lynch | | 400 | Internet Initiative Japan Inc | Goldman Sachs | 2.361 |
| | | | | (16) | Invincible Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | 466 |
| | | | | (21) | Invincible Investment Corp (REIT) | Bank of America | |
| | | | | 100 | IR Japan Holdings Ltd | Merrill Lynch | (31) |
| | | | | 400 | Iriso Electronics Co Ltd | Goldman Sachs | (41) |
| | | | | | | Bank of America | 400 |
| | | | | | | Merrill Lynch | 590 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-----------------|---|--------------------------|---|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 900 | Iriso Electronics Co Ltd | Goldman Sachs | 1.328 | (82) | Japan Hotel Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | — |
| (3.200) | Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd | Morgan Stanley | (497) | 800 | Japan Lifeline Co Ltd | Bank of America | |
| (800) | Isuzu Motors Ltd | Goldman Sachs | 37 | | Merrill Lynch | | (37) |
| (1.100) | Isuzu Motors Ltd | Goldman Sachs | 37 | 4.800 | Japan Lifeline Co Ltd | Goldman Sachs | (224) |
| (700) | Ito En Ltd | Bank of America | 111 | (8) | Japan Logistics Fund Inc (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.577 | | Merrill Lynch | | (497) |
| (200) | Ito En Ltd | Morgan Stanley | 450 | (6) | Japan Logistics Fund Inc (REIT) | | |
| (1) | Itochu Advance Logistics Investment Corp (REIT) | | | (9) | Japan Logistics Fund Inc (REIT) | Goldman Sachs | (373) |
| 2.500 | ITOCHU Corp | Goldman Sachs | (68) | | | | |
| | | Bank of America | | (500) | Japan Material Co Ltd | Morgan Stanley | (349) |
| | | Merrill Lynch | 2.250 | | | Bank of America | |
| 1.900 | ITOCHU Corp | Goldman Sachs | 1.457 | | Merrill Lynch | | |
| 2.200 | ITOCHU Corp | Morgan Stanley | 328 | (1.200) | Japan Material Co Ltd | Goldman Sachs | 249 |
| (400) | Itochu Enex Co Ltd | Bank of America | | (56) | Japan Metropolitan Fund Invest (REIT) | Bank of America | 561 |
| | | Merrill Lynch | (75) | | | Merrill Lynch | |
| 1.700 | Itochu Techno-Solutions Corp | Bank of America | | (18) | Japan Metropolitan Fund Invest (REIT) | | (2.566) |
| | | Merrill Lynch | 1.880 | | | | |
| 2.200 | Itochu Techno-Solutions Corp | Goldman Sachs | 2.083 | 400 | Japan Petroleum Exploration Co Ltd | Morgan Stanley | (741) |
| | | | | | | Bank of America | |
| 600 | Itochu Techno-Solutions Corp | Morgan Stanley | 9 | 1.800 | Japan Post Bank Co Ltd | Merrill Lynch | 1.889 |
| (400) | Itochu-Shokuhin Co Ltd | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 373 | 9.200 | Japan Post Bank Co Ltd | Morgan Stanley | (224) |
| 700 | Itoham Yonekyu Holdings Inc | | | 3.800 | Japan Post Holdings Co Ltd | Bank of America | (1.072) |
| | | Morgan Stanley | (86) | | | Merrill Lynch | |
| (500) | Iwatani Corp | Goldman Sachs | (854) | 2.300 | Japan Post Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 464 |
| (1.600) | Iwatani Corp | Morgan Stanley | 994 | 2.100 | Japan Post Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 190 |
| (3.600) | Iyo Bank Ltd | Bank of America | | (3.200) | Japan Post Insurance Co Ltd | Bank of America | 304 |
| | | Merrill Lynch | (559) | | | Merrill Lynch | |
| (3.400) | Iyo Bank Ltd | Goldman Sachs | (528) | (400) | Japan Post Insurance Co Ltd | Goldman Sachs | 1.145 |
| (1.000) | Iyo Bank Ltd | Morgan Stanley | 39 | (3.300) | Japan Post Insurance Co Ltd | Morgan Stanley | 53 |
| 600 | Izumi Co Ltd | Bank of America | | 4 | Japan Prime Realty Investment Corp (REIT) | | 991 |
| | | Merrill Lynch | (247) | | | Goldman Sachs | 637 |
| 700 | Izumi Co Ltd | Goldman Sachs | (288) | 2 | Japan Prime Realty Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | 31 |
| 500 | Izumi Co Ltd | Morgan Stanley | (82) | (14) | Japan Real Estate Investment Corp (REIT) | Bank of America | |
| 2.300 | J Front Retailing Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (217) |
| | | Merrill Lynch | 965 | 100 | Japan Securities Finance Co Ltd | Bank of America | |
| 700 | J Front Retailing Co Ltd | Goldman Sachs | 294 | | | Merrill Lynch | (33) |
| 3.400 | J Front Retailing Co Ltd | Morgan Stanley | 1.056 | 100 | Japan Securities Finance Co Ltd | | |
| 100 | JAC Recruitment Co Ltd | Bank of America | | (200) | Japan Steel Works Ltd | Goldman Sachs | (9) |
| (1.700) | Jaccs Co Ltd | Goldman Sachs | (1.188) | | | Bank of America | |
| 500 | Jafco Co Ltd | Bank of America | | (100) | Japan Steel Works Ltd | Merrill Lynch | (318) |
| | | Merrill Lynch | 202 | (1.900) | Japan Steel Works Ltd | Goldman Sachs | (159) |
| 1.000 | Jafco Co Ltd | Goldman Sachs | 418 | 5.100 | Japan Tobacco Inc | Morgan Stanley | 369 |
| (1.900) | Japan Airlines Co Ltd | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.956) | 10.000 | Japan Tobacco Inc | Merrill Lynch | 2.218 |
| (4.400) | Japan Airlines Co Ltd | Morgan Stanley | (2.782) | 3.600 | Japan Tobacco Inc | Goldman Sachs | 4.039 |
| (1.500) | Japan Airport Terminal Co Ltd | Bank of America | | 1.300 | Japan Wool Textile Co Ltd | Morgan Stanley | 1.261 |
| | | Merrill Lynch | (1.747) | (1.700) | JCR Pharmaceuticals Co Ltd | Goldman Sachs | (262) |
| (300) | Japan Aviation Electronics Industry Ltd | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (252) | (600) | JCR Pharmaceuticals Co Ltd | Merrill Lynch | (1.875) |
| (700) | Japan Aviation Electronics Industry Ltd | Goldman Sachs | (486) | | | | |
| (4.000) | Japan Aviation Electronics Industry Ltd | | | (1.000) | JCR Pharmaceuticals Co Ltd | Goldman Sachs | (662) |
| (19.300) | Japan Display Inc | Morgan Stanley | 559 | 600 | JCU Corp | Morgan Stanley | 1.491 |
| 1.100 | Japan Elevator Service Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (899) | | | Bank of America | |
| 1.600 | Japan Elevator Service Holdings Co Ltd | Bank of America | | (200) | JDC Corp | Merrill Lynch | 885 |
| 6 | Japan Excellent Inc (REIT) | Merrill Lynch | (188) | | | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | (273) | (400) | Jeol Ltd | Merrill Lynch | 28 |
| | | Merrill Lynch | 85 | | | Bank of America | |
| 2 | Japan Excellent Inc (REIT) | Goldman Sachs | 42 | (500) | Jeol Ltd | Merrill Lynch | (661) |
| 300 | Japan Exchange Group Inc | Goldman Sachs | 323 | (500) | Jeol Ltd | Goldman Sachs | (744) |
| 800 | Japan Exchange Group Inc | Morgan Stanley | 562 | (400) | JFE Holdings Inc | Morgan Stanley | (733) |
| (38) | Japan Hotel Investment Corp (REIT) | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 89 | (300) | JFE Holdings Inc | Merrill Lynch | (169) |
| (46) | Japan Hotel Investment Corp (REIT) | | | (2.700) | JFE Holdings Inc | Goldman Sachs | (82) |
| | | Goldman Sachs | 107 | | | Morgan Stanley | (1.137) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|-----------------------------|-----------------|---|--------------------------|---------------------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 600 | JGC Holdings Corp | Bank of America | | (200) | Kanematsu Electronics Ltd | Goldman Sachs | (404) |
| | | Merrill Lynch | 75 | (900) | Kansai Electric Power Co Inc | Bank of America | |
| 300 | JGC Holdings Corp | Goldman Sachs | 37 | | | Merrill Lynch | 70 |
| 3.500 | JGC Holdings Corp | Morgan Stanley | 3.153 | 2.200 | Kansai Paint Co Ltd | Goldman Sachs | 1.401 |
| (500) | JIG-SAW Inc | Goldman Sachs | 272 | (3.100) | Kanto Denka Kogyo Co Ltd | Goldman Sachs | 1.180 |
| 600 | JINS Holdings Inc | Bank of America | | (1.000) | Kao Corp | Goldman Sachs | (1.131) |
| | | Merrill Lynch | (932) | (900) | Kappa Create Co Ltd | Bank of America | |
| 500 | JINS Holdings Inc | Goldman Sachs | (747) | | | Merrill Lynch | 77 |
| (100) | JM Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 44 | (500) | Katakura Industries Co Ltd | Bank of America | |
| (700) | JMDC Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 268 |
| | | Merrill Lynch | (1.142) | (2.700) | Katakura Industries Co Ltd | Goldman Sachs | 1.447 |
| 100 | Joshin Denki Co Ltd | Bank of America | | (500) | Katitas Co Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 6 | | | Merrill Lynch | (815) |
| (100) | Joyful Honda Co Ltd | Goldman Sachs | (63) | (100) | Kato Sangyo Co Ltd | Bank of America | |
| 700 | JSP Corp | Goldman Sachs | 228 | | | Merrill Lynch | 109 |
| (600) | JSR Corp | Bank of America | | (600) | Kawasaki Heavy Industries Ltd | Goldman Sachs | (708) |
| | | Merrill Lynch | (1.934) | 700 | Kawasaki Kisen Kaisha Ltd | Morgan Stanley | 1.740 |
| (1.000) | JSR Corp | Goldman Sachs | (3.223) | 200 | KDDI Corp | Goldman Sachs | 113 |
| (300) | JTEKT Corp | Bank of America | | 100 | KDDI Corp | Morgan Stanley | (48) |
| | | Merrill Lynch | (63) | (400) | KeePer Technical Laboratory Co Ltd | Bank of America | |
| (700) | JTEKT Corp | Goldman Sachs | (147) | | | Merrill Lynch | (1.836) |
| (1.100) | JTEKT Corp | Morgan Stanley | 26 | (300) | KeePer Technical Laboratory Co Ltd | Goldman Sachs | (1.377) |
| (400) | JTOWER Inc | Goldman Sachs | 217 | (900) | Keihan Holdings Co Ltd | Bank of America | |
| 200 | Juroku Financial Group Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 301 |
| | | Merrill Lynch | 16 | (600) | Keihan Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 200 |
| 300 | Juroku Financial Group Inc | Goldman Sachs | 23 | (900) | Keihan Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 231 |
| (600) | Justsystems Corp | Bank of America | | 100 | Keihanshin Building Co Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.258 | | | Merrill Lynch | 39 |
| (400) | Justsystems Corp | Goldman Sachs | 839 | 100 | Keihanshin Building Co Ltd | Goldman Sachs | 39 |
| (1.000) | Justsystems Corp | Morgan Stanley | 39 | (4.100) | Keikyuu Corp | Bank of America | |
| (2.500) | Kadokawa Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | — |
| | | Merrill Lynch | (3.631) | 800 | Keio Corp | Bank of America | |
| 100 | Kaga Electronics Co Ltd | Goldman Sachs | 85 | | | Merrill Lynch | 381 |
| (2.300) | Kagome Co Ltd | Bank of America | | 1.500 | Keio Corp | Goldman Sachs | 1.188 |
| | | Merrill Lynch | (536) | 300 | Keio Corp | Morgan Stanley | 109 |
| (400) | Kagome Co Ltd | Morgan Stanley | 280 | 1.700 | Keisei Electric Railway Co Ltd | Bank of America | |
| 900 | Kajima Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (594) |
| | | Merrill Lynch | 113 | 600 | Keisei Electric Railway Co Ltd | Morgan Stanley | (280) |
| 1.700 | Kajima Corp | Goldman Sachs | 148 | (1.100) | Keiyo Bank Ltd | Goldman Sachs | 9 |
| 500 | Kajima Corp | Morgan Stanley | (10) | (5.200) | Keiyo Co Ltd | Bank of America | |
| 700 | Kakaku.com Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (1.731) |
| | | Merrill Lynch | 350 | (2.700) | Keiyo Co Ltd | Goldman Sachs | (902) |
| 1.800 | Kakaku.com Inc | Goldman Sachs | (1.306) | (3) | Kenedix Office Investment Corp (REIT) | Bank of America | |
| 1.100 | Kakaku.com Inc | Morgan Stanley | (477) | (2) | Kenedix Office Investment Corp (REIT) | Merrill Lynch | 349 |
| (600) | Kaken Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America | | (3) | Kenedix Office Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 233 |
| | | Merrill Lynch | 629 | (3) | Kenedix Office Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (47) |
| (400) | Kaken Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | 419 | 2.000 | Kewpie Corp | Bank of America | |
| (300) | Kaken Pharmaceutical Co Ltd | Morgan Stanley | 151 | | | Merrill Lynch | (1.491) |
| (800) | Kameda Seika Co Ltd | Bank of America | | 900 | Kewpie Corp | Goldman Sachs | (671) |
| | | Merrill Lynch | (466) | 700 | Kewpie Corp | Morgan Stanley | (277) |
| (400) | Kameda Seika Co Ltd | Goldman Sachs | (233) | 100 | Keyence Corp | Goldman Sachs | 202 |
| 1.100 | Kamigumi Co Ltd | Bank of America | | 100 | Keyence Corp | Morgan Stanley | 1.623 |
| | | Merrill Lynch | (1.239) | (1.700) | KFC Holdings Japan Ltd | Bank of America | |
| 1.300 | Kamigumi Co Ltd | Goldman Sachs | (1.464) | | | Merrill Lynch | 383 |
| 2.400 | Kamigumi Co Ltd | Morgan Stanley | (541) | (1.100) | KFC Holdings Japan Ltd | Goldman Sachs | 248 |
| 1.600 | Kanamoto Co Ltd | Bank of America | | 100 | KH Neochem Co Ltd | Goldman Sachs | (2) |
| | | Merrill Lynch | 223 | (300) | Kikkoman Corp [†] | Bank of America | |
| 2.600 | Kanamoto Co Ltd | Goldman Sachs | 321 | | | Merrill Lynch | — |
| 2.200 | Kandenken Co Ltd | Bank of America | | (700) | Kikkoman Corp | Goldman Sachs | (349) |
| | | Merrill Lynch | (91) | (800) | Kikkoman Corp | Morgan Stanley | (654) |
| 5.200 | Kandenken Co Ltd | Goldman Sachs | (248) | 4.700 | Kinden Corp | Goldman Sachs | 758 |
| 8.700 | Kandenken Co Ltd | Morgan Stanley | (527) | 1.900 | Kinden Corp | Morgan Stanley | 340 |
| (800) | Kaneka Corp | Morgan Stanley | (155) | | | | |
| 500 | Kanematsu Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (50) | | | | |
| 1.200 | Kanematsu Corp | Goldman Sachs | (121) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|----------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|---------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (1.300) | Kintetsu Department Store Co Ltd | Goldman Sachs | 858 | (2.700) | Kubota Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.992) |
| 1.400 | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 652 | (1.000) | Kubota Corp | Morgan Stanley | (1.022) |
| 400 | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 171 | 300 | Kumagai Gumi Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (79) |
| (300) | Kintetsu World Express Inc | Goldman Sachs | (1.806) | 800 | Kumagai Gumi Co Ltd | Goldman Sachs | (278) |
| (2.800) | Kirin Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (851) | 100 | Kumiai Chemical Industry Co Ltd | Goldman Sachs | 80 |
| (2.100) | Kirin Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (544) | 500 | Kura Sushi Inc | Bank of America Merrill Lynch | (427) |
| (4.800) | Kirin Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (2.119) | 1.200 | Kura Sushi Inc | Goldman Sachs | (1.025) |
| (600) | Kisoji Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 47 | 4.600 | Kuraray Co Ltd | Goldman Sachs | (525) |
| (100) | Kissei Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (3) | 7.100 | Kuraray Co Ltd | Morgan Stanley | (810) |
| (200) | Ki-Star Real Estate Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 140 | (800) | Kureha Corp | Goldman Sachs | (4.908) |
| (500) | Ki-Star Real Estate Co Ltd | Goldman Sachs | 349 | (200) | Kurita Water Industries Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (171) |
| (5.200) | Kitanotatsujin Corp | Bank of America Merrill Lynch | 162 | (900) | Kurita Water Industries Ltd | Goldman Sachs | (769) |
| 100 | Kitz Corp | Goldman Sachs | 18 | (100) | Kurita Water Industries Ltd | Morgan Stanley | (150) |
| (6.100) | Kiyo Bank Ltd | Goldman Sachs | 47 | 900 | Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (69) |
| (1.900) | Koa Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.179) | 200 | Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 16 |
| (1.300) | Koa Corp | Goldman Sachs | (725) | 600 | Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (435) |
| (200) | Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.032 | (1.400) | KYB Corp | Bank of America Merrill Lynch | (685) |
| (300) | Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | 769 | (1.200) | KYB Corp | Goldman Sachs | (587) |
| 700 | Kobe Bussan Co Ltd | Morgan Stanley | 1.386 | 900 | Kyocera Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.454 |
| (400) | Kobe Steel Ltd | Goldman Sachs | (36) | 400 | Kyocera Corp | Goldman Sachs | 646 |
| (3.000) | Kobe Steel Ltd | Morgan Stanley | 23 | 400 | Kyocera Corp | Morgan Stanley | 289 |
| (300) | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (792) | 400 | Kyoei Steel Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 200 |
| (300) | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (792) | 800 | Kyoei Steel Ltd | Goldman Sachs | 455 |
| (400) | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (326) | 1.500 | Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.212 |
| (800) | Kohnan Shoji Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (311) | 2.000 | Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd | Goldman Sachs | 1.600 |
| (400) | Kohnan Shoji Co Ltd | Goldman Sachs | (155) | (700) | KYORIN Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 141 |
| 400 | Koito Manufacturing Co Ltd | Morgan Stanley | (93) | (3.900) | KYORIN Holdings Inc | Goldman Sachs | 787 |
| 1.700 | Kokuyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (226) | 100 | Kyoritsu Maintenance Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 202 |
| 1.800 | Kokuyo Co Ltd | Goldman Sachs | (262) | 1.000 | Kyowa Kirin Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 85 |
| 2.100 | Kokuyo Co Ltd | Morgan Stanley | (391) | 500 | Kyowa Kirin Co Ltd | Goldman Sachs | 43 |
| (500) | Komatsu Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (195) | 1.000 | Kyowa Kirin Co Ltd | Morgan Stanley | 39 |
| (1.100) | Komatsu Ltd | Goldman Sachs | (493) | 700 | Kyudenko Corp | Bank of America Merrill Lynch | (252) |
| (1.700) | Komatsu Ltd | Morgan Stanley | (276) | 900 | Kyudenko Corp | Goldman Sachs | (290) |
| 1.400 | KOMEDA Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 109 | 900 | Kyudenko Corp | Morgan Stanley | 12 |
| 700 | KOMEDA Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 54 | 900 | Kyushu Electric Power Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (115) |
| 100 | Komeri Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 40 | 1.700 | Kyushu Electric Power Co Inc | Goldman Sachs | (356) |
| 500 | Konami Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.262 | (6.700) | Kyushu Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 104 |
| 200 | Konami Holdings Corp | Goldman Sachs | 1.305 | (600) | Kyushu Financial Group Inc | Goldman Sachs | 9 |
| 100 | Konami Holdings Corp | Morgan Stanley | 23 | (8.200) | Kyushu Financial Group Inc | Morgan Stanley | (573) |
| 13.000 | Konica Minolta Inc | Morgan Stanley | (303) | 800 | Kyushu Railway Co | Bank of America Merrill Lynch | (110) |
| 1.800 | Konoike Transport Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 84 | 300 | Kyushu Railway Co | Goldman Sachs | (140) |
| 2.300 | Konoike Transport Co Ltd | Goldman Sachs | 107 | (29) | LaSalle Logiport (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.278) |
| (300) | Kose Corp | Goldman Sachs | (606) | (16) | LaSalle Logiport (REIT) | Goldman Sachs | (456) |
| (900) | Koshidaka Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 42 | (6) | LaSalle Logiport (REIT) | Morgan Stanley | (128) |
| (300) | Koshidaka Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 14 | 1.900 | Lawson Inc | Goldman Sachs | (985) |
| (400) | Kotobuki Spirits Co Ltd | Goldman Sachs | (716) | 800 | Lawson Inc | Morgan Stanley | 223 |
| (600) | Kotobuki Spirits Co Ltd | Morgan Stanley | 235 | (3.800) | Leopalace21 Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.151) |
| (800) | K's Holdings Corp | Goldman Sachs | 52 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------------|-----------------|---|--------------------------|----------------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (31.600) | Leopalace21 Corp | Goldman Sachs | (9.571) | 100 | Matsuda Sangyo Co Ltd | Bank of America | |
| 100 | Life Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 77 |
| | | Merrill Lynch | (131) | (1.500) | Matsui Securities Co Ltd | Bank of America | |
| 1.300 | Life Corp | Goldman Sachs | (1.706) | | | Merrill Lynch | 268 |
| (300) | Lifenet Insurance Co | Bank of America | | (3.000) | Matsui Securities Co Ltd | Goldman Sachs | 536 |
| | | Merrill Lynch | (7) | (5.500) | Matsui Securities Co Ltd | Morgan Stanley | (256) |
| (200) | Link And Motivation Inc | Bank of America | | (1.600) | MatsukiyoCocokara & Co | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (11) | | | Merrill Lynch | 124 |
| (1.300) | Lintec Corp | Bank of America | | (50) | MatsukiyoCocokara & Co | Goldman Sachs | 4 |
| | | Merrill Lynch | (919) | (100) | MatsukiyoCocokara & Co | Morgan Stanley | (116) |
| (400) | Lintec Corp | Goldman Sachs | (283) | (7.000) | Matsuya Co Ltd | Bank of America | |
| (900) | Lintec Corp | Morgan Stanley | (587) | | | Merrill Lynch | (2.066) |
| 7.500 | Lion Corp | Bank of America | | (300) | Matsuyafoods Holdings Co Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 4.048 | | | Merrill Lynch | 58 |
| 1.700 | Lion Corp | Goldman Sachs | 937 | (200) | Matsuyafoods Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 39 |
| 2.500 | Lion Corp | Morgan Stanley | 1.307 | 100 | Max Co Ltd | Goldman Sachs | (19) |
| 500 | LITALICO Inc | Bank of America | | 100 | Maxell Ltd | Goldman Sachs | 43 |
| | | Merrill Lynch | 217 | (2.200) | Mazda Motor Corp | Goldman Sachs | (410) |
| 800 | LITALICO Inc | Goldman Sachs | 348 | (500) | Mazda Motor Corp | Morgan Stanley | 85 |
| 900 | Lixil Corp | Morgan Stanley | (433) | (1.500) | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | Bank of America | |
| 300 | M&A Capital Partners Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.747 |
| 200 | M&A Capital Partners Co Ltd | Merrill Lynch | 695 | 100 | MCJ Co Ltd | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | 598 | | | Merrill Lynch | 42 |
| 200 | M3 Inc | Goldman Sachs | (350) | 600 | MCJ Co Ltd | Goldman Sachs | 295 |
| (900) | Mabuchi Motor Co Ltd | Bank of America | | (5.100) | Mebuki Financial Group Inc | Morgan Stanley | (158) |
| | | Merrill Lynch | (524) | (100) | Media Do Co Ltd | Bank of America | |
| (800) | Mabuchi Motor Co Ltd | Goldman Sachs | (466) | | | Merrill Lynch | (134) |
| (400) | Mabuchi Motor Co Ltd | Morgan Stanley | (78) | 100 | Medical Data Vision Co Ltd | Bank of America | |
| (100) | Macnica Fuji Electronics Holdings Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 34 |
| | | Merrill Lynch | (75) | (3.400) | Medipal Holdings Corp | Goldman Sachs | (4.938) |
| 700 | Maeda Kosen Co Ltd | Bank of America | | (2.400) | Medipal Holdings Corp | Morgan Stanley | (1.267) |
| | | Merrill Lynch | (228) | (1.400) | Medley Inc | Bank of America | |
| 500 | Maeda Kosen Co Ltd | Goldman Sachs | (163) | | | Merrill Lynch | (2.392) |
| 500 | Makino Milling Machine Co Ltd | | | (500) | Medley Inc | Goldman Sachs | (854) |
| | | Goldman Sachs | 214 | (200) | MedPeer Inc | Bank of America | |
| (400) | Makita Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (216) |
| | | Merrill Lynch | 674 | (1.100) | MedPeer Inc | Goldman Sachs | (1.187) |
| (200) | Makita Corp | Morgan Stanley | 126 | 100 | Megachips Corp | Bank of America | |
| 400 | Mandom Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 78 |
| | | Merrill Lynch | 124 | 200 | Megachips Corp | Goldman Sachs | 155 |
| 1.500 | Mandom Corp | Goldman Sachs | 466 | 200 | Megmilk Snow Brand Co Ltd | Bank of America | |
| 700 | Mani Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (87) |
| | | Merrill Lynch | 212 | 600 | Megmilk Snow Brand Co Ltd | Goldman Sachs | (261) |
| 1.100 | Mani Inc | Goldman Sachs | 333 | (100) | Meidensha Corp | Bank of America | |
| 2.200 | Mani Inc | Morgan Stanley | 342 | | | Merrill Lynch | (16) |
| 2.300 | Marubeni Corp | Bank of America | | (100) | Meidensha Corp | Goldman Sachs | (27) |
| | | Merrill Lynch | 723 | (100) | MEIJI Holdings Co Ltd | Bank of America | |
| 3.600 | Marubeni Corp | Goldman Sachs | 1.132 | | | Merrill Lynch | 122 |
| 2.200 | Marubeni Corp | Morgan Stanley | 43 | (1.000) | MEIJI Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 2.070 |
| (600) | Maruha Nichiro Corp | Bank of America | | (400) | MEIJI Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 553 |
| | | Merrill Lynch | 983 | (300) | Meiko Electronics Co Ltd | Bank of America | |
| (800) | Maruha Nichiro Corp | Goldman Sachs | 1.311 | | | Merrill Lynch | (1.945) |
| (2.300) | Marui Group Co Ltd | Bank of America | | (300) | Meiko Electronics Co Ltd | Goldman Sachs | (1.945) |
| | | Merrill Lynch | (1.893) | (100) | Meitec Corp | Bank of America | |
| (1.600) | Marui Group Co Ltd | Morgan Stanley | (547) | | | Merrill Lynch | (124) |
| 200 | Maruichi Steel Tube Ltd | Bank of America | | (100) | Meitec Corp | Goldman Sachs | (124) |
| | | Merrill Lynch | 138 | (100) | Melco Holdings Inc | Goldman Sachs | (276) |
| 700 | Maruichi Steel Tube Ltd | Goldman Sachs | 565 | (300) | Menicon Co Ltd | Bank of America | |
| (400) | Maruwa Co Ltd | Goldman Sachs | (1.553) | | | Merrill Lynch | (615) |
| 2.400 | Maruwa Unyu Kikan Co Ltd | Bank of America | | (500) | Menicon Co Ltd | Goldman Sachs | (1.025) |
| | | Merrill Lynch | (1.864) | (200) | Menicon Co Ltd | Morgan Stanley | (12) |
| 1.600 | Maruwa Unyu Kikan Co Ltd | Goldman Sachs | (1.243) | (100) | METAWATER Co Ltd | Bank of America | |
| 1.800 | Maruwa Unyu Kikan Co Ltd | Morgan Stanley | (1.482) | | | Merrill Lynch | — |
| 300 | Maruzen Showa Unyu Co Ltd | Bank of America | | 200 | Micronics Japan Co Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (105) | | | Merrill Lynch | 64 |
| 100 | Maruzen Showa Unyu Co Ltd | | | 300 | Micronics Japan Co Ltd | Goldman Sachs | 96 |
| | | Goldman Sachs | (35) | 1.000 | Midac Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 2.765 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|------------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|--|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (5.800) | Mie Kotsu Group Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (811) | 1.500 | Mitsui Fudosan Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.339 |
| 500 | Milbon Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (233) | 1.000 | Mitsui Fudosan Co Ltd | Goldman Sachs | 640 |
| 500 | Milbon Co Ltd | Goldman Sachs | (233) | 700 | Mitsui Fudosan Co Ltd | Morgan Stanley | (58) |
| (2.200) | MINEBEA MITSUMI Inc | Bank of America Merrill Lynch | 188 | (13) | Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.202) |
| (100) | MINEBEA MITSUMI Inc | Goldman Sachs | 9 | (5) | Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT) | Morgan Stanley | (349) |
| (900) | MINEBEA MITSUMI Inc | Morgan Stanley | — | (200) | Mitsui High-Tec Inc | Goldman Sachs | (311) |
| 1 | Mirai Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 12 | (500) | Mitsui High-Tec Inc | Morgan Stanley | 561 |
| 4 | Mirai Corp (REIT) | Goldman Sachs | 50 | 500 | Mitsui Mining & Smelting Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.184 |
| 500 | Mirait Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (195) | 500 | Mitsui Mining & Smelting Co Ltd | Goldman Sachs | 1.184 |
| 1.500 | Mirait Holdings Corp | Goldman Sachs | (583) | 400 | Mitsui Mining & Smelting Co Ltd | Morgan Stanley | 109 |
| 100 | Miroku Jyoho Service Co Ltd | Goldman Sachs | 47 | (200) | Mitsui OSK Lines Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 167 |
| (300) | MISUMI Group Inc | Morgan Stanley | (14) | (800) | Mitsui OSK Lines Ltd | Goldman Sachs | 35 |
| (1.000) | Mitani Sekisan Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.757) | (100) | Mitsui OSK Lines Ltd | Morgan Stanley | 114 |
| (200) | Mitani Sekisan Co Ltd | Goldman Sachs | (551) | (100) | Mitsui-Soko Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (78) |
| 1.300 | Mitsubishi Chemical Holdings Corp | Goldman Sachs | 242 | (300) | Mitsui-Soko Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (233) |
| 5.600 | Mitsubishi Chemical Holdings Corp | Morgan Stanley | (600) | (1.700) | Mitsuuroko Group Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 224 |
| 2.800 | Mitsubishi Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4.110 | (1.600) | Miura Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.309) |
| 2.500 | Mitsubishi Corp | Goldman Sachs | 955 | (600) | Miura Co Ltd | Goldman Sachs | (423) |
| 3.400 | Mitsubishi Corp | Morgan Stanley | 818 | (1.100) | Miura Co Ltd | Morgan Stanley | (991) |
| (500) | Mitsubishi Electric Corp | Goldman Sachs | 50 | 300 | Mixi Inc | Bank of America Merrill Lynch | 17 |
| (2.000) | Mitsubishi Electric Corp | Morgan Stanley | 155 | 600 | Mixi Inc | Goldman Sachs | 339 |
| 800 | Mitsubishi Estate Co Ltd | Morgan Stanley | (359) | 6.100 | Mizuho Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (327) |
| (1.400) | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.163) | 400 | Mizuho Financial Group Inc | Goldman Sachs | 62 |
| (1.400) | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | Goldman Sachs | (1.163) | 4.000 | Mizuho Financial Group Inc | Morgan Stanley | (316) |
| (600) | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | Morgan Stanley | (312) | 400 | Mizuho Leasing Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 261 |
| 12.000 | Mitsubishi HC Capital Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.728 | 900 | Mizuho Leasing Co Ltd | Goldman Sachs | 587 |
| 4.600 | Mitsubishi HC Capital Inc | Goldman Sachs | 1.429 | 100 | Mizuno Corp | Bank of America Merrill Lynch | 10 |
| (400) | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | Morgan Stanley | (158) | (100) | Mochida Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | 47 |
| 100 | Mitsubishi Logisnext Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 57 | (1.200) | Modec Inc | Goldman Sachs | (1.221) |
| 500 | Mitsubishi Logistics Corp | Bank of America Merrill Lynch | (97) | (300) | Money Forward Inc | Bank of America Merrill Lynch | (874) |
| 1.200 | Mitsubishi Logistics Corp | Goldman Sachs | (233) | (200) | Money Forward Inc | Morgan Stanley | (85) |
| 1.000 | Mitsubishi Logistics Corp | Morgan Stanley | (311) | 300 | Monogatari Corp | Bank of America Merrill Lynch | 23 |
| 1.300 | Mitsubishi Materials Corp | Morgan Stanley | 71 | 300 | Monogatari Corp | Goldman Sachs | 23 |
| 12.800 | Mitsubishi Motors Corp | Goldman Sachs | 1.690 | 1.000 | MonotaRO Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (360) |
| 700 | Mitsubishi Pencil Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 310 | 1.000 | MonotaRO Co Ltd | Goldman Sachs | (715) |
| 1.200 | Mitsubishi Pencil Co Ltd | Goldman Sachs | 531 | 1.500 | MonotaRO Co Ltd | Morgan Stanley | (935) |
| 100 | Mitsubishi Research Institute Inc | Bank of America Merrill Lynch | 70 | (73) | Mori Hills Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (2.948) |
| (11.400) | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | Goldman Sachs | (71) | 1 | Mori Trust Hotel Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 26 |
| (2.100) | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | Morgan Stanley | 69 | (1) | Mori Trust Sogo Inc (REIT) | Goldman Sachs | (30) |
| 1.200 | Mitsuboshi Belting Ltd | Goldman Sachs | 1.752 | (300) | Morinaga & Co Ltd | Goldman Sachs | (268) |
| 1.100 | Mitsui & Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.683 | (900) | Morinaga & Co Ltd | Morgan Stanley | (35) |
| 1.400 | Mitsui & Co Ltd | Goldman Sachs | 2.142 | (1.700) | Morinaga Milk Industry Co Ltd | Morgan Stanley | 2.996 |
| 6.500 | Mitsui & Co Ltd | Morgan Stanley | 4.906 | 1.200 | Morita Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (158) |
| 600 | Mitsui Chemicals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 466 | 1.800 | Morita Holdings Corp | Goldman Sachs | (238) |
| 700 | Mitsui Chemicals Inc | Goldman Sachs | 544 | (100) | MOS Food Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | (40) |
| 500 | Mitsui Chemicals Inc | Morgan Stanley | 369 | 1.200 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.861 |
| 1.800 | Mitsui DM Sugar Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (363) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--|-------------------------------|---|--------------------------|---------------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 2.000 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.877 | 100 | Nichicon Corp | Goldman Sachs | 82 |
| 3.500 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.889 | (300) | Nichiden Corp | Goldman Sachs | (100) |
| 300 | Murata Manufacturing Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 156 | 500 | Nichiha Corp | Bank of America Merrill Lynch | 621 |
| 100 | Murata Manufacturing Co Ltd | Goldman Sachs | 52 | 300 | Nichi-iko Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 621 |
| (400) | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (273) | 500 | Nichi-iko Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | 338 |
| (1.100) | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd | Goldman Sachs | (752) | 1.800 | Nichirei Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.636) |
| (200) | Musashino Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (6) | 2.100 | Nichirei Corp | Goldman Sachs | (1.908) |
| (300) | Musashino Bank Ltd | Goldman Sachs | (9) | 1.100 | Nichirei Corp | Morgan Stanley | (350) |
| (1.400) | Nabtesco Corp | Bank of America Merrill Lynch | (707) | (200) | Nidec Corp | Bank of America Merrill Lynch | (623) |
| (600) | Nabtesco Corp | Goldman Sachs | (303) | (500) | Nidec Corp | Goldman Sachs | (1.557) |
| (100) | Nachi-Fujikoshi Corp | Goldman Sachs | (4) | (800) | Nidec Corp | Morgan Stanley | (1.696) |
| (200) | Nafco Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 2 | (200) | Nifco Inc | Bank of America Merrill Lynch | (382) |
| (900) | Nafco Co Ltd | Goldman Sachs | (53) | (700) | Nifco Inc | Goldman Sachs | (1.337) |
| (300) | Nagase & Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (21) | (400) | Nifco Inc | Morgan Stanley | (323) |
| (1.000) | Nagase & Co Ltd | Goldman Sachs | (70) | (600) | Nihon Chouzai Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (79) |
| (300) | Nagase & Co Ltd | Morgan Stanley | (96) | (900) | Nihon Chouzai Co Ltd | Goldman Sachs | (119) |
| 900 | Nagoya Railroad Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (727) | 600 | Nihon Kohden Corp | Bank of America Merrill Lynch | — |
| 600 | Nagoya Railroad Co Ltd | Goldman Sachs | (485) | 1.500 | Nihon Kohden Corp | Goldman Sachs | — |
| 600 | Nagoya Railroad Co Ltd | Morgan Stanley | (377) | 1.100 | Nihon Kohden Corp | Morgan Stanley | (1.025) |
| 1.000 | Nakanishi Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.666 | 1.000 | Nihon M&A Center Holdings Inc | Morgan Stanley | 699 |
| 700 | Nakanishi Inc | Goldman Sachs | 2.566 | 1.600 | Nihon Parkerizing Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 346 |
| 200 | Nankai Electric Railway Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (134) | 1.500 | Nihon Parkerizing Co Ltd | Goldman Sachs | 326 |
| 1.200 | Nankai Electric Railway Co Ltd | Goldman Sachs | (801) | 100 | Nikkiso Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (23) |
| 900 | Nankai Electric Railway Co Ltd | Morgan Stanley | (727) | 100 | Nikon Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (14) |
| (100) | Nanto Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 19 | (400) | Nikon Corp | Goldman Sachs | (283) |
| (1.100) | Nanto Bank Ltd | Goldman Sachs | 214 | (100) | Nintendo Co Ltd | Goldman Sachs | (839) |
| 400 | NEC Corp | Bank of America Merrill Lynch | 78 | 400 | Nippon Corp | Bank of America Merrill Lynch | (174) |
| 800 | NEC Corp | Goldman Sachs | 470 | 900 | Nippon Corp | Goldman Sachs | (391) |
| 1.400 | NEC Corp | Morgan Stanley | 217 | (6) | Nippon Accommodations Fund Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.165) |
| 200 | NEC Networks & System Integration Corp | Bank of America Merrill Lynch | (61) | (1) | Nippon Accommodations Fund Inc (REIT) | Goldman Sachs | (194) |
| 500 | NEC Networks & System Integration Corp | Morgan Stanley | (27) | (2) | Nippon Accommodations Fund Inc (REIT) | Morgan Stanley | (373) |
| 200 | NET One Systems Co Ltd | Goldman Sachs | 165 | (16) | Nippon Building Fund Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.169) |
| 1.000 | NET One Systems Co Ltd | Morgan Stanley | (202) | (6) | Nippon Building Fund Inc (REIT) | Morgan Stanley | (269) |
| (600) | Nexon Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.239) | (800) | Nippon Carbon Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (901) |
| (800) | Nexon Co Ltd | Goldman Sachs | (1.653) | (200) | Nippon Carbon Co Ltd | Goldman Sachs | (225) |
| 400 | Nextage Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 183 | 100 | Nippon Ceramic Co Ltd | Goldman Sachs | (71) |
| 1.000 | Nextage Co Ltd | Goldman Sachs | 531 | 100 | Nippon Densetsu Kogyo Co Ltd | Goldman Sachs | 16 |
| (700) | NGK Insulators Ltd | Goldman Sachs | (625) | (1.000) | Nippon Electric Glass Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (365) |
| (2.600) | NGK Insulators Ltd | Morgan Stanley | (1.535) | (900) | Nippon Electric Glass Co Ltd | Goldman Sachs | (329) |
| (400) | NGK Spark Plug Co Ltd | Morgan Stanley | 40 | (1.600) | Nippon Electric Glass Co Ltd | Morgan Stanley | (559) |
| (1.000) | NH Foods Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 932 | 300 | Nippon Express Holdings Inc | Morgan Stanley | 23 |
| (400) | NH Foods Ltd | Goldman Sachs | 373 | (500) | Nippon Gas Co Ltd | Goldman Sachs | (120) |
| (3.100) | NHK Spring Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (770) | 2 | Nippon Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 217 |
| (3.500) | NHK Spring Co Ltd | Goldman Sachs | (870) | | | | |
| (1.800) | NHK Spring Co Ltd | Morgan Stanley | (182) | | | | |
| (100) | Nichias Corp | Bank of America Merrill Lynch | (34) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|------------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|---|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 1 | Nippon Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 109 | (200) | Nishimatsuya Chain Co Ltd | Goldman Sachs | 83 |
| (100) | Nippon Kanzai Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (45) | (100) | Nishi-Nippon Financial Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (14) |
| (200) | Nippon Kanzai Co Ltd | Goldman Sachs | (90) | (4.000) | Nishi-Nippon Railroad Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 808 |
| (8.800) | Nippon Kayaku Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (3.827) | (100) | Nishio Rent All Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 43 |
| (2.700) | Nippon Kayaku Co Ltd | Morgan Stanley | (797) | (500) | Nissan Chemical Corp | Goldman Sachs | (27) |
| (500) | Nippon Light Metal Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 97 | 2.300 | Nissan Shatai Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 411 |
| (1.700) | Nippon Paint Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 158 | 300 | Nissan Shatai Co Ltd | Goldman Sachs | 54 |
| 700 | Nippon Paper Industries Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (109) | (100) | Nissei ASB Machine Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (256) |
| 800 | Nippon Paper Industries Co Ltd | Goldman Sachs | (98) | (200) | Nissei ASB Machine Co Ltd | Goldman Sachs | (513) |
| 400 | Nippon Parking Development Co Ltd | Goldman Sachs | 12 | (300) | Nissha Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (105) |
| (400) | Nippon Road Co Ltd | Goldman Sachs | 652 | (200) | Nissha Co Ltd | Goldman Sachs | (37) |
| (1.400) | Nippon Sanso Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (248) | (3.600) | Nisshin Seifun Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.830 |
| (500) | Nippon Sanso Holdings Corp | Goldman Sachs | (85) | (1.500) | Nisshin Seifun Group Inc | Goldman Sachs | 651 |
| (600) | Nippon Sanso Holdings Corp | Morgan Stanley | (98) | (1.400) | Nisshin Seifun Group Inc | Morgan Stanley | 380 |
| 100 | Nippon Seiki Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 17 | (900) | Nisshinbo Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (349) |
| 200 | Nippon Seiki Co Ltd | Goldman Sachs | 23 | (1.200) | Nisshinbo Holdings Inc | Goldman Sachs | (466) |
| (9.900) | Nippon Sheet Glass Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.478) | (4.200) | Nissin Electric Co Ltd | Goldman Sachs | (1.239) |
| (2.800) | Nippon Sheet Glass Co Ltd | Goldman Sachs | (411) | 500 | Nissin Foods Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (893) |
| (200) | Nippon Shinyaku Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.305) | 200 | Nitori Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 214 |
| (400) | Nippon Shinyaku Co Ltd | Morgan Stanley | 186 | 100 | Nitori Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 468 |
| (500) | Nippon Shokubai Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (660) | 800 | Nitori Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 3.137 |
| (300) | Nippon Shokubai Co Ltd | Goldman Sachs | (396) | (100) | Nitta Corp | Bank of America Merrill Lynch | (24) |
| (100) | Nippon Shokubai Co Ltd | Morgan Stanley | (148) | 100 | Nittetsu Mining Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 303 |
| (100) | Nippon Signal Company Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (13) | 700 | Nitto Boseki Co Ltd | Goldman Sachs | 1.919 |
| 200 | Nippon Soda Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 365 | 400 | Nitto Denko Corp | Goldman Sachs | 1.243 |
| 100 | Nippon Soda Co Ltd | Goldman Sachs | 183 | 2.700 | Nitto Kogyo Corp | Goldman Sachs | 4.550 |
| (300) | Nippon Steel Corp | Bank of America Merrill Lynch | (273) | 100 | Nittoku Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 108 |
| (600) | Nippon Steel Corp | Goldman Sachs | (590) | (400) | Noevir Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (839) |
| (900) | Nippon Steel Corp | Morgan Stanley | (881) | (500) | Noevir Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (738) |
| (100) | Nippon Steel Trading Corp | Bank of America Merrill Lynch | (264) | (300) | NOF Corp | Bank of America Merrill Lynch | (606) |
| (500) | Nippon Suisan Kaisha Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 62 | (300) | NOF Corp | Goldman Sachs | (606) |
| (100) | Nippon Suisan Kaisha Ltd | Goldman Sachs | 14 | (500) | NOF Corp | Morgan Stanley | (1.553) |
| 800 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | Bank of America Merrill Lynch | 20 | (100) | Nohmi Bosai Ltd | Goldman Sachs | 36 |
| 600 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | Goldman Sachs | 428 | 100 | Nojima Corp | Bank of America Merrill Lynch | 59 |
| 4.700 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | Morgan Stanley | (180) | 1.300 | NOK Corp | Bank of America Merrill Lynch | 444 |
| 9.200 | Nippon Television Holdings Inc | Morgan Stanley | (71) | 1.200 | NOK Corp | Goldman Sachs | 410 |
| 200 | Nippon Yusen KK | Goldman Sachs | 1.538 | 2.400 | NOK Corp | Morgan Stanley | 857 |
| 300 | Nippon Yusen KK | Morgan Stanley | 1.072 | 800 | Nomura Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 188 |
| 3.700 | Nipro Corp | Bank of America Merrill Lynch | 287 | 800 | Nomura Co Ltd | Goldman Sachs | 159 |
| 2.200 | Nipro Corp | Goldman Sachs | 171 | (15.300) | Nomura Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.072) |
| 100 | Nishimatsu Construction Co Ltd | Goldman Sachs | (55) | (26.100) | Nomura Holdings Inc | Goldman Sachs | (4.974) |
| (1.100) | Nishimatsuya Chain Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 607 | (21.900) | Nomura Holdings Inc | Morgan Stanley | (3.132) |
| | | | | (1.300) | Nomura Real Estate Holdings Inc | Goldman Sachs | (222) |
| | | | | (1.200) | Nomura Real Estate Holdings Inc | Morgan Stanley | 478 |
| | | | | (15) | Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (408) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|----------------------------------|---|--------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (19) | Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT) | Goldman Sachs | (516) | 1.000 | Okamura Corp | Goldman Sachs | 32 |
| (8) | Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT) | Morgan Stanley | (211) | 2.800 | Oki Electric Industry Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (783) |
| 900 | Nomura Research Institute Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.677 | 8.900 | Oki Electric Industry Co Ltd | Goldman Sachs | (2.488) |
| 900 | Nomura Research Institute Ltd | Goldman Sachs | 1.377 | 100 | Okinawa Cellular Telephone Co | Bank of America Merrill Lynch | 62 |
| 400 | Nomura Research Institute Ltd | Morgan Stanley | 47 | 200 | Okinawa Cellular Telephone Co | Goldman Sachs | 124 |
| (200) | Noritake Co Ltd | Goldman Sachs | (194) | 100 | Okinawa Electric Power Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (39) |
| 300 | Noritsu Koki Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 459 | (1.400) | Okinawa Financial Group Inc | Goldman Sachs | (511) |
| 100 | Noritsu Koki Co Ltd | Goldman Sachs | 153 | (200) | OKUMA Corp | Bank of America Merrill Lynch | (326) |
| (300) | Noritz Corp | Bank of America Merrill Lynch | (61) | (800) | OKUMA Corp | Goldman Sachs | (1.305) |
| (300) | Noritz Corp | Goldman Sachs | (61) | (600) | OKUMA Corp | Morgan Stanley | (373) |
| (7.100) | North Pacific Bank Ltd | Goldman Sachs | 276 | 300 | Okumura Corp | Bank of America Merrill Lynch | (119) |
| (900) | NS Solutions Corp | Bank of America Merrill Lynch | (594) | 100 | Okumura Corp | Goldman Sachs | (40) |
| (100) | NS Solutions Corp | Goldman Sachs | (66) | 800 | Olympus Corp | Bank of America Merrill Lynch | 426 |
| (300) | NS Solutions Corp | Morgan Stanley | 140 | 200 | Olympus Corp | Goldman Sachs | 106 |
| 100 | NS United Kaiun Kaisha Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 311 | 200 | Omron Corp | Bank of America Merrill Lynch | 307 |
| 100 | NS United Kaiun Kaisha Ltd | Goldman Sachs | 311 | 1.200 | Omron Corp | Goldman Sachs | 1.549 |
| 100 | NSD Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 20 | 900 | Omron Corp | Morgan Stanley | (168) |
| 700 | NSK Ltd | Goldman Sachs | 38 | 1 | One Inc (REIT) | Goldman Sachs | 68 |
| 1.300 | NSK Ltd | Morgan Stanley | (50) | (300) | Ono Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 39 |
| (1.200) | NTN Corp | Bank of America Merrill Lynch | (41) | (200) | Ono Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | 137 |
| (300) | NTN Corp | Goldman Sachs | 9 | (2.200) | Ono Pharmaceutical Co Ltd | Morgan Stanley | 2.534 |
| 1.000 | NTT Data Corp | Bank of America Merrill Lynch | 78 | 300 | Onward Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 35 |
| 800 | NTT Data Corp | Goldman Sachs | 62 | (100) | Open Door Inc | Bank of America Merrill Lynch | (65) |
| 1.800 | NTT Data Corp | Morgan Stanley | (294) | (600) | Open Door Inc | Goldman Sachs | (391) |
| (5) | NTT UD Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (128) | (600) | Open House Group Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.054) |
| (7) | NTT UD Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (179) | (400) | Open House Group Co Ltd | Goldman Sachs | (941) |
| 2.100 | Obara Group Inc | Goldman Sachs | 1.060 | (900) | Open House Group Co Ltd | Morgan Stanley | 70 |
| 5.700 | Obayashi Corp | Bank of America Merrill Lynch | (55) | (100) | Optex Group Co Ltd | Goldman Sachs | (132) |
| 4.800 | Obayashi Corp | Goldman Sachs | (186) | (100) | Optim Corp | Goldman Sachs | (62) |
| 20.300 | Obayashi Corp | Morgan Stanley | (40) | 100 | Optorun Co Ltd | Goldman Sachs | 100 |
| 300 | OBIC Business Consultants Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 536 | (300) | Oracle Corp Japan | Goldman Sachs | 1.142 |
| 300 | OBIC Business Consultants Co Ltd | Goldman Sachs | 536 | (100) | Organo Corp | Goldman Sachs | 402 |
| 100 | Obic Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (132) | (24.600) | Orient Corp | Goldman Sachs | — |
| 100 | Obic Co Ltd | Goldman Sachs | (132) | (83.200) | Orient Corp | Morgan Stanley | 646 |
| 200 | Obic Co Ltd | Morgan Stanley | (1.056) | 200 | Oriental Land Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 730 |
| 300 | Odakyu Electric Railway Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 14 | 200 | Oriental Land Co Ltd | Goldman Sachs | 832 |
| 1.000 | Odakyu Electric Railway Co Ltd | Goldman Sachs | 126 | (1.300) | ORIX Corp | Morgan Stanley | (914) |
| 1.700 | Odakyu Electric Railway Co Ltd | Morgan Stanley | (401) | (29) | Orix JREIT Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.892) |
| (1.200) | Ogaki Kyoritsu Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 522 | (11) | Orix JREIT Inc (REIT) | Goldman Sachs | (718) |
| (1.100) | Ogaki Kyoritsu Bank Ltd | Goldman Sachs | 478 | (21) | Orix JREIT Inc (REIT) | Morgan Stanley | (257) |
| (100) | Ohsho Food Service Corp | Bank of America Merrill Lynch | (210) | (4.200) | Osaka Gas Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 946 |
| 1.200 | Oiles Corp | Goldman Sachs | 419 | 700 | Osaka Organic Chemical Industry Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 587 |
| (400) | Osix ra daichi Inc | Goldman Sachs | 276 | 1.000 | Osaka Organic Chemical Industry Ltd | Goldman Sachs | 839 |
| (4.000) | Oji Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (311) | (100) | Osaka Soda Co Ltd | Goldman Sachs | 54 |
| (15.200) | Oji Holdings Corp | Morgan Stanley | (236) | (1.100) | OSG Corp | Bank of America Merrill Lynch | (128) |
| 500 | Okamura Corp | Bank of America Merrill Lynch | 73 | (1.200) | OSG Corp | Goldman Sachs | (140) |
| | | | | (300) | OSG Corp | Morgan Stanley | 61 |
| | | | | 2.400 | Otsuka Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.636 |
| | | | | 1.500 | Otsuka Corp | Goldman Sachs | 2.184 |
| | | | | 1.400 | Otsuka Corp | Morgan Stanley | 1.672 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-------------------------------|---|--------------------------|-----------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (500) | Otsuka Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 372 | (1.900) | Pressance Corp | Goldman Sachs | (738) |
| 400 | Outsourcing Inc | Bank of America Merrill Lynch | (189) | 700 | Prestige International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 58 |
| 800 | Outsourcing Inc | Goldman Sachs | (379) | 10.300 | Prestige International Inc | Goldman Sachs | 948 |
| 100 | Pacific Industrial Co Ltd | Goldman Sachs | 64 | (100) | Prima Meat Packers Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 56 |
| 300 | Pack Corp | Bank of America Merrill Lynch | 284 | (100) | Proto Corp | Bank of America Merrill Lynch | (49) |
| 200 | Pack Corp | Goldman Sachs | 189 | (3.000) | Qol Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (932) |
| (300) | PAL GROUP Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (266) | (1.300) | Qol Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (404) |
| 300 | PALTAC Corp | Bank of America Merrill Lynch | (454) | (100) | Raito Kogyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 36 |
| 400 | PALTAC Corp | Goldman Sachs | (606) | (100) | Raiznext Corp | Bank of America Merrill Lynch | (54) |
| 200 | PALTAC Corp | Morgan Stanley | (186) | 300 | Raksul Inc | Bank of America Merrill Lynch | (319) |
| (500) | Pan Pacific International Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (151) | 100 | Raksul Inc | Goldman Sachs | (106) |
| (500) | Pan Pacific International Holdings Corp | Goldman Sachs | (151) | 2.300 | Rakuten Group Inc | Goldman Sachs | (933) |
| (600) | Pan Pacific International Holdings Corp | Morgan Stanley | (1.081) | 3.300 | Rakuten Group Inc | Morgan Stanley | (974) |
| (2.500) | Panasonic Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (564) | 100 | Recruit Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 33 |
| 100 | Paramount Bed Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (18) | 1.500 | Recruit Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 686 |
| 600 | Park24 Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 433 | (100) | Relia Inc | Goldman Sachs | (38) |
| 3.700 | Park24 Co Ltd | Morgan Stanley | (282) | (700) | Relo Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (440) |
| (400) | Pasona Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (454) | (300) | Relo Group Inc | Morgan Stanley | (118) |
| (500) | Pasona Group Inc | Goldman Sachs | (567) | (4.700) | Renesas Electronics Corp | Goldman Sachs | (4.613) |
| 2.800 | Penta-Ocean Construction Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 65 | (400) | Renesas Electronics Corp | Morgan Stanley | (217) |
| 4.400 | Penta-Ocean Construction Co Ltd | Goldman Sachs | 80 | (6.600) | Rengo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 2.254 |
| 4.600 | Penta-Ocean Construction Co Ltd | Morgan Stanley | 32 | (6.700) | Rengo Co Ltd | Goldman Sachs | 2.066 |
| 900 | PeptiDream Inc | Goldman Sachs | (1.146) | (4.400) | Rengo Co Ltd | Morgan Stanley | 860 |
| 100 | PeptiDream Inc | Morgan Stanley | (97) | (1.600) | RENOVA Inc | Goldman Sachs | 87 |
| (700) | Persol Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (228) | (6.300) | Resona Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 494 |
| (1.100) | Persol Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 649 | (3.300) | Resona Holdings Inc | Goldman Sachs | 259 |
| (1.200) | Pharma Foods International Co Ltd | Goldman Sachs | 1.034 | 700 | Resorttrust Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.049 |
| 1.100 | Pigeon Corp | Bank of America Merrill Lynch | (974) | 400 | Resorttrust Inc | Goldman Sachs | 600 |
| 1.500 | Pigeon Corp | Goldman Sachs | (1.328) | 1.900 | Resorttrust Inc | Morgan Stanley | 280 |
| 2.000 | Pigeon Corp | Morgan Stanley | (3.138) | 100 | Retail Partners Co Ltd | Goldman Sachs | (19) |
| (700) | Pilot Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.577) | 6.000 | Ricoh Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 3.134 |
| (600) | Pilot Corp | Goldman Sachs | (1.351) | 500 | Ricoh Co Ltd | Goldman Sachs | 291 |
| (500) | Piolax Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.728) | 6.000 | Ricoh Co Ltd | Morgan Stanley | 1.951 |
| (500) | Piolax Inc | Goldman Sachs | (1.728) | (300) | Ricoh Leasing Co Ltd | Goldman Sachs | (35) |
| (300) | PKSHA Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (144) | (200) | Riken Keiki Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (326) |
| (1.200) | PKSHA Technology Inc | Goldman Sachs | (578) | (800) | Riken Keiki Co Ltd | Goldman Sachs | (1.305) |
| (2.500) | Plaid Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.747 | (100) | Riken Vitamin Co Ltd | Goldman Sachs | 47 |
| (700) | Plenus Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (71) | (100) | Ringer Hut Co Ltd | Goldman Sachs | (22) |
| (500) | Plenus Co Ltd | Goldman Sachs | (50) | 500 | Rinnai Corp | Bank of America Merrill Lynch | 582 |
| (100) | Plus Alpha Consulting Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (25) | 500 | Rinnai Corp | Morgan Stanley | 1.359 |
| 400 | Pola Orbis Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 275 | (700) | Riso Kagaku Corp | Bank of America Merrill Lynch | (419) |
| 1.100 | Pola Orbis Holdings Inc | Goldman Sachs | 683 | 100 | Rohm Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 831 |
| 1.500 | Pola Orbis Holdings Inc | Morgan Stanley | 396 | 100 | Rohm Co Ltd | Goldman Sachs | 401 |
| (1.000) | Premier Anti-Aging Co Ltd | Goldman Sachs | (2.835) | 200 | Rohm Co Ltd | Morgan Stanley | 760 |
| (800) | Pressance Corp | Bank of America Merrill Lynch | (311) | (900) | Rohto Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.418 |
| | | | | (800) | Rohto Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | 1.294 |
| | | | | (600) | Rohto Pharmaceutical Co Ltd | Morgan Stanley | 901 |
| | | | | (100) | Roland Corp | Bank of America Merrill Lynch | (330) |
| | | | | 100 | Rorze Corp | Goldman Sachs | 311 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--|-------------------------------|---|--------------------------|-----------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (400) | Round One Corp | Bank of America Merrill Lynch | 103 | 400 | Sawai Group Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (31) |
| (100) | Royal Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (92) | 500 | Sawai Group Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (680) |
| (300) | RS Technologies Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 373 | 100 | SB Technology Corp | Goldman Sachs | 113 |
| (200) | RS Technologies Co Ltd | Goldman Sachs | 249 | 1.500 | SBI Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (676) |
| 1.700 | Ryohin Keikaku Co Ltd | Goldman Sachs | 1.822 | 500 | SBI Holdings Inc | Goldman Sachs | (225) |
| 800 | Ryohin Keikaku Co Ltd | Morgan Stanley | 280 | 2.600 | SBI Holdings Inc | Morgan Stanley | (424) |
| 100 | Ryosan Co Ltd | Goldman Sachs | 234 | 100 | SBS Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (16) |
| (2.100) | Saibu Gas Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.354 | 300 | SCREEN Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 939 |
| 200 | Saizeriya Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 68 | 700 | SCSK Corp | Bank of America Merrill Lynch | (234) |
| 300 | Saizeriya Co Ltd | Goldman Sachs | 103 | 600 | SCSK Corp | Goldman Sachs | (200) |
| 700 | Sakai Moving Service Co Ltd | Goldman Sachs | (625) | 1.800 | SCSK Corp | Morgan Stanley | (545) |
| 200 | Sakata INX Corp | Bank of America Merrill Lynch | (59) | 100 | Secom Co Ltd | Goldman Sachs | 100 |
| 100 | Sakata INX Corp | Goldman Sachs | (30) | 800 | Sega Sammy Holdings Inc | Goldman Sachs | 373 |
| (500) | Sakata Seed Corp | Bank of America Merrill Lynch | (483) | 300 | Sega Sammy Holdings Inc | Morgan Stanley | (35) |
| (500) | Sakata Seed Corp | Goldman Sachs | (394) | (1.100) | Seibu Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 419 |
| 1.400 | SAMTY Co Ltd | Goldman Sachs | (130) | (1.000) | Seibu Holdings Inc | Goldman Sachs | 381 |
| (1) | Samty Residential Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (37) | (1.200) | Seibu Holdings Inc | Morgan Stanley | 429 |
| (100) | San-A Co Ltd | Goldman Sachs | 30 | 100 | Seikagaku Corp | Bank of America Merrill Lynch | 5 |
| (100) | San-Ai Obbli Co Ltd | Goldman Sachs | — | 400 | Seikagaku Corp | Goldman Sachs | 66 |
| (100) | Sangetsu Corp | Goldman Sachs | 11 | 2.300 | Seiko Epson Corp | Goldman Sachs | 4.555 |
| 200 | San-In Godo Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 2 | (100) | Seiko Holdings Corp | Goldman Sachs | (228) |
| 100 | San-In Godo Bank Ltd | Goldman Sachs | 1 | 1.300 | Seino Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 81 |
| 500 | Sanken Electric Co Ltd | Goldman Sachs | (233) | 2.000 | Seino Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 124 |
| (300) | Sanki Engineering Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 112 | 2.400 | Seino Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 447 |
| (200) | Sanki Engineering Co Ltd | Goldman Sachs | 75 | 600 | Seiren Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (15) |
| (400) | Sankyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (62) | 500 | Seiren Co Ltd | Goldman Sachs | 107 |
| (1.200) | Sankyo Co Ltd | Goldman Sachs | (186) | 600 | Sekisui Chemical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 825 |
| (500) | Sankyo Co Ltd | Morgan Stanley | (19) | 6 | Sekisui House Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 126 |
| 700 | Sankyu Inc | Goldman Sachs | 571 | 41 | Sekisui House Inc (REIT) | Goldman Sachs | 860 |
| 700 | Sankyu Inc | Morgan Stanley | 27 | 41 | Sekisui House Inc (REIT) | Morgan Stanley | 573 |
| (200) | Sanrio Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (134) | 200 | Sekisui House Ltd | Goldman Sachs | 82 |
| (700) | Sanrio Co Ltd | Goldman Sachs | (468) | 2.400 | Sekisui House Ltd | Morgan Stanley | 1.036 |
| (3.200) | Sansan Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.988 | 100 | Sekisui Jushi Corp | Bank of America Merrill Lynch | (7) |
| (800) | Sansan Inc | Morgan Stanley | 926 | (100) | Senko Group Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 23 |
| 1.300 | Santen Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 424 | (2.000) | Septeni Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 326 |
| 1.700 | Santen Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | 555 | (3.800) | Septeni Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 655 |
| 2.700 | Santen Pharmaceutical Co Ltd | Morgan Stanley | 189 | 1.000 | Seria Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (78) |
| (800) | Sanwa Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 180 | 1.500 | Seria Co Ltd | Goldman Sachs | (116) |
| (2.200) | Sanwa Holdings Corp | Goldman Sachs | 495 | (400) | Seven & i Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 708 |
| (2.800) | Sanwa Holdings Corp | Morgan Stanley | 174 | 5.500 | Seven Bank Ltd | Goldman Sachs | 128 |
| (100) | Sanyo Denki Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (210) | 300 | SG Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 40 |
| 100 | Sanyo Special Steel Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 104 | 1.100 | SG Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 145 |
| (800) | Sapporo Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (489) | 1.600 | SG Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 323 |
| (200) | Sapporo Holdings Ltd | Goldman Sachs | (14) | (2.300) | Sharp Corp | Bank of America Merrill Lynch | 103 |
| (100) | Sapporo Holdings Ltd | Morgan Stanley | (70) | (3.800) | Sharp Corp | Goldman Sachs | 207 |
| 1.100 | Sato Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 555 | (3.900) | Sharp Corp | Morgan Stanley | 684 |
| 1.500 | Sato Holdings Corp | Goldman Sachs | 757 | (100) | Shibaura Machine Co Ltd | Goldman Sachs | (363) |
| 600 | Sawai Group Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (47) | (100) | Shibuya Corp | Bank of America Merrill Lynch | (17) |
| | | | | (100) | SHIFT Inc | Bank of America Merrill Lynch | 792 |
| | | | | (700) | Shiga Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.821) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|-----------------------------------|-----------------|---|--------------------------|----------------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (900) | Shiga Bank Ltd | Goldman Sachs | (3.628) | (100) | Showa Sangyo Co Ltd | Bank of America | |
| 100 | Shikoku Chemicals Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 90 |
| | | Merrill Lynch | 21 | 3.000 | Siix Corp | Bank of America | |
| (1.900) | Shikoku Electric Power Co Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 694 |
| | | Merrill Lynch | 74 | 2.000 | Siix Corp | Goldman Sachs | 482 |
| (2.400) | Shikoku Electric Power Co Inc | | | (500) | Sinko Industries Ltd | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | 93 | | | Merrill Lynch | (377) |
| (5.900) | Shikoku Electric Power Co Inc | | | (700) | Sinko Industries Ltd | Goldman Sachs | (527) |
| | | Morgan Stanley | (46) | 1.400 | SKY Perfect JSAT Holdings Inc | Bank of America | |
| (500) | Shima Seiki Manufacturing Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 65 |
| | | Merrill Lynch | (520) | 500 | SKY Perfect JSAT Holdings Inc | Goldman Sachs | 23 |
| 300 | Shimadzu Corp | Morgan Stanley | (221) | (2.100) | Skylark Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 282 |
| (100) | Shimamura Co Ltd | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 101 | (200) | SMC Corp | Merrill Lynch | (2.624) |
| (100) | Shimamura Co Ltd | Goldman Sachs | 101 | | | Goldman Sachs | 59 |
| (300) | Shimamura Co Ltd | Morgan Stanley | 1.654 | (100) | SMC Corp | Bank of America | |
| (100) | Shimano Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (163) |
| | | Merrill Lynch | (404) | 200 | SMS Co Ltd | Goldman Sachs | (109) |
| (100) | Shimano Inc | Goldman Sachs | (500) | 300 | SMS Co Ltd | Morgan Stanley | (303) |
| (100) | Shimano Inc | Morgan Stanley | (194) | (100) | Snow Peak Inc | Goldman Sachs | (343) |
| 5.100 | Shimizu Corp | Bank of America | | (600) | Sodick Co Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (582) | | | Merrill Lynch | (269) |
| 8.900 | Shimizu Corp | Goldman Sachs | (1.320) | (300) | Sodick Co Ltd | Goldman Sachs | (111) |
| 8.000 | Shimizu Corp | Morgan Stanley | (124) | 500 | SoftBank Corp | Bank of America | |
| (100) | Shin-Etsu Polymer Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (72) |
| | | Merrill Lynch | (64) | 900 | SoftBank Corp | Goldman Sachs | 79 |
| (200) | Shin-Etsu Polymer Co Ltd | Goldman Sachs | (127) | 2.500 | SoftBank Corp | Morgan Stanley | (194) |
| (900) | Shinko Electric Industries Co Ltd | | | 300 | SoftBank Group Corp | Goldman Sachs | 627 |
| | | Morgan Stanley | 1.048 | 900 | SoftBank Group Corp | Morgan Stanley | 720 |
| (100) | Shinmaywa Industries Ltd | Goldman Sachs | (20) | (200) | Sohgo Security Services Co Ltd | | |
| (100) | Shinnihon Corp | Bank of America | | | | Morgan Stanley | 16 |
| | | Merrill Lynch | (38) | 1.400 | Sojitz Corp | Bank of America | |
| (1.200) | Shinsei Bank Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 414 |
| | | Merrill Lynch | 1.045 | 300 | Sojitz Corp | Goldman Sachs | 37 |
| (1.900) | Shinsei Bank Ltd | Goldman Sachs | 1.419 | 200 | Sojitz Corp | Morgan Stanley | 42 |
| (200) | Shinsei Bank Ltd | Morgan Stanley | 158 | 100 | Solasto Corp | Bank of America | |
| 100 | Shionogi & Co Ltd | Goldman Sachs | 23 | | | Merrill Lynch | (29) |
| 100 | Shionogi & Co Ltd | Morgan Stanley | (70) | 400 | Sompo Holdings Inc | Bank of America | |
| (500) | Ship Healthcare Holdings Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.804 |
| | | Merrill Lynch | (466) | 1.800 | Sompo Holdings Inc | Goldman Sachs | 8.373 |
| (400) | Ship Healthcare Holdings Inc | | | 500 | Sompo Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.288 |
| | | Goldman Sachs | (373) | (300) | Sony Corp | Bank of America | |
| (300) | Ship Healthcare Holdings Inc | | | | | Merrill Lynch | (1.376) |
| | | Morgan Stanley | (47) | 400 | Sosei Group Corp | Bank of America | |
| (900) | Shiseido Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 6 |
| | | Merrill Lynch | (1.396) | 100 | Sosei Group Corp | Goldman Sachs | 2 |
| (2.500) | Shiseido Co Ltd | Goldman Sachs | (3.432) | (7) | SOSILA Logistics Inc (REIT) | Bank of America | |
| (800) | Shiseido Co Ltd | Morgan Stanley | (870) | | | Merrill Lynch | 28 |
| (5.200) | Shizuoka Bank Ltd | Bank of America | | (9) | SOSILA Logistics Inc (REIT) | Goldman Sachs | 73 |
| | | Merrill Lynch | 1.696 | 200 | Sotetsu Holdings Inc | Goldman Sachs | (90) |
| (2.800) | Shizuoka Bank Ltd | Goldman Sachs | 913 | 1.200 | Sotetsu Holdings Inc | Morgan Stanley | (354) |
| (5.600) | Shizuoka Bank Ltd | Morgan Stanley | 435 | 1.800 | Sparx Group Co Ltd | Bank of America | |
| 700 | Shizuoka Gas Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 295 |
| | | Merrill Lynch | (163) | 1.600 | Sparx Group Co Ltd | Goldman Sachs | 263 |
| 500 | Shizuoka Gas Co Ltd | Goldman Sachs | (116) | 7.700 | S-Pool Inc | Goldman Sachs | (1.674) |
| (200) | SHO-BOND Holdings Co Ltd | Bank of America | | 400 | Square Enix Holdings Co Ltd | | |
| | | Merrill Lynch | (419) | | | Morgan Stanley | 435 |
| (900) | SHO-BOND Holdings Co Ltd | | | (900) | SRE Holdings Corp | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | (1.887) | | | Merrill Lynch | 435 |
| (300) | SHO-BOND Holdings Co Ltd | | | (1.700) | SRE Holdings Corp | Goldman Sachs | 1.056 |
| | | Morgan Stanley | (466) | (1.900) | Stanley Electric Co Ltd | Bank of America | |
| (400) | Shochiku Co Ltd | Goldman Sachs | (746) | | | Merrill Lynch | (1.510) |
| (400) | Shochiku Co Ltd | Morgan Stanley | (217) | (1.300) | Stanley Electric Co Ltd | Goldman Sachs | (963) |
| 700 | Shoei Co Ltd | Bank of America | | (2.400) | Stanley Electric Co Ltd | Morgan Stanley | (1.388) |
| | | Merrill Lynch | 870 | 1 | Star Asia Investment Corp (REIT) | Bank of America | |
| 1.200 | Shoei Co Ltd | Goldman Sachs | 1.491 | | | Merrill Lynch | 12 |
| (1.000) | Showa Denko KK | Bank of America | | (200) | Star Micronics Co Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.448) | | | Merrill Lynch | (110) |
| (5.400) | Showa Denko KK | Goldman Sachs | (6.040) | (500) | Star Micronics Co Ltd | Goldman Sachs | (251) |
| (2.200) | Showa Denko KK | Morgan Stanley | (1.909) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-------------------------------|---|--------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 3 | Takara Leben Real Estate Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 44 | (100) | Toho Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 21 |
| 100 | Takara Standard Co Ltd | Goldman Sachs | (26) | (200) | Toho Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 42 |
| (200) | Takasago International Corp | Bank of America Merrill Lynch | 345 | (200) | Toho Titanium Co Ltd | Goldman Sachs | (794) |
| 100 | Takasago Thermal Engineering Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (35) | 100 | Tohoku Electric Power Co Inc | Goldman Sachs | (37) |
| 1.600 | Takashimaya Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 609 | 1.300 | Tohoku Electric Power Co Inc | Morgan Stanley | (262) |
| 3.800 | Takashimaya Co Ltd | Morgan Stanley | 767 | (2.600) | Tokai Carbon Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.604) |
| (100) | Takeuchi Manufacturing Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1) | (400) | Tokai Carbon Co Ltd | Goldman Sachs | (273) |
| (300) | Taki Chemical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 245 | (9.400) | Tokai Carbon Co Ltd | Morgan Stanley | (5.402) |
| (400) | Taki Chemical Co Ltd | Goldman Sachs | 326 | 200 | Tokai Corp | Bank of America Merrill Lynch | 47 |
| 1.600 | Takuma Co Ltd | Goldman Sachs | (596) | 600 | Tokai Corp | Goldman Sachs | 140 |
| (1.700) | Tama Home Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 2.838 | (1.900) | TOKAI Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (162) |
| (300) | Tama Home Co Ltd | Goldman Sachs | 501 | (4.700) | TOKAI Holdings Corp | Goldman Sachs | (402) |
| (400) | Tamura Corp | Goldman Sachs | (62) | 100 | Tokai Rika Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 26 |
| 1.600 | TBS Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 13 | 200 | Tokai Tokyo Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 5 |
| 700 | TBS Holdings Inc | Goldman Sachs | 28 | 100 | Token Corp | Bank of America Merrill Lynch | 140 |
| 200 | TBS Holdings Inc | Morgan Stanley | (3) | 300 | Token Corp | Goldman Sachs | 243 |
| 300 | TDK Corp | Goldman Sachs | 594 | 1.100 | Tokio Marine Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.551 |
| (100) | TechMatrix Corp | Bank of America Merrill Lynch | 12 | 1.400 | Tokio Marine Holdings Inc | Goldman Sachs | 6.322 |
| (400) | TechMatrix Corp | Goldman Sachs | 50 | 400 | Tokio Marine Holdings Inc | Morgan Stanley | 516 |
| (1.900) | TechnoPro Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (309) | (100) | Tokushu Tokai Paper Co Ltd | Goldman Sachs | 16 |
| (800) | TechnoPro Holdings Inc | Goldman Sachs | (342) | 500 | Tokuyama Corp | Bank of America Merrill Lynch | (217) |
| (300) | TechnoPro Holdings Inc | Morgan Stanley | 45 | 100 | Tokuyama Corp | Goldman Sachs | (43) |
| (1.100) | Teijin Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 43 | (4.200) | Tokyo Electric Power Co Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 552 |
| (200) | Teijin Ltd | Morgan Stanley | 3 | (3.600) | Tokyo Electric Power Co Holdings Inc | Goldman Sachs | 625 |
| 100 | Teikoku Sen-I Co Ltd | Goldman Sachs | 104 | (15.600) | Tokyo Electric Power Co Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.423 |
| (1.700) | Tenma Corp | Goldman Sachs | (2.033) | 200 | Tokyo Electron Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 3.044 |
| 600 | Terumo Corp | Goldman Sachs | 885 | (300) | Tokyo Gas Co Ltd | Goldman Sachs | 198 |
| 1.200 | Terumo Corp | Morgan Stanley | 634 | (1.400) | Tokyo Gas Co Ltd | Morgan Stanley | 870 |
| 200 | T-Gaia Corp | Bank of America Merrill Lynch | (25) | (200) | Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 91 |
| 400 | T-Gaia Corp | Goldman Sachs | (50) | (200) | Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd | Goldman Sachs | (130) |
| (1.500) | THK Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (396) | (200) | Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd | Morgan Stanley | 124 |
| (300) | THK Co Ltd | Goldman Sachs | (79) | (700) | Tokyo Seimitsu Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.386) |
| (700) | THK Co Ltd | Morgan Stanley | 82 | (200) | Tokyo Seimitsu Co Ltd | Goldman Sachs | (396) |
| (300) | TIS Inc | Goldman Sachs | 102 | (3.800) | Tokyo Seimitsu Co Ltd | Morgan Stanley | 2.125 |
| (100) | TIS Inc | Morgan Stanley | 62 | 300 | Tokyotokeiba Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 105 |
| (100) | TKC Corp | Goldman Sachs | 8 | 300 | Tokyotokeiba Co Ltd | Goldman Sachs | 17 |
| (100) | TKP Corp | Bank of America Merrill Lynch | 18 | 1.200 | Tokyu Construction Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (76) |
| 700 | Toa Corp | Bank of America Merrill Lynch | (957) | 500 | Tokyu Construction Co Ltd | Goldman Sachs | (38) |
| 200 | Toa Corp | Goldman Sachs | (273) | (5.300) | Tokyu Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4.733 |
| (200) | Toagosei Co Ltd | Goldman Sachs | (22) | (400) | Tokyu Fudosan Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (28) |
| (1.000) | Tobu Railway Co Ltd | Morgan Stanley | 272 | (7.400) | Tokyu Fudosan Holdings Corp | Goldman Sachs | (517) |
| (500) | TOC Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (23) | (3.900) | Tokyu Fudosan Holdings Corp | Morgan Stanley | 273 |
| (100) | TOC Co Ltd | Goldman Sachs | (5) | 6 | Tokyu Inc (REIT) | Goldman Sachs | 308 |
| (600) | Tocalo Co Ltd | Goldman Sachs | (266) | (5.100) | TOMONY Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 317 |
| (800) | Toda Corp | Bank of America Merrill Lynch | 155 | (7.300) | TOMONY Holdings Inc | Goldman Sachs | 454 |
| (1.700) | Toda Corp | Goldman Sachs | 330 | | | | |
| (3.200) | Toda Corp | Morgan Stanley | (50) | | | | |
| (600) | Toei Co Ltd | Goldman Sachs | (1.584) | | | | |
| (400) | Toho Bank Ltd | Goldman Sachs | (2) | | | | |
| (400) | Toho Co Ltd | Goldman Sachs | (637) | | | | |
| (700) | Toho Gas Co Ltd | Goldman Sachs | 495 | | | | |
| (600) | Toho Gas Co Ltd | Morgan Stanley | 582 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (100) | Tomy Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 6 | 1.500 | Toyota Tsusho Corp | Morgan Stanley | 4.310 |
| (3.700) | Tomy Co Ltd | Goldman Sachs | (2.040) | 3.200 | TPR Co Ltd | Goldman Sachs | 1.069 |
| (300) | Topcon Corp | Bank of America Merrill Lynch | 116 | (100) | Transcosmos Inc | Bank of America Merrill Lynch | (264) |
| (400) | Topcon Corp | Goldman Sachs | 155 | (500) | TRE Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (707) |
| (3.600) | Toppan Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.482) | (500) | TRE Holdings Corp | Goldman Sachs | (707) |
| (1.400) | Toppan Inc | Goldman Sachs | (576) | 400 | Trend Micro Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.149 |
| (100) | Topre Corp | Goldman Sachs | 1 | 1.600 | Trend Micro Inc | Goldman Sachs | 4.598 |
| (4.800) | Toray Industries Inc | Morgan Stanley | 119 | 900 | Tri Chemical Laboratories Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.454 |
| 400 | Toridoll Holdings Corp | Goldman Sachs | 233 | 900 | Tri Chemical Laboratories Inc | Goldman Sachs | 1.435 |
| (300) | Torii Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | (158) | 2.200 | Trusco Nakayama Corp | Bank of America Merrill Lynch | 289 |
| 1.200 | Tosei Corp | Bank of America Merrill Lynch | 242 | 3.000 | Trusco Nakayama Corp | Goldman Sachs | 788 |
| 2.200 | Tosei Corp | Goldman Sachs | 444 | 500 | TS Tech Co Ltd | Goldman Sachs | 106 |
| (1.000) | Toshiba Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.672) | (200) | Tsubaki Nakashima Co Ltd | Goldman Sachs | (26) |
| (300) | Toshiba Corp | Morgan Stanley | (426) | 100 | Tsubakimoto Chain Co | Goldman Sachs | 116 |
| (700) | Toshiba TEC Corp | Bank of America Merrill Lynch | (435) | (400) | Tsugami Corp | Bank of America Merrill Lynch | (100) |
| (500) | Toshiba TEC Corp | Goldman Sachs | (311) | (1.500) | Tsugami Corp | Goldman Sachs | (373) |
| 200 | Tosho Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (14) | 200 | Tsukishima Kikai Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 39 |
| 300 | Tosho Co Ltd | Goldman Sachs | (21) | 300 | Tsukishima Kikai Co Ltd | Goldman Sachs | 58 |
| 1.700 | Tosoh Corp | Bank of America Merrill Lynch | (224) | 500 | Tsumura & Co | Bank of America Merrill Lynch | (334) |
| 500 | Tosoh Corp | Goldman Sachs | (66) | 800 | Tsumura & Co | Goldman Sachs | (534) |
| 1.800 | Tosoh Corp | Morgan Stanley | (14) | 500 | Tsumura & Co | Morgan Stanley | (12) |
| 500 | Totetsu Kogyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 252 | 100 | Tsuruha Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 264 |
| 900 | Totetsu Kogyo Co Ltd | Goldman Sachs | 392 | 1.100 | Tsuruha Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.905 |
| 400 | TOTO Ltd | Goldman Sachs | (264) | 100 | Tsuruha Holdings Inc | Morgan Stanley | 109 |
| 200 | TOTO Ltd | Morgan Stanley | 140 | 900 | TV Asahi Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (115) |
| 100 | Towa Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | (54) | 1.000 | TV Asahi Holdings Corp | Goldman Sachs | (112) |
| (100) | Toyo Construction Co Ltd | Goldman Sachs | (6) | 100 | UACJ Corp | Bank of America Merrill Lynch | 47 |
| 100 | Toyo Gosei Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 544 | 600 | UACJ Corp | Goldman Sachs | 280 |
| 700 | Toyo Ink SC Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (174) | (1.300) | UBE Corp | Bank of America Merrill Lynch | (414) |
| 1.200 | Toyo Ink SC Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (253) | (900) | UBE Corp | Goldman Sachs | (287) |
| (1.100) | Toyo Seikan Group Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (484) | (1.000) | UBE Corp | Morgan Stanley | 202 |
| (500) | Toyo Seikan Group Holdings Ltd | Morgan Stanley | (79) | (200) | Uchida Yoko Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (497) |
| (200) | Toyo Suisan Kaisha Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (33) | (300) | Uchida Yoko Co Ltd | Goldman Sachs | (746) |
| (900) | Toyo Suisan Kaisha Ltd | Goldman Sachs | (717) | 200 | Ulvac Inc | Bank of America Merrill Lynch | 320 |
| (700) | Toyo Tanso Co Ltd | Goldman Sachs | (11) | 2.900 | Unicharm Corp | Morgan Stanley | (541) |
| (800) | Toyo Tire Corp | Bank of America Merrill Lynch | (224) | 200 | United Arrows Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 216 |
| (1.900) | Toyo Tire Corp | Goldman Sachs | (531) | 700 | United Arrows Ltd | Goldman Sachs | 756 |
| 100 | Toyobo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (23) | (100) | United Super Markets Holdings Inc | Goldman Sachs | 10 |
| 700 | Toyobo Co Ltd | Goldman Sachs | (163) | (29) | United Urban Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (23) |
| (700) | Toyoda Gosei Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (304) | (8) | United Urban Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (6) |
| (600) | Toyoda Gosei Co Ltd | Goldman Sachs | (304) | (12) | United Urban Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 280 |
| (2.100) | Toyota Boshoku Corp | Morgan Stanley | (172) | (100) | Universal Entertainment Corp | Morgan Stanley | 43 |
| (1.100) | Toyota Boshoku Corp | Bank of America Merrill Lynch | (228) | (300) | Universal Entertainment Corp | Bank of America Merrill Lynch | 130 |
| (900) | Toyota Boshoku Corp | Goldman Sachs | (120) | (100) | Usen-Next Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 15 |
| (400) | Toyota Industries Corp | Goldman Sachs | (466) | (200) | Ushio Inc | Goldman Sachs | (56) |
| (200) | Toyota Industries Corp | Morgan Stanley | 16 | (1.100) | Ushio Inc | Goldman Sachs | (910) |
| 1.200 | Toyota Motor Corp | Morgan Stanley | 568 | | | | |
| 600 | Toyota Tsusho Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.007 | | | | |
| 300 | Toyota Tsusho Corp | Goldman Sachs | 1.017 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|-------------------------------|-----------------|---|--------------------------|-------------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (1.000) | Ushio Inc | Morgan Stanley | (525) | 600 | Yellow Hat Ltd | Bank of America | |
| (1.400) | USS Co Ltd | Goldman Sachs | 1.794 | | | Merrill Lynch | (121) |
| (800) | USS Co Ltd | Morgan Stanley | 1.106 | 1.800 | Yellow Hat Ltd | Goldman Sachs | (174) |
| 100 | UT Group Co Ltd | Bank of America | | (200) | Yodogawa Steel Works Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 12 | | | Merrill Lynch | (3) |
| (1.000) | Uzabase Inc | Bank of America | | (100) | Yodogawa Steel Works Ltd | Goldman Sachs | (2) |
| | | Merrill Lynch | (707) | 1.200 | Yokogawa Bridge Holdings Corp | Bank of America | |
| (800) | Uzabase Inc | Goldman Sachs | (565) | | | Merrill Lynch | 373 |
| 100 | Valor Holdings Co Ltd | Bank of America | | 1.900 | Yokogawa Bridge Holdings Corp | Goldman Sachs | 590 |
| | | Merrill Lynch | (9) | (2.300) | Yokogawa Electric Corp | Bank of America | |
| 300 | ValueCommerce Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (1.518) |
| | | Merrill Lynch | 163 | (1.700) | Yokogawa Electric Corp | Goldman Sachs | (1.122) |
| 400 | ValueCommerce Co Ltd | Goldman Sachs | 217 | (800) | Yokogawa Electric Corp | Morgan Stanley | (528) |
| 400 | Vector Inc | Bank of America | | 1.900 | Yokohama Rubber Co Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 8 | | | Merrill Lynch | (398) |
| 100 | Vision Inc [†] | Goldman Sachs | — | 1.000 | Yokohama Rubber Co Ltd | Goldman Sachs | (210) |
| (200) | Visional Inc | Bank of America | | 1.500 | Yokohama Rubber Co Ltd | Morgan Stanley | 23 |
| | | Merrill Lynch | 466 | 100 | Yokorei Co Ltd | Bank of America | |
| (200) | Visional Inc | Goldman Sachs | 466 | | | Merrill Lynch | (18) |
| 100 | VT Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 9 | (1.600) | Yokowo Co Ltd | Bank of America | |
| 2.100 | Wacoal Holdings Corp | Goldman Sachs | 489 | | | Merrill Lynch | (1.429) |
| 2.300 | Wacom Co Ltd | Bank of America | | (1.200) | Yokowo Co Ltd | Goldman Sachs | (1.072) |
| | | Merrill Lynch | (1.179) | 100 | Yonex Co Ltd | Goldman Sachs | 57 |
| 400 | Wacom Co Ltd | Goldman Sachs | (205) | (900) | Yoshinoya Holdings Co Ltd | Bank of America | |
| 1.200 | Wakita & Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 193 |
| | | Merrill Lynch | 466 | (1.200) | Yoshinoya Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 338 |
| 900 | Wakita & Co Ltd | Goldman Sachs | 349 | 900 | Yuasa Trading Co Ltd | Bank of America | |
| (2.400) | WealthNavi Inc | Goldman Sachs | (2.274) | | | Merrill Lynch | 1.482 |
| 100 | Weathernews Inc | Bank of America | | 600 | Yuasa Trading Co Ltd | Goldman Sachs | 988 |
| | | Merrill Lynch | 8 | (1.200) | Yukiguni Maitake Co Ltd | Bank of America | |
| 1.100 | Welcia Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (350) | | | Merrill Lynch | 10 |
| (100) | West Holdings Corp | Bank of America | | (700) | Yukiguni Maitake Co Ltd | Goldman Sachs | 435 |
| | | Merrill Lynch | 93 | 4.300 | Yurtec Corp | Goldman Sachs | 701 |
| (200) | West Japan Railway Co | Bank of America | | 10.800 | Z Holdings Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 109 | | | Merrill Lynch | (437) |
| (500) | West Japan Railway Co | Goldman Sachs | 244 | 10.800 | Z Holdings Corp | Goldman Sachs | 689 |
| (1.800) | West Japan Railway Co | Morgan Stanley | 625 | 8.800 | Z Holdings Corp | Morgan Stanley | (495) |
| (200) | World Holdings Co Ltd | Bank of America | | 400 | Zenkoku Hosho Co Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (126) | | | Merrill Lynch | (149) |
| (400) | World Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (252) | 100 | Zenrin Co Ltd | Bank of America | |
| (1.000) | Xebio Holdings Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 2 |
| | | Merrill Lynch | 132 | 200 | Zenrin Co Ltd | Goldman Sachs | 5 |
| (1.000) | Xebio Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 132 | 900 | Zensho Holdings Co Ltd | Bank of America | |
| 300 | Yakult Honsha Co Ltd | Goldman Sachs | 280 | | | Merrill Lynch | (140) |
| 100 | YAMABIKO Corp | Bank of America | | 100 | Zensho Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (16) |
| | | Merrill Lynch | (19) | 500 | Zensho Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (66) |
| 100 | YAMABIKO Corp | Goldman Sachs | (6) | (500) | Zeon Corp | Bank of America | |
| 28.400 | Yamada Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (1.764) | | | Merrill Lynch | 50 |
| 1.700 | Yamaguchi Financial Group Inc | Bank of America | | (900) | Zeon Corp | Goldman Sachs | 91 |
| | | Merrill Lynch | 290 | (2.000) | Zeon Corp | Morgan Stanley | (357) |
| 3.400 | Yamaguchi Financial Group Inc | Goldman Sachs | 581 | 100 | ZERIA Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | (9) |
| 4.500 | Yamaguchi Financial Group Inc | Morgan Stanley | 664 | 900 | Zojirushi Corp | Bank of America | |
| 1.100 | Yamaha Corp | Morgan Stanley | 769 | | | Merrill Lynch | — |
| 700 | YA-MAN Ltd | Bank of America | | 400 | Zojirushi Corp | Goldman Sachs | — |
| | | Merrill Lynch | 250 | 100 | ZOZO Inc | Bank of America | |
| 700 | YA-MAN Ltd | Goldman Sachs | 250 | | | Merrill Lynch | 36 |
| (2.100) | Yamato Holdings Co Ltd | Bank of America | | 800 | ZOZO Inc | Goldman Sachs | 286 |
| | | Merrill Lynch | 3.425 | 800 | ZOZO Inc | Morgan Stanley | 460 |
| (2.000) | Yamato Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 1.413 | 2.600 | Zuken Inc | Goldman Sachs | 1.131 |
| (1.100) | Yamato Kogyo Co Ltd | Morgan Stanley | (1.025) | | | | (64.623) |
| 300 | Yamazen Corp | Bank of America | | Niederlande | | | |
| | | Merrill Lynch | 86 | (171) | Aalberts NV | Bank of America | |
| 400 | Yamazen Corp | Goldman Sachs | 90 | | | Merrill Lynch | (377) |
| 400 | Yaoko Co Ltd | Bank of America | | 219 | ABN AMRO Bank NV - CVA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.274) | | | Merrill Lynch | (189) |
| 400 | Yaoko Co Ltd | Goldman Sachs | (1.274) | 2.363 | ABN AMRO Bank NV - CVA | Morgan Stanley | 392 |
| 500 | Yaoko Co Ltd | Morgan Stanley | (233) | (22) | Adyen NV | Goldman Sachs | 976 |
| (500) | Yaskawa Electric Corp | Bank of America | | (21) | Adyen NV | Morgan Stanley | 792 |
| | | Merrill Lynch | (990) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|--------------------------------|----------------------------------|-----------------|---|
| Niederlande Fortsetzung | | | | Niederlande Fortsetzung | | | |
| (4.455) | Aegon NV | Goldman Sachs | (520) | 2.006 | Koninklijke BAM Groep NV | Bank of America | |
| (3.108) | Aegon NV | Morgan Stanley | (60) | | | Merrill Lynch | 278 |
| (285) | Akzo Nobel NV | Goldman Sachs | (195) | 1.177 | Koninklijke BAM Groep NV | Goldman Sachs | 162 |
| (231) | Akzo Nobel NV | Morgan Stanley | (49) | 116 | Koninklijke DSM NV | Goldman Sachs | 2.251 |
| (266) | Alfen Beheer BV | Bank of America | | 22 | Koninklijke DSM NV | Morgan Stanley | 414 |
| | | Merrill Lynch | (2.790) | 1.283 | Koninklijke KPN NV | Bank of America | |
| 86 | AMG Advanced Metallurgical Group NV | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 3 |
| | | Merrill Lynch | 381 | 19.239 | Koninklijke KPN NV | Goldman Sachs | 783 |
| 299 | AMG Advanced Metallurgical Group NV | Goldman Sachs | 1.326 | 43.164 | Koninklijke KPN NV | Morgan Stanley | (356) |
| 90 | Arcadis NV | Bank of America | | (511) | Koninklijke Philips NV | Goldman Sachs | (189) |
| | | Merrill Lynch | (2) | (217) | Koninklijke Philips NV | Morgan Stanley | (98) |
| 279 | Arcadis NV | Goldman Sachs | (6) | 1.129 | Koninklijke Vopak NV | Bank of America | |
| (45) | ASM International NV | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.779 |
| | | Merrill Lynch | (463) | 384 | Koninklijke Vopak NV | Morgan Stanley | 601 |
| (166) | ASM International NV | Goldman Sachs | (800) | 2.107 | Majorel Group Luxembourg SA | Goldman Sachs | (2.934) |
| (251) | ASM International NV | Morgan Stanley | (2.149) | (64) | NN Group NV | Goldman Sachs | 44 |
| (34) | ASML Holding NV | Goldman Sachs | (1.002) | (1.234) | NN Group NV | Morgan Stanley | 212 |
| (24) | ASML Holding NV | Morgan Stanley | (491) | (223) | NSI NV (REIT) | Bank of America | |
| 481 | ASR Nederland NV | Goldman Sachs | (649) | | | Merrill Lynch | (263) |
| 361 | ASR Nederland NV | Morgan Stanley | (951) | 348 | OCI NV | Bank of America | |
| 271 | Basic-Fit NV | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (2.021) |
| | | Merrill Lynch | 377 | 1.395 | OCI NV | Goldman Sachs | (6.283) |
| 613 | Basic-Fit NV | Goldman Sachs | 854 | 950 | OCI NV | Morgan Stanley | (3.751) |
| (810) | BE Semiconductor Industries NV | Bank of America | | (7.095) | Pharming Group NV | Goldman Sachs | (186) |
| | | Merrill Lynch | (3.332) | 180 | PostNL NV | Bank of America | |
| (80) | BE Semiconductor Industries NV | Goldman Sachs | (358) | | | Merrill Lynch | 73 |
| 43 | Brunel International NV | Bank of America | | 10.316 | PostNL NV | Goldman Sachs | 4.199 |
| | | Merrill Lynch | 7 | 2.537 | PostNL NV | Morgan Stanley | 52 |
| (16) | CM.com NV | Bank of America | | (231) | Prosus NV | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (19) | (1.342) | Prosus NV | Morgan Stanley | (1.095) |
| (264) | Corbion NV | Bank of America | | 521 | Randstad NV | Morgan Stanley | (5.046) |
| | | Merrill Lynch | 79 | (2.273) | SBM Offshore NV | Bank of America | 748 |
| (194) | Corbion NV | Goldman Sachs | 9 | | | Merrill Lynch | (1.960) |
| 526 | CTP BV | Bank of America | | (1.145) | SBM Offshore NV | Morgan Stanley | (521) |
| | | Merrill Lynch | 192 | (61) | SIF Holding NV | Bank of America | |
| 331 | CTP BV | Morgan Stanley | (50) | (1.684) | SIF Holding NV | Merrill Lynch | (37) |
| (311) | Eurocommercial Properties NV (REIT) | Bank of America | | 174 | Signify NV | Goldman Sachs | (1.028) |
| | | Merrill Lynch | (613) | (88) | TKH Group NV | Goldman Sachs | 211 |
| (172) | Eurocommercial Properties NV (REIT) | Goldman Sachs | (339) | (292) | TKH Group NV | Bank of America | |
| 68 | Flow Traders | Bank of America | | 139 | TomTom NV | Merrill Lynch | (232) |
| | | Merrill Lynch | (7) | | | Goldman Sachs | (794) |
| 252 | Flow Traders | Goldman Sachs | (27) | 83 | TomTom NV | Bank of America | |
| (147) | ForFarmers NV | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 12 |
| | | Merrill Lynch | (39) | (130) | Unibail-Rodamco-Westfield (REIT) | Goldman Sachs | 29 |
| (280) | Galapagos NV | Bank of America | | | | Morgan Stanley | 334 |
| | | Merrill Lynch | 237 | 282 | Unilever Plc | Goldman Sachs | 133 |
| (246) | Galapagos NV | Goldman Sachs | 1.065 | (580) | Van Lanschot Kempen NV | Bank of America | |
| (301) | Galapagos NV | Morgan Stanley | 32 | | | Merrill Lynch | 1.082 |
| (53) | Heineken Holding NV | Goldman Sachs | (124) | 207 | Wereldhave NV (REIT) | Bank of America | |
| (472) | Heineken Holding NV | Morgan Stanley | (2.037) | | | Merrill Lynch | 135 |
| 116 | Heineken NV | Bank of America | | 352 | Wereldhave NV (REIT) | Goldman Sachs | 230 |
| | | Merrill Lynch | 16 | 411 | Wolters Kluwer NV | Bank of America | |
| 317 | Heineken NV | Morgan Stanley | 1.093 | | | Merrill Lynch | (863) |
| 371 | IMCD NV | Goldman Sachs | 1.888 | 1.069 | Wolters Kluwer NV | Morgan Stanley | (1.397) |
| 121 | IMCD NV | Morgan Stanley | 298 | | | | (21.975) |
| 4.272 | ING Groep NV | Bank of America | | Neuseeland | | | |
| | | Merrill Lynch | 5.638 | 2.628 | a2 Milk Co Ltd | Bank of America | |
| 396 | ING Groep NV | Goldman Sachs | 523 | | | Merrill Lynch | 1.094 |
| 3.804 | ING Groep NV | Morgan Stanley | 2.946 | 4.351 | a2 Milk Co Ltd | Goldman Sachs | 1.812 |
| (6.997) | InPost SA | Bank of America | | 4.916 | Air New Zealand Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (6.686) | | | Merrill Lynch | (176) |
| (1.092) | InPost SA | Morgan Stanley | 342 | 5.317 | Air New Zealand Ltd | Goldman Sachs | (190) |
| 505 | JDE Peet's NV | Morgan Stanley | (255) | 4.643 | Air New Zealand Ltd | Morgan Stanley | (76) |
| (1.218) | Just Eat Takeaway.com NV | Bank of America | | (346) | Chorus Ltd | Goldman Sachs | 17 |
| | | Merrill Lynch | (822) | 9.398 | Contact Energy Ltd | Morgan Stanley | (2.079) |
| (212) | Just Eat Takeaway.com NV | Goldman Sachs | (43) | (131) | EBOS Group Ltd | Morgan Stanley | (84) |
| (362) | Just Eat Takeaway.com NV | Morgan Stanley | (705) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|---|-----------------------------|---------------------------------|-------------------------------|---|
| Neuseeland Fortsetzung | | | | Norwegen Fortsetzung | | | |
| 653 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (21) | 1.807 | Elkem ASA | Goldman Sachs | 529 |
| 1.106 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | Goldman Sachs | (36) | (1.311) | Elmera Group ASA | Bank of America Merrill Lynch | (149) |
| 270 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | Morgan Stanley | 33 | (799) | Elmera Group ASA | Goldman Sachs | (130) |
| (10.811) | Fletcher Building Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 4.151 | (42) | Entra ASA | Bank of America Merrill Lynch | 7 |
| (5.697) | Fletcher Building Ltd | Goldman Sachs | 2.187 | 2.821 | Equinor ASA | Morgan Stanley | 7.680 |
| (3.905) | Fletcher Building Ltd | Morgan Stanley | 712 | (199) | Europris ASA | Goldman Sachs | 52 |
| 8.606 | Infratil Ltd | Goldman Sachs | (112) | 69 | FLEX LNG Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (120) |
| 6.516 | Infratil Ltd | Morgan Stanley | (1.951) | 197 | FLEX LNG Ltd | Goldman Sachs | (343) |
| (144) | Mainfreight Ltd | Goldman Sachs | (306) | (1.072) | Gjensidige Forsikring ASA | Bank of America Merrill Lynch | (432) |
| (361) | Mainfreight Ltd | Morgan Stanley | 233 | (461) | Gjensidige Forsikring ASA | Morgan Stanley | (29) |
| (2.991) | Mercury NZ Ltd | Morgan Stanley | 642 | 324 | Golden Ocean Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (417) |
| (12.110) | Meridian Energy Ltd | Morgan Stanley | (788) | 336 | Golden Ocean Group Ltd | Goldman Sachs | (240) |
| (2.848) | Pushpay Holdings Ltd | Goldman Sachs | (181) | 522 | Golden Ocean Group Ltd | Morgan Stanley | (485) |
| (3.152) | Ryman Healthcare Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.749) | 115 | Grieg Seafood ASA | Bank of America Merrill Lynch | 79 |
| (1.262) | Spark New Zealand Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (41) | 741 | Hafnia Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 145 |
| (7.537) | Spark New Zealand Ltd | Morgan Stanley | (736) | (503) | Hexagon Composites ASA | Bank of America Merrill Lynch | (72) |
| 1.303 | Summerset Group Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 42 | (391) | Hexagon Composites ASA | Goldman Sachs | (56) |
| (6.127) | Synlait Milk Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (797) | (3.817) | Hexagon Purus ASA | Bank of America Merrill Lynch | (105) |
| | | | 600 | (544) | Hexagon Purus ASA | Goldman Sachs | (15) |
| | | | | (2.259) | Kahoot! ASA | Bank of America Merrill Lynch | (777) |
| | | | | (1.226) | Kahoot! ASA | Goldman Sachs | (449) |
| Norwegen | | | | 1.203 | Kongsberg Gruppen ASA | Goldman Sachs | (77) |
| 1.241 | Adevinta ASA | Bank of America Merrill Lynch | 1.620 | (833) | Leroy Seafood Group ASA | Bank of America Merrill Lynch | 44 |
| 1.356 | Adevinta ASA | Goldman Sachs | 1.770 | (382) | LINK Mobility Group Holding ASA | Goldman Sachs | (31) |
| 356 | Adevinta ASA | Morgan Stanley | 476 | (733) | Mowi ASA | Bank of America Merrill Lynch | (467) |
| 34 | Aker ASA 'A' | Goldman Sachs | 253 | (702) | Mowi ASA | Morgan Stanley | (60) |
| 40 | Aker ASA 'A' | Morgan Stanley | 227 | (326) | MPC Container Ships AS | Bank of America Merrill Lynch | 10 |
| 240 | Aker BP ASA | Bank of America Merrill Lynch | 1.139 | (2.068) | MPC Container Ships AS | Goldman Sachs | 233 |
| 452 | Aker BP ASA | Goldman Sachs | 2.145 | 2.825 | NEL ASA | Bank of America Merrill Lynch | 478 |
| 102 | Aker BP ASA | Morgan Stanley | 289 | (1.413) | Nordic Semiconductor ASA | Bank of America Merrill Lynch | (1.691) |
| (3.155) | Aker Carbon Capture ASA | Bank of America Merrill Lynch | (784) | (147) | Nordic Semiconductor ASA | Morgan Stanley | (179) |
| (698) | Aker Carbon Capture ASA | Goldman Sachs | (173) | (948) | Norsk Hydro ASA | Bank of America Merrill Lynch | (217) |
| (6.485) | Aker Solutions ASA | Bank of America Merrill Lynch | (3.483) | (25) | Norway Royal Salmon ASA | Goldman Sachs | (65) |
| (4.786) | Aker Solutions ASA | Goldman Sachs | (2.509) | (257) | Nykode Therapeutics AS | Goldman Sachs | (129) |
| (702) | Atlantic Sapphire ASA | Bank of America Merrill Lynch | (530) | (802) | Orkla ASA | Morgan Stanley | (34) |
| (1.353) | Atlantic Sapphire ASA | Goldman Sachs | (1.022) | (1.298) | Pexip Holding ASA | Bank of America Merrill Lynch | (69) |
| (33) | Austevoll Seafood ASA | Bank of America Merrill Lynch | 7 | (168) | Pexip Holding ASA | Goldman Sachs | (9) |
| (65) | Austevoll Seafood ASA | Goldman Sachs | 21 | (4.639) | Quantafuel ASA | Bank of America Merrill Lynch | (1.984) |
| 21.821 | AutoStore Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 7.446 | (118) | Salmar ASA | Bank of America Merrill Lynch | (175) |
| 18 | Bakkafrost P | Bank of America Merrill Lynch | 50 | 1.927 | Scatec ASA | Bank of America Merrill Lynch | 577 |
| (410) | Bonheur ASA | Bank of America Merrill Lynch | (696) | 1.422 | Scatec ASA | Goldman Sachs | 291 |
| (116) | Bonheur ASA | Goldman Sachs | (197) | (1.252) | Schibsted ASA 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.839) |
| 402 | Borregaard ASA | Bank of America Merrill Lynch | (26) | (154) | Schibsted ASA 'A' | Morgan Stanley | (263) |
| 1.759 | Borregaard ASA | Goldman Sachs | (112) | 629 | Schibsted ASA 'B' | Goldman Sachs | 94 |
| (1.508) | BW Energy Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (64) | 195 | Schibsted ASA 'B' | Morgan Stanley | 248 |
| (258) | BW Energy Ltd | Goldman Sachs | (11) | 1.307 | Selvaag Bolig ASA | Goldman Sachs | 14 |
| (159) | Crayon Group Holding ASA | Bank of America Merrill Lynch | (235) | 47 | SpareBank 1 Nord Norge | Bank of America Merrill Lynch | (7) |
| (143) | Crayon Group Holding ASA | Goldman Sachs | (211) | | | | |
| (915) | DNB Bank ASA | Morgan Stanley | 353 | | | | |
| (1.289) | DNO ASA | Goldman Sachs | (365) | | | | |
| 1.385 | Elkem ASA | Bank of America Merrill Lynch | 406 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|----------------------------------|-------------------------------|---|-----------------------------|---|-------------------------------|---|
| Norwegen Fortsetzung | | | | Portugal Fortsetzung | | | |
| (36) | Sparebank 1 Oestlandet | Bank of America Merrill Lynch | 8 | (3.451) | NOS SGPS SA | Goldman Sachs | (337) |
| 194 | SpareBank 1 SMN | Bank of America Merrill Lynch | (5) | (1.758) | REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA | Bank of America Merrill Lynch | 57 |
| (1.587) | SpareBank 1 SR-Bank ASA | Goldman Sachs | (253) | (16.026) | REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA | Goldman Sachs | 515 |
| (7.796) | Storebrand ASA | Bank of America Merrill Lynch | (839) | (719) | Sonae SGPS SA | Bank of America Merrill Lynch | (6) |
| (4.660) | Storebrand ASA | Morgan Stanley | (10) | (458) | Sonae SGPS SA | Goldman Sachs | (52) |
| 541 | Subsea 7 SA | Bank of America Merrill Lynch | 320 | | | | (12.316) |
| 767 | Subsea 7 SA | Goldman Sachs | 454 | Singapur | | | |
| 414 | Telenor ASA | Bank of America Merrill Lynch | 83 | 5.600 | AIMS APAC (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 82 |
| 283 | Telenor ASA | Goldman Sachs | 63 | 3.200 | AIMS APAC (REIT) | Goldman Sachs | 47 |
| 4.348 | Telenor ASA | Morgan Stanley | 946 | (21.500) | Ascendas (REIT) | Goldman Sachs | 1.255 |
| 29 | TGS ASA | Bank of America Merrill Lynch | 16 | (4.900) | Ascendas (REIT) | Morgan Stanley | (214) |
| (1.258) | TOMRA Systems ASA | Bank of America Merrill Lynch | (1.386) | 2.900 | Ascendas India Trust (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | — |
| (2.500) | TOMRA Systems ASA | Morgan Stanley | (3.418) | 4.000 | Ascendas India Trust (Unit) | Goldman Sachs | — |
| (13.161) | Var Energi ASA | Bank of America Merrill Lynch | (7.139) | (21.700) | Ascott Residence Trust (Unit) | Goldman Sachs | (475) |
| (1.458) | Var Energi ASA | Goldman Sachs | (904) | (10.317) | Capitaland Integrated Commercial Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 602 |
| (573) | Veidekke ASA | Goldman Sachs | 37 | (13.378) | Capitaland Integrated Commercial Trust (REIT) | Goldman Sachs | 781 |
| (84) | Wallenius Wilhelmsen ASA | Bank of America Merrill Lynch | (26) | (23.334) | Capitaland Integrated Commercial Trust (REIT) | Morgan Stanley | 851 |
| (537) | XXL ASA | Goldman Sachs | (36) | (6.300) | Capitaland Investment Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (515) |
| 230 | Yara International ASA | Bank of America Merrill Lynch | 161 | (9.500) | Capitaland Investment Ltd | Goldman Sachs | (738) |
| 232 | Yara International ASA | Goldman Sachs | (61) | (5.500) | Capitaland Investment Ltd | Morgan Stanley | (321) |
| 349 | Yara International ASA | Morgan Stanley | 206 | (144) | CDL Hospitality Trusts (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | 4 |
| | | | (6.633) | (900) | City Developments Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (66) |
| Portugal | | | | (2.100) | City Developments Ltd | Goldman Sachs | (153) |
| 1.441 | Altri SGPS SA | Bank of America Merrill Lynch | 523 | (800) | City Developments Ltd | Morgan Stanley | (99) |
| 1.756 | Altri SGPS SA | Goldman Sachs | (240) | 5.400 | ComfortDelGro Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (118) |
| (69.897) | Banco Comercial Portugues SA 'R' | Goldman Sachs | (2.965) | 2.900 | ComfortDelGro Corp Ltd | Goldman Sachs | (63) |
| (74.858) | Banco Comercial Portugues SA 'R' | Morgan Stanley | (1.075) | 10.800 | ComfortDelGro Corp Ltd | Morgan Stanley | (236) |
| (71) | Corticeira Amorim SGPS SA | Goldman Sachs | (32) | (2.200) | DBS Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | 160 |
| (548) | CTT-Correios de Portugal SA | Bank of America Merrill Lynch | (9) | 8.100 | DFI Retail Group Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (405) |
| (181) | CTT-Correios de Portugal SA | Goldman Sachs | (3) | 5.100 | DFI Retail Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | (255) |
| 13.515 | EDP - Energias de Portugal SA | Bank of America Merrill Lynch | 3.692 | 7.600 | DFI Retail Group Holdings Ltd | Morgan Stanley | (380) |
| 3.995 | EDP - Energias de Portugal SA | Goldman Sachs | 1.091 | 9.500 | Far East Hospitality Trust (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | (104) |
| 39.781 | EDP - Energias de Portugal SA | Morgan Stanley | 298 | 5.100 | Far East Hospitality Trust (Unit) | Goldman Sachs | (56) |
| (310) | EDP Renovaveis SA | Bank of America Merrill Lynch | (804) | 2.400 | First Resources Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (280) |
| (101) | EDP Renovaveis SA | Goldman Sachs | (262) | 6.100 | First Resources Ltd | Goldman Sachs | (712) |
| (611) | EDP Renovaveis SA | Morgan Stanley | (406) | (2.000) | Frasers Logistics & Commercial Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (15) |
| (907) | Galp Energia SGPS SA | Bank of America Merrill Lynch | (2.021) | (30.600) | Frasers Logistics & Commercial Trust (REIT) | Morgan Stanley | (446) |
| (1.052) | Galp Energia SGPS SA | Goldman Sachs | (2.104) | 2.400 | Frencken Group Ltd | Goldman Sachs | (263) |
| (7.652) | Galp Energia SGPS SA | Morgan Stanley | (10.081) | (15.700) | Genting Singapore Ltd | Goldman Sachs | — |
| 17 | Greenvolt-Energias Renovaveis SA | Bank of America Merrill Lynch | 133 | (4.800) | Genting Singapore Ltd | Morgan Stanley | 35 |
| 132 | Greenvolt-Energias Renovaveis SA | Goldman Sachs | 1.034 | (167.300) | Golden Agri-Resources Ltd | Morgan Stanley | (610) |
| (1.176) | Jeronimo Martins SGPS SA | Morgan Stanley | (408) | (13.300) | Hongkong Land Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 266 |
| 6.550 | Navigator Co SA | Bank of America Merrill Lynch | 1.109 | (1.800) | Hongkong Land Holdings Ltd | Goldman Sachs | 36 |
| 4.215 | Navigator Co SA | Goldman Sachs | 713 | (1.700) | Hongkong Land Holdings Ltd | Morgan Stanley | 153 |
| (6.888) | NOS SGPS SA | Bank of America Merrill Lynch | (676) | 92.700 | Hutchison Port Holdings Trust (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | 927 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|----------------------------------|---|-----------------------------|--|----------------------------------|---|
| Singapur Fortsetzung | | | | Singapur Fortsetzung | | | |
| 65.300 | Hutchison Port Holdings Trust (Unit) | Goldman Sachs | 653 | (4.500) | UOL Group Ltd | Morgan Stanley | (440) |
| (75.100) | Japfa Ltd | Goldman Sachs | (1.643) | 4.400 | Wilmar International Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 136 |
| 300 | Jardine Cycle & Carriage Ltd | Goldman Sachs | 33 | 3.100 | Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd | Morgan Stanley | 49 |
| (1.101) | Jardine Matheson Holdings Ltd | Goldman Sachs | (2.753) | (33.600) | Yanlord Land Group Ltd | Goldman Sachs | 1.225 |
| 800 | Keppel Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 61 | | | | (8.367) |
| 3.500 | Keppel Corp Ltd | Goldman Sachs | 284 | | Spanien | | |
| (29.300) | Keppel DC (REIT) | Goldman Sachs | 3.633 | 11 | Acciona SA | Goldman Sachs | (28) |
| (2.200) | Keppel DC (REIT) | Morgan Stanley | (177) | 189 | Acciona SA | Morgan Stanley | (1.053) |
| 1.900 | Keppel Infrastructure Trust (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | 14 | (2.378) | Acerinox SA | Bank of America Merrill Lynch | (4.369) |
| 3.700 | Lendlease Global Commercial (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 121 | (80) | Acerinox SA | Goldman Sachs | (147) |
| 21.700 | Mapletree Commercial Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (475) | (1.766) | Acerinox SA | Morgan Stanley | (2.100) |
| 16.100 | Mapletree Commercial Trust (REIT) | Goldman Sachs | (352) | (15) | ACS Actividades de Construccion y Servicios SA | Goldman Sachs | (30) |
| (16.100) | Mapletree Industrial Trust (REIT) | Goldman Sachs | (587) | (2.684) | ACS Actividades de Construccion y Servicios SA | Morgan Stanley | (2.185) |
| (2.500) | Mapletree Logistics Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (18) | 14 | Aena SME SA | Bank of America Merrill Lynch | 86 |
| (17.800) | Mapletree Logistics Trust (REIT) | Goldman Sachs | (130) | 255 | Aena SME SA | Goldman Sachs | 1.858 |
| (27.100) | Mapletree Logistics Trust (REIT) | Morgan Stanley | (593) | 72 | Almirall SA | Goldman Sachs | 14 |
| (3.300) | Mapletree North Asia Commercial Trust (REIT) | Goldman Sachs | (24) | 72 | Almirall SA (Right) | Goldman Sachs | 13 |
| (602) | Maxeon Solar Technologies Ltd | Goldman Sachs | (1.728) | (536) | Amadeus IT Group SA | Bank of America Merrill Lynch | 414 |
| 27.000 | NetLink NBN Trust (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | (197) | (73) | Amadeus IT Group SA | Goldman Sachs | 53 |
| 27.700 | NetLink NBN Trust (Unit) | Goldman Sachs | (202) | (130) | Amadeus IT Group SA | Morgan Stanley | (123) |
| 22.800 | NetLink NBN Trust (Unit) | Morgan Stanley | (416) | (110) | Applus Services SA | Bank of America Merrill Lynch | (7) |
| (34.300) | Olam Group Ltd | Morgan Stanley | (2.001) | (601) | Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA | Bank of America Merrill Lynch | (134) |
| (27.100) | OUE Commercial (REIT) | Goldman Sachs | 198 | (574) | Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA | Goldman Sachs | (71) |
| (10.600) | OUE Ltd | Goldman Sachs | 309 | 923 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | Bank of America Merrill Lynch | 218 |
| 3.800 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | Morgan Stanley | 305 | 8.805 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | Morgan Stanley | 1.820 |
| 15.300 | Sasseur (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 112 | (10.630) | Banco de Sabadell SA | Morgan Stanley | (697) |
| 20.000 | Sasseur (REIT) | Goldman Sachs | 146 | 10.203 | Banco Santander SA | Bank of America Merrill Lynch | 2.999 |
| 1.200 | SATS Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (151) | 737 | Banco Santander SA | Goldman Sachs | 254 |
| 1.400 | SATS Ltd | Goldman Sachs | (170) | 10.270 | Banco Santander SA | Morgan Stanley | 1.659 |
| 5.500 | SATS Ltd | Morgan Stanley | (623) | (739) | Bankinter SA | Bank of America Merrill Lynch | 8 |
| (21.400) | Sembcorp Industries Ltd | Goldman Sachs | (780) | 2.351 | CaixaBank SA | Bank of America Merrill Lynch | 211 |
| 31.700 | Sembcorp Marine Ltd | Morgan Stanley | 370 | 1.328 | Cellnex Telecom SA | Bank of America Merrill Lynch | 4.023 |
| 1.700 | Sheng Siong Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (12) | 173 | Cellnex Telecom SA | Goldman Sachs | 314 |
| 4.000 | Sheng Siong Group Ltd | Goldman Sachs | (29) | (133) | Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA | Bank of America Merrill Lynch | 24 |
| 4.800 | SIA Engineering Co Ltd | Morgan Stanley | (70) | (1.803) | Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA | Goldman Sachs | 328 |
| 3.900 | Singapore Airlines Ltd | Goldman Sachs | 597 | (228) | CIE Automotive SA | Goldman Sachs | (615) |
| (7.000) | Singapore Exchange Ltd | Goldman Sachs | 664 | (673) | Construcciones y Auxiliar de Ferrocarriles SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.370) |
| (100) | Singapore Exchange Ltd | Morgan Stanley | 28 | (197) | Construcciones y Auxiliar de Ferrocarriles SA | Goldman Sachs | (401) |
| 28.200 | Singapore Post Ltd | Goldman Sachs | (720) | (520) | Corp ACCIONA Energias Renovables SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.248) |
| 165.400 | Singapore Post Ltd | Morgan Stanley | (1.206) | (240) | Corp ACCIONA Energias Renovables SA | Morgan Stanley | 195 |
| (2.500) | Singapore Technologies Engineering Ltd | Goldman Sachs | (109) | (115) | Corp Financiera Alba SA | Bank of America Merrill Lynch | (456) |
| (13.400) | Starhill Global (REIT) | Goldman Sachs | — | (39) | Corp Financiera Alba SA | Goldman Sachs | (155) |
| 10.400 | StarHub Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 76 | (128) | Ebro Foods SA | Goldman Sachs | (8) |
| 2.900 | StarHub Ltd | Goldman Sachs | 21 | 126 | eDreams ODIGEO SA | Bank of America Merrill Lynch | 68 |
| 1.300 | United Overseas Bank Ltd | Morgan Stanley | 275 | | | | |
| (2.200) | UOL Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (256) | | | | |
| (2.700) | UOL Group Ltd | Goldman Sachs | (490) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------------------------|---|----------------------------------|---|----------------------------|--|----------------------------------|---|
| Spanien Fortsetzung | | | | Spanien Fortsetzung | | | |
| (823) | Enagas SA | Morgan Stanley | 256 | (7.000) | Repsol SA | Morgan Stanley | (3.862) |
| 5.459 | Ence Energia y Celulosa SA | Bank of America Merrill Lynch | 1.263 | (1.348) | Sacyr SA | Bank of America Merrill Lynch | (199) |
| 2.056 | Ence Energia y Celulosa SA | Goldman Sachs | 476 | (212) | Sacyr SA | Goldman Sachs | (31) |
| (795) | Endesa SA | Bank of America Merrill Lynch | 20 | 758 | Siemens Gamesa Renewable Energy SA | Bank of America Merrill Lynch | 3.691 |
| (154) | Endesa SA | Goldman Sachs | (10) | 145 | Solaria Energia y Medio Ambiente SA | Goldman Sachs | 61 |
| (661) | Faes Farma SA | Bank of America Merrill Lynch | (81) | 726 | Solaria Energia y Medio Ambiente SA | Morgan Stanley | (933) |
| (278) | Faes Farma SA | Goldman Sachs | (34) | (4.113) | Soltec Power Holdings SA | Bank of America Merrill Lynch | (3.542) |
| 1.696 | Ferrovial SA | Bank of America Merrill Lynch | 1.142 | (87) | Tecnicas Reunidas SA | Goldman Sachs | (112) |
| 581 | Ferrovial SA | Goldman Sachs | (4) | (5.738) | Telefonica SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.732) |
| 861 | Ferrovial SA | Morgan Stanley | 414 | (3.346) | Telefonica SA | Morgan Stanley | (703) |
| 2 | Ferrovial SA | Morgan Stanley | (17) | 594 | Unicaja Banco SA | Bank of America Merrill Lynch | 45 |
| (443) | Fluidra SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.006) | (46) | Viscofan SA | Bank of America Merrill Lynch | (2) |
| (1.939) | Fluidra SA | Goldman Sachs | (4.404) | | | | (3.283) |
| (835) | Fluidra SA | Morgan Stanley | (1.735) | Schweden | | | |
| (821) | Gestamp Automocion SA | Bank of America Merrill Lynch | (211) | 295 | AAK AB | Bank of America Merrill Lynch | 108 |
| (1.442) | Global Dominion Access SA | Bank of America Merrill Lynch | (595) | 548 | AAK AB | Goldman Sachs | 201 |
| (23) | Grenergy Renovables SA | Goldman Sachs | (115) | 2.070 | AcadeMedia AB | Bank of America Merrill Lynch | 320 |
| (640) | Grifols SA | Bank of America Merrill Lynch | 92 | 703 | AcadeMedia AB | Goldman Sachs | 109 |
| (284) | Grifols SA | Goldman Sachs | 103 | 958 | AddTech AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 712 |
| 1.850 | Indra Sistemas SA | Bank of America Merrill Lynch | 1.258 | 3.119 | AddTech AB 'B' | Goldman Sachs | 2.318 |
| 1.803 | Indra Sistemas SA | Goldman Sachs | 1.204 | 1.224 | AFRY AB | Bank of America Merrill Lynch | 792 |
| 797 | Industria de Diseno Textil SA | Morgan Stanley | 1.443 | 814 | AFRY AB | Goldman Sachs | 407 |
| 570 | Inmobiliaria Colonial Socimi SA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (24) | 425 | Alfa Laval AB | Morgan Stanley | 528 |
| 3.073 | Inmobiliaria Colonial Socimi SA (REIT) | Goldman Sachs | (132) | 41 | Alimak Group AB | Bank of America Merrill Lynch | (20) |
| 5.350 | Inmobiliaria Colonial Socimi SA (REIT) | Morgan Stanley | (860) | (100) | Ambea AB | Bank of America Merrill Lynch | 11 |
| 112 | Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA | Bank of America Merrill Lynch | 242 | 3.910 | Arjo AB 'B' | Goldman Sachs | 856 |
| 103 | Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA | Goldman Sachs | 232 | (934) | Assa Abloy AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (886) |
| (9.698) | Mapfre SA | Bank of America Merrill Lynch | (10) | (375) | Assa Abloy AB 'B' | Morgan Stanley | (336) |
| (2.445) | Mapfre SA | Morgan Stanley | 160 | (7.923) | Atlas Copco AB 'A' | Morgan Stanley | (634) |
| 393 | Mediaset Espana Comunicacion SA | Goldman Sachs | (7) | (3.483) | Atlas Copco AB 'A' | Morgan Stanley | — |
| 2.891 | Melia Hotels International SA | Bank of America Merrill Lynch | 1.564 | (1.055) | Atlas Copco AB 'B' | Morgan Stanley | (119) |
| 1.132 | Melia Hotels International SA | Goldman Sachs | 612 | (783) | Atlas Copco AB 'B' | Morgan Stanley | (1) |
| 1.609 | Merlin Properties Socimi SA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 534 | 28 | Atrium Ljungberg AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 20 |
| 3.432 | Merlin Properties Socimi SA (REIT) | Goldman Sachs | 1.140 | 438 | Avanza Bank Holding AB | Bank of America Merrill Lynch | 513 |
| 1.549 | Merlin Properties Socimi SA (REIT) | Morgan Stanley | (166) | 659 | Axfood AB | Morgan Stanley | 335 |
| (606) | Metrovacesa SA | Goldman Sachs | 305 | (53) | Bactiguard Holding AB | Goldman Sachs | (58) |
| 138 | Naturgy Energy Group SA | Goldman Sachs | 259 | 27 | Beijer Alma AB | Goldman Sachs | 31 |
| 641 | Naturgy Energy Group SA | Morgan Stanley | 117 | (940) | Beijer Ref AB | Bank of America Merrill Lynch | (487) |
| (46) | Neinor Homes SA | Bank of America Merrill Lynch | (38) | (1.761) | Beijer Ref AB | Morgan Stanley | (681) |
| (15) | Pharma Mar SA | Goldman Sachs | (35) | 2.005 | Betsson AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 284 |
| 477 | Prosegur Cia de Seguridad SA | Bank of America Merrill Lynch | 33 | 921 | Betsson AB 'B' | Goldman Sachs | 130 |
| (1.786) | Red Electrica Corp SA | Bank of America Merrill Lynch | 713 | (4.663) | BHG Group AB | Goldman Sachs | 2.896 |
| (1.245) | Red Electrica Corp SA | Goldman Sachs | 273 | (572) | BICO Group AB | Goldman Sachs | (1.698) |
| (928) | Red Electrica Corp SA | Morgan Stanley | 408 | 52 | Bilia AB 'A' | Goldman Sachs | 3 |
| (185) | Repsol SA | Bank of America Merrill Lynch | (22) | (2.380) | BillerudKorsnas AB | Goldman Sachs | 642 |
| (135) | Repsol SA | Goldman Sachs | (83) | (2.380) | BillerudKorsnas AB (Right) | Goldman Sachs | (2.343) |
| | | | | 348 | Biotage AB | Bank of America Merrill Lynch | 333 |
| | | | | 2.130 | Biotage AB | Goldman Sachs | 2.039 |
| | | | | 300 | Boliden AB | Goldman Sachs | 1.362 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|------------------------------------|-----------------|---|-----------------------------|--------------------------|-----------------|---|
| Schweden Fortsetzung | | | | Schweden Fortsetzung | | | |
| 846 | Boliden AB | Morgan Stanley | 1.981 | (6.852) | Fastighets AB Balder 'B' | Bank of America | |
| 662 | Bonava AB 'B' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.191 |
| | | Merrill Lynch | (132) | (4.094) | Fastighets AB Balder 'B' | Morgan Stanley | 1.315 |
| 513 | Bonava AB 'B' | Goldman Sachs | (102) | 4.393 | Fingerprint Cards AB 'B' | Bank of America | |
| (2.545) | Boozt AB | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 4 |
| | | Merrill Lynch | (285) | 657 | Fortnox AB | Bank of America | |
| (515) | Boozt AB | Goldman Sachs | (58) | | | Merrill Lynch | 388 |
| 186 | Bravida Holding AB | Bank of America | | 239 | Fortnox AB | Goldman Sachs | 141 |
| | | Merrill Lynch | 85 | 20 | GARO AB | Goldman Sachs | 25 |
| 758 | Bravida Holding AB | Goldman Sachs | 347 | (846) | Getinge AB 'B' | Bank of America | |
| 28 | Bufab AB | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 250 |
| | | Merrill Lynch | 68 | (877) | Getinge AB 'B' | Morgan Stanley | (464) |
| 118 | Bufab AB | Goldman Sachs | 288 | (1.017) | Granges AB | Bank of America | |
| (41) | Bure Equity AB | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (694) |
| | | Merrill Lynch | (126) | (1.413) | Granges AB | Goldman Sachs | (964) |
| (1.310) | Calliditas Therapeutics AB 'B' | Goldman Sachs | (1.947) | (303) | Hansa Biopharma AB | Bank of America | |
| (782) | Camurus AB | Goldman Sachs | (1.712) | | | Merrill Lynch | (119) |
| (234) | Castellum AB | Bank of America | | (2.859) | Hansa Biopharma AB | Goldman Sachs | (1.121) |
| | | Merrill Lynch | 62 | (29) | Hemnet Group AB | Goldman Sachs | (55) |
| 11 | Catena AB | Goldman Sachs | (4) | 1.307 | Hennes & Mauritz AB 'B' | Goldman Sachs | 438 |
| (29) | Cibus Nordic Real Estate AB | Goldman Sachs | (12) | 3.894 | Hexagon AB 'B' | Bank of America | |
| (745) | Cint Group AB | Morgan Stanley | 319 | | | Merrill Lynch | 2.042 |
| (2.650) | Clas Ohlson AB 'B' | Goldman Sachs | 324 | 2.085 | Hexagon AB 'B' | Goldman Sachs | 1.093 |
| 4.085 | Cloetta AB 'B' | Bank of America | | 3.529 | Hexagon AB 'B' | Morgan Stanley | 952 |
| | | Merrill Lynch | (433) | 257 | Hexatronic Group AB | Bank of America | |
| 3.083 | Cloetta AB 'B' | Goldman Sachs | (326) | | | Merrill Lynch | 2.122 |
| 299 | Collector AB | Goldman Sachs | 32 | 234 | Hexatronic Group AB | Goldman Sachs | 1.932 |
| (63) | Coor Service Management Holding AB | Bank of America | | (917) | Hexpol AB | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (11) | | | Merrill Lynch | (636) |
| 996 | Corem Property Group AB 'B' | Bank of America | | (1.025) | Hexpol AB | Goldman Sachs | (711) |
| | | Merrill Lynch | 39 | 100 | HMS Networks AB | Bank of America | |
| 232 | Corem Property Group AB 'B' | Goldman Sachs | 9 | 201 | HMS Networks AB | Merrill Lynch | 356 |
| (29) | Creades AB 'A' | Goldman Sachs | (31) | 348 | Holmen AB 'B' | Goldman Sachs | 716 |
| (4.647) | Desenio Group AB | Bank of America | | 1.457 | Holmen AB 'B' | Goldman Sachs | (928) |
| | | Merrill Lynch | 217 | 267 | Hufvudstaden AB 'A' | Morgan Stanley | (2.403) |
| (356) | Desenio Group AB | Goldman Sachs | 17 | | | Bank of America | |
| 596 | Dios Fastigheter AB | Bank of America | | 61 | Hufvudstaden AB 'A' | Merrill Lynch | 310 |
| | | Merrill Lynch | 343 | (3.759) | Husqvarna AB 'B' | Goldman Sachs | 71 |
| 412 | Dios Fastigheter AB | Goldman Sachs | 237 | | | Bank of America | |
| 444 | Dometic Group AB | Bank of America | | (3.658) | Husqvarna AB 'B' | Merrill Lynch | (145) |
| | | Merrill Lynch | (77) | (693) | Implantica AG SDR 'A' | Morgan Stanley | (559) |
| 156 | Dometic Group AB | Goldman Sachs | (27) | 94 | Industrivarden AB 'A' | Goldman Sachs | (310) |
| (2) | Duni AB | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1) | 465 | Industrivarden AB 'A' | Merrill Lynch | 46 |
| (908) | Duni AB | Goldman Sachs | (240) | 103 | Industrivarden AB 'A' | Goldman Sachs | 303 |
| (303) | Dustin Group AB | Goldman Sachs | (185) | 210 | Industrivarden AB 'C' | Morgan Stanley | 56 |
| 450 | Electrolux AB 'B' | Goldman Sachs | 442 | | | Bank of America | |
| (77) | Electrolux Professional AB 'B' | Bank of America | | 92 | Industrivarden AB 'C' | Merrill Lynch | 254 |
| | | Merrill Lynch | (33) | 101 | Industrivarden AB 'C' | Goldman Sachs | 43 |
| 2.586 | Elekta AB 'B' | Morgan Stanley | 2.070 | 712 | Indutrade AB | Morgan Stanley | 60 |
| (9.626) | Embracer Group AB | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (15.888) | 1.849 | Indutrade AB | Merrill Lynch | 391 |
| 11.818 | Embracer Group AB | Goldman Sachs | 19.506 | 526 | Indutrade AB | Goldman Sachs | 1.017 |
| (6.646) | Embracer Group AB | Morgan Stanley | (4.168) | (226) | Instalco AB | Morgan Stanley | 107 |
| 365 | Epiroc AB 'A' | Morgan Stanley | 59 | | | Bank of America | |
| 666 | Epiroc AB 'B' | Bank of America | | (289) | Intrum AB | Merrill Lynch | (58) |
| | | Merrill Lynch | 227 | | | Bank of America | |
| 1.253 | Epiroc AB 'B' | Goldman Sachs | 734 | (413) | Intrum AB | Merrill Lynch | 3 |
| 1.326 | Epiroc AB 'B' | Morgan Stanley | (58) | 1.140 | Investment AB Latour 'B' | Goldman Sachs | 4 |
| (439) | EQT AB | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (836) | 134 | Investment AB Latour 'B' | Merrill Lynch | 1.834 |
| 1.618 | Essity AB 'B' | Morgan Stanley | 132 | 247 | Investment AB Latour 'B' | Goldman Sachs | 216 |
| (326) | Evolution AB | Bank of America | | (733) | Investor AB 'A' | Morgan Stanley | 397 |
| | | Merrill Lynch | (1.224) | | | Bank of America | |
| (362) | Evolution AB | Morgan Stanley | (1.738) | (4.253) | Investor AB 'A' | Merrill Lynch | (1.086) |
| 1.349 | Fabege AB | Bank of America | | 30 | INVISIO AB | Morgan Stanley | (3.724) |
| | | Merrill Lynch | 817 | | | Bank of America | |
| 740 | Fabege AB | Goldman Sachs | 448 | 27 | INVISIO AB | Merrill Lynch | (4) |
| (94) | Fagerhult AB | Goldman Sachs | (67) | | | Goldman Sachs | (3) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|-------------------------------|---|-----------------------------|---|-------------------------------|---|
| Schweden Fortsetzung | | | | Schweden Fortsetzung | | | |
| (468) | Inwido AB | Bank of America Merrill Lynch | (362) | (1.879) | Paradox Interactive AB | Goldman Sachs | (832) |
| (354) | Inwido AB | Goldman Sachs | (191) | 860 | Peab AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 96 |
| 341 | JM AB | Bank of America Merrill Lynch | 156 | 1.528 | Peab AB 'B' | Goldman Sachs | 214 |
| 826 | JM AB | Goldman Sachs | 342 | 56 | Platzer Fastigheter Holding AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 12 |
| (30) | Kambi Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (152) | (1.573) | PowerCell Sweden AB | Goldman Sachs | (3.003) |
| (2.330) | Karo Pharma AB | Goldman Sachs | 1.177 | (444) | Ratos AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (327) |
| (5.025) | Kindred Group Plc SDR | Bank of America Merrill Lynch | (604) | (95) | Ratos AB 'B' | Goldman Sachs | (70) |
| (1.336) | Kindred Group Plc SDR | Goldman Sachs | (161) | (38) | Re:NewCell AB | Bank of America Merrill Lynch | (62) |
| 171 | Kinnevik AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 426 | (1.044) | Re:NewCell AB | Goldman Sachs | (1.711) |
| 776 | Kinnevik AB 'B' | Goldman Sachs | 1.656 | (219) | Resurs Holding AB | Bank of America Merrill Lynch | 10 |
| (14) | KNOW IT AB | Bank of America Merrill Lynch | (17) | 479 | Saab AB 'B' | Morgan Stanley | 146 |
| (246) | L E Lundbergforetagen AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (624) | (144) | Sagax AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 139 |
| (553) | L E Lundbergforetagen AB 'B' | Morgan Stanley | (1.301) | (701) | Sagax AB 'B' | Morgan Stanley | 178 |
| 481 | Lifco AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 972 | (4.532) | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB | Morgan Stanley | 355 |
| 829 | Lifco AB 'B' | Goldman Sachs | 1.676 | (3.075) | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'D' | Bank of America Merrill Lynch | (79) |
| 874 | Lifco AB 'B' | Morgan Stanley | 1.304 | (2.583) | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'D' | Goldman Sachs | (59) |
| 104 | Lindab International AB | Bank of America Merrill Lynch | 28 | (635) | Sandvik AB | Morgan Stanley | (598) |
| 25 | Lindab International AB | Goldman Sachs | 7 | 9.751 | SAS AB | Bank of America Merrill Lynch | (148) |
| 139 | Loomis AB | Bank of America Merrill Lynch | 125 | 17.008 | SAS AB | Goldman Sachs | (250) |
| 203 | Loomis AB | Goldman Sachs | 182 | 167 | Scandic Hotels Group AB | Bank of America Merrill Lynch | 19 |
| 1.156 | Lundin Energy AB | Morgan Stanley | 3.802 | 6.800 | Scandic Hotels Group AB | Goldman Sachs | 769 |
| (79) | Mekonomen AB | Bank of America Merrill Lynch | 23 | 39 | Sectra AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 67 |
| 1.288 | Millicom International Cellular SA (Right) | Bank of America Merrill Lynch | 5.151 | (3.004) | Securitas AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (21) |
| 1.116 | Millicom International Cellular SA (Right) | Goldman Sachs | 4.463 | (6.241) | Securitas AB 'B' | Morgan Stanley | (1.430) |
| 1.288 | Millicom International Cellular SA SDR | Bank of America Merrill Lynch | (8.164) | 146 | Sedana Medical AB | Goldman Sachs | 68 |
| 1.116 | Millicom International Cellular SA SDR | Goldman Sachs | (7.074) | (1.757) | Sinch AB | Bank of America Merrill Lynch | (343) |
| (81) | MIPS AB | Bank of America Merrill Lynch | (267) | (7.196) | Sinch AB | Morgan Stanley | (1.098) |
| (8) | MIPS AB | Goldman Sachs | (34) | (6.114) | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 522 |
| (71) | Modern Times Group MTG AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (27) | (6.091) | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | Morgan Stanley | 750 |
| (722) | Munters Group AB | Bank of America Merrill Lynch | (250) | 230 | Skanska AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 13 |
| (297) | Munters Group AB | Goldman Sachs | (103) | 2.893 | Skanska AB 'B' | Goldman Sachs | 873 |
| (64) | Mycronic AB | Bank of America Merrill Lynch | (96) | 746 | Skanska AB 'B' | Morgan Stanley | 243 |
| (133) | Mycronic AB | Goldman Sachs | (200) | (1.549) | SKF AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (323) |
| 195 | NCC AB 'B' | Goldman Sachs | (56) | (3.618) | SKF AB 'B' | Morgan Stanley | (1.381) |
| (332) | New Wave Group AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 108 | (42) | SkiStar AB | Goldman Sachs | 43 |
| (526) | New Wave Group AB 'B' | Goldman Sachs | 149 | 526 | SSAB AB 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 285 |
| 1.641 | Nibe Industrier AB 'B' | Morgan Stanley | (10) | 4.416 | SSAB AB 'A' | Goldman Sachs | 2.392 |
| 164 | Nobia AB | Goldman Sachs | (18) | 1.468 | SSAB AB 'A' | Morgan Stanley | 565 |
| 660 | Nolato AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 276 | (1.013) | SSAB AB 'B' | Goldman Sachs | (472) |
| 76 | Nolato AB 'B' | Goldman Sachs | 21 | (1.814) | Stillfront Group AB | Goldman Sachs | 21 |
| (520) | Nordea Bank Abp | Morgan Stanley | 5 | 9.468 | Storskogen Group AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (2.796) |
| 1.045 | Nyfos AB | Bank of America Merrill Lynch | 511 | 66 | Storytel AB | Goldman Sachs | 2 |
| 320 | Nyfos AB | Goldman Sachs | 156 | (1.667) | Svenska Cellulosa AB SCA 'B' | Morgan Stanley | 76 |
| (136) | Pandex AB | Bank of America Merrill Lynch | (80) | (1.790) | Svenska Handelsbanken AB 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 509 |
| (85) | Pandex AB | Goldman Sachs | (50) | (148) | Svolder AB 'B' | Goldman Sachs | (85) |
| | | | | (881) | Sweco AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 305 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|----------------------------|--|-----------------|---|
| Schweden Fortsetzung | | | | Schweiz Fortsetzung | | | |
| (1.246) | Sweco AB 'B' | Morgan Stanley | (254) | 23 | Belimo Holding AG Reg | Morgan Stanley | 168 |
| (836) | Swedbank AB 'A' | Bank of America | | (4) | Bell Food Group AG Reg | Goldman Sachs | 48 |
| | | Merrill Lynch | 91 | 79 | BKW AG | Bank of America | |
| (806) | Swedbank AB 'A' | Morgan Stanley | 238 | | | Merrill Lynch | (391) |
| 144 | SwedenCare AB | Bank of America | | 141 | BKW AG | Goldman Sachs | (879) |
| | | Merrill Lynch | 244 | (14) | Bobst Group SA Reg | Bank of America | |
| 112 | SwedenCare AB | Goldman Sachs | 195 | | | Merrill Lynch | 4 |
| (1.194) | Swedish Orphan | | | (44) | Bobst Group SA Reg | Goldman Sachs | 14 |
| | Biovitrum AB | Morgan Stanley | 875 | 48 | Bossard Holding AG 'A' Reg | Bank of America | |
| 2.467 | Tele2 AB 'B' | Morgan Stanley | (2.575) | | | Merrill Lynch | 735 |
| 1.872 | Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | | | 91 | Bossard Holding AG 'A' Reg | Goldman Sachs | 1.394 |
| | | Goldman Sachs | 252 | (2) | Bucher Industries AG Reg | Bank of America | |
| (5.768) | Telia Co AB | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (51) |
| | | Merrill Lynch | 393 | (31) | Bucher Industries AG Reg | Goldman Sachs | (774) |
| (8.102) | Telia Co AB | Morgan Stanley | 437 | 12 | Burckhardt Compression Holding AG | Bank of America | |
| (1.553) | Thule Group AB | Morgan Stanley | (3.178) | | | Merrill Lynch | 184 |
| (183) | Tobii AB | Goldman Sachs | (39) | 9 | Burckhardt Compression Holding AG | | |
| (1.337) | Tobii Dynavox AB | Bank of America | | 9 | Burkhalter Holding AG | Goldman Sachs | 156 |
| | | Merrill Lynch | (213) | 9 | Burkhalter Holding AG | Goldman Sachs | 45 |
| (264) | Trelleborg AB 'B' | Morgan Stanley | (180) | (161) | Cembra Money Bank AG | Bank of America | |
| 69 | Troax Group AB | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 137 |
| | | Merrill Lynch | 151 | (455) | Cembra Money Bank AG | Goldman Sachs | 379 |
| 638 | Troax Group AB | Goldman Sachs | 1.397 | 2 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | Bank of America | |
| (191) | Vestum AB | Goldman Sachs | 59 | | | Merrill Lynch | (521) |
| (91) | Viaplay Group AB | Bank of America | | 1 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | | |
| | | Merrill Lynch | 12 | | | Goldman Sachs | (261) |
| (20) | Viaplay Group AB | Goldman Sachs | 3 | 5 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | | |
| (68) | Vimian Group AB | Bank of America | | | | Morgan Stanley | 677 |
| | | Merrill Lynch | (19) | 1 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG Reg | | |
| (77) | Vimian Group AB | Goldman Sachs | (21) | | | Morgan Stanley | (938) |
| 78 | Vitrolife AB | Bank of America | | 128 | Cie Financiere Richemont SA Reg | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 304 | | | Merrill Lynch | (167) |
| 151 | Vitrolife AB | Morgan Stanley | 618 | 204 | Cie Financiere Richemont SA Reg | | |
| (2.399) | Volvo AB 'A' | Bank of America | | | | Goldman Sachs | (266) |
| | | Merrill Lynch | (2.809) | 306 | Clariant AG Reg | Morgan Stanley | 29 |
| (865) | Volvo AB 'A' | Morgan Stanley | (590) | 215 | Comet Holding AG Reg | Goldman Sachs | 1.837 |
| (1.635) | Volvo AB 'B' | Morgan Stanley | (1.089) | 1 | Conzzeta AG Reg | Goldman Sachs | 4 |
| (616) | Wallenstam AB 'B' | Bank of America | | (109) | COSMO | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 11 | | Pharmaceuticals NV | Merrill Lynch | (204) |
| (406) | Wihlborgs Fastigheter AB | Bank of America | | (183) | COSMO | | |
| | | Merrill Lynch | (128) | | Pharmaceuticals NV | Goldman Sachs | (343) |
| (108) | Wihlborgs Fastigheter AB | Goldman Sachs | (34) | (9.610) | Credit Suisse Group AG Reg | Bank of America | |
| | | | 1.472 | | | Merrill Lynch | (1.425) |
| Schweiz | | | | (2.017) | Credit Suisse Group AG Reg | | (28) |
| (6.832) | ABB Ltd Reg | Morgan Stanley | (4.201) | (7.854) | Credit Suisse Group AG Reg | Goldman Sachs | |
| 335 | Adecco Group AG Reg | Morgan Stanley | 293 | | | | 311 |
| 228 | Alcon Inc | Bank of America | | 35 | Daetwyler Holding AG | Goldman Sachs | (1.879) |
| | | Merrill Lynch | 299 | 231 | DKSH Holding AG | Bank of America | |
| 34 | Alcon Inc | Goldman Sachs | 70 | | | Merrill Lynch | (61) |
| (16) | Allreal Holding AG Reg | Bank of America | | 39 | DKSH Holding AG | Morgan Stanley | (33) |
| | | Merrill Lynch | 68 | (53) | dormakaba Holding AG | Bank of America | |
| (10) | Allreal Holding AG Reg | Goldman Sachs | 44 | | | Merrill Lynch | (1.335) |
| (3) | ALSO Holding AG Reg | Bank of America | | (19) | dormakaba Holding AG | Goldman Sachs | (470) |
| | | Merrill Lynch | 18 | 372 | Dufry AG Reg | Morgan Stanley | 1.051 |
| (654) | ams-OSRAM AG | Morgan Stanley | (245) | (208) | EFG International AG | Bank of America | |
| 4.546 | Aryzta AG | Goldman Sachs | 789 | | | Merrill Lynch | (76) |
| (4) | Autoneum Holding AG | Goldman Sachs | (28) | (95) | EFG International AG | Goldman Sachs | (35) |
| (252) | Bachem Holding AG 'B' Reg | Bank of America | | 4 | Emmi AG Reg | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (486) | | | Merrill Lynch | 73 |
| (80) | Bachem Holding AG 'B' Reg | Morgan Stanley | (334) | 12 | Emmi AG Reg | Morgan Stanley | 187 |
| (144) | Baloise Holding AG Reg | Bank of America | | 4 | EMS-Chemie Holding AG Reg | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 173 | | | Merrill Lynch | 81 |
| (88) | Baloise Holding AG Reg | Goldman Sachs | (70) | 27 | EMS-Chemie Holding AG Reg | | |
| (57) | Baloise Holding AG Reg | Morgan Stanley | 186 | 426 | Flughafen Zurich AG Reg | Bank of America | |
| 60 | Banque Cantonale Vaudoise Reg | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.643 |
| | | Merrill Lynch | (241) | 299 | Flughafen Zurich AG Reg | Goldman Sachs | 1.153 |
| 7 | Barry Callebaut AG Reg | Bank of America | | 66 | Flughafen Zurich AG Reg | Morgan Stanley | 110 |
| | | Merrill Lynch | (1.240) | (17) | Forbo Holding AG Reg | Goldman Sachs | (921) |
| 8 | Barry Callebaut AG Reg | Goldman Sachs | (1.417) | | | | |
| 7 | Barry Callebaut AG Reg | Morgan Stanley | (394) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|---|----------------------------|-------------------------------|-------------------------------|---|
| Schweiz Fortsetzung | | | | Schweiz Fortsetzung | | | |
| (306) | Galenica AG | Bank of America Merrill Lynch | (39) | (212) | Montana Aerospace AG | Bank of America Merrill Lynch | 49 |
| (1.046) | Galenica AG | Morgan Stanley | (42) | (64) | Montana Aerospace AG | Goldman Sachs | 15 |
| 18 | Geberit AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (90) | 459 | Nestle SA Reg | Bank of America Merrill Lynch | (3.052) |
| (1.060) | Georg Fischer AG Reg | Morgan Stanley | (3.922) | 627 | Nestle SA Reg | Goldman Sachs | (228) |
| 24 | Givaudan SA Reg | Bank of America Merrill Lynch | 627 | (24) | Novartis AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 20 |
| 30 | Givaudan SA Reg | Goldman Sachs | (1.631) | (960) | Novartis AG Reg | Goldman Sachs | 870 |
| 4 | Givaudan SA Reg | Morgan Stanley | (142) | (454) | Novartis AG Reg | Morgan Stanley | 481 |
| 90 | Gurit Holding AG | Bank of America Merrill Lynch | (694) | (320) | OC Oerlikon Corp AG Reg | Goldman Sachs | (68) |
| 110 | Gurit Holding AG | Goldman Sachs | (848) | (5) | Orior AG | Goldman Sachs | 38 |
| (156) | Helvetia Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 32 | (20) | Partners Group Holding AG | Bank of America Merrill Lynch | (459) |
| (217) | Helvetia Holding AG Reg | Goldman Sachs | 64 | (6) | Partners Group Holding AG | Morgan Stanley | (44) |
| (70) | Helvetia Holding AG Reg | Morgan Stanley | 155 | (267) | Peach Property Group AG | Bank of America Merrill Lynch | (624) |
| (178) | Holcim AG | Bank of America Merrill Lynch | (82) | (249) | Peach Property Group AG | Goldman Sachs | (606) |
| (414) | Holcim AG | Morgan Stanley | (168) | (67) | PolyPeptide Group AG | Bank of America Merrill Lynch | (536) |
| (6) | Huber + Suhner AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (4) | (20) | PolyPeptide Group AG | Goldman Sachs | (162) |
| 1.482 | Idorsia Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 2.796 | (193) | PSP Swiss Property AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 1.509 |
| 916 | Idorsia Ltd | Goldman Sachs | 1.728 | (312) | PSP Swiss Property AG Reg | Goldman Sachs | 2.439 |
| 259 | Idorsia Ltd | Morgan Stanley | 113 | (348) | PSP Swiss Property AG Reg | Morgan Stanley | 2.176 |
| 16 | Inficon Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 517 | (12) | Rieter Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (30) |
| 10 | Inficon Holding AG Reg | Goldman Sachs | 323 | (12) | Rieter Holding AG Reg | Goldman Sachs | (30) |
| (2) | Interroll Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 125 | (41) | Roche Holding AG | Bank of America Merrill Lynch | (205) |
| (3) | Interroll Holding AG Reg | Goldman Sachs | 188 | 69 | Roche Holding AG | Bank of America Merrill Lynch | (219) |
| (297) | Julius Baer Group Ltd | Goldman Sachs | (34) | (15) | Roche Holding AG | Goldman Sachs | (75) |
| (9) | Komax Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (143) | (116) | Roche Holding AG | Morgan Stanley | (326) |
| (2) | Komax Holding AG Reg | Goldman Sachs | (28) | (38) | Schindler Holding AG | Goldman Sachs | (539) |
| (46) | Kuehne + Nagel International AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 292 | (174) | Schindler Holding AG | Morgan Stanley | (1.079) |
| (65) | Kuehne + Nagel International AG Reg | Goldman Sachs | 413 | (182) | Schindler Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (1.973) |
| 40 | Landis+Gyr Group AG | Bank of America Merrill Lynch | 142 | (170) | Schindler Holding AG Reg | Goldman Sachs | (1.843) |
| 170 | Landis+Gyr Group AG | Goldman Sachs | 602 | (105) | Schindler Holding AG Reg | Morgan Stanley | (460) |
| (13) | Leonteq AG | Bank of America Merrill Lynch | 14 | 303 | Sensirion Holding AG | Goldman Sachs | (1.926) |
| (43) | Liechtensteinische Landesbank AG | Bank of America Merrill Lynch | (15) | (83) | SFS Group AG | Bank of America Merrill Lynch | 350 |
| (25) | Liechtensteinische Landesbank AG | Goldman Sachs | (4) | (112) | SFS Group AG | Goldman Sachs | 537 |
| 50 | Logitech International SA Reg | Bank of America Merrill Lynch | 163 | (9) | SGS SA Reg | Bank of America Merrill Lynch | 248 |
| 586 | Logitech International SA Reg | Morgan Stanley | 1.098 | (30) | SGS SA Reg | Goldman Sachs | 1.641 |
| (47) | Lonza Group AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (1.284) | (11) | SGS SA Reg | Morgan Stanley | 382 |
| (28) | Lonza Group AG Reg | Goldman Sachs | (735) | (8) | Siegfried Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (183) |
| (67) | Lonza Group AG Reg | Morgan Stanley | (828) | 1.271 | SIG Combibloc Group AG | Bank of America Merrill Lynch | 1.788 |
| 80 | Medartis Holding AG | Bank of America Merrill Lynch | 242 | 960 | SIG Combibloc Group AG | Morgan Stanley | 1.101 |
| 57 | Medartis Holding AG | Goldman Sachs | 172 | 397 | Sika AG Reg | Morgan Stanley | 2.557 |
| (65) | Medmix AG | Bank of America Merrill Lynch | 127 | (53) | Softwareone Holding AG | Goldman Sachs | 8 |
| (44.483) | Meyer Burger Technology AG | Goldman Sachs | (1.956) | (75) | Sonova Holding AG Reg | Morgan Stanley | (1.178) |
| (784) | Mobilezone Holding AG Reg | Goldman Sachs | 425 | (25) | St Galler Kantonalbank AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (257) |
| (56) | Mobimo Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 292 | (49) | St Galler Kantonalbank AG Reg | Goldman Sachs | (517) |
| (53) | Mobimo Holding AG Reg | Goldman Sachs | 279 | 139 | Stadler Rail AG | Bank of America Merrill Lynch | (27) |
| 33 | Molecular Partners AG | Bank of America Merrill Lynch | 25 | 144 | Stadler Rail AG | Goldman Sachs | (49) |
| | | | | (97) | Straumann Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (1.162) |
| | | | | (581) | Straumann Holding AG Reg | Goldman Sachs | (2.902) |
| | | | | (209) | Straumann Holding AG Reg | Morgan Stanley | (1.698) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------------------------|---------------------------------|-----------------|---|-----------------------------------|--|-----------------|---|
| Schweiz Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| 266 | Sulzer AG Reg | Bank of America | | 2.476 | Admiral Group Plc | Goldman Sachs | 765 |
| | | Merrill Lynch | (1.317) | 1.524 | Admiral Group Plc | Morgan Stanley | 38 |
| 191 | Sulzer AG Reg | Goldman Sachs | (946) | (70) | AG Barr Plc | Goldman Sachs | 28 |
| 107 | Swatch Group AG | Bank of America | | (5.099) | Airtel Africa Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 67 | | | Merrill Lynch | (1.001) |
| 148 | Swatch Group AG | Goldman Sachs | 392 | (14.417) | Airtel Africa Plc | Goldman Sachs | (2.831) |
| 254 | Swatch Group AG | Morgan Stanley | 3.487 | (9.383) | Airtel Africa Plc | Morgan Stanley | (780) |
| (812) | Swatch Group AG Reg | Bank of America | | 124 | AJ Bell Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 51 | | | Merrill Lynch | 28 |
| (256) | Swatch Group AG Reg | Goldman Sachs | 16 | 3.780 | AJ Bell Plc | Goldman Sachs | 863 |
| (37) | Swiss Life Holding AG Reg | Goldman Sachs | (200) | 552 | Alliance Pharma Plc | Goldman Sachs | 15 |
| (129) | Swiss Life Holding AG Reg | Morgan Stanley | 585 | 84 | Alpha FX Group Plc | Bank of America | |
| (525) | Swiss Prime Site AG Reg | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 83 |
| | | Merrill Lynch | 1.493 | 42 | Alpha FX Group Plc | Goldman Sachs | 42 |
| (161) | Swiss Prime Site AG Reg | Goldman Sachs | 357 | (299) | Anglo American Plc | Bank of America | |
| (636) | Swiss Re AG | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (1.341) |
| | | Merrill Lynch | 1.152 | (588) | Anglo American Plc | Goldman Sachs | (3.246) |
| (86) | Swiss Re AG | Goldman Sachs | 2 | (561) | Antofagasta Plc | Bank of America | |
| (146) | Swiss Re AG | Morgan Stanley | 30 | | | Merrill Lynch | (935) |
| (34) | Swisscom AG Reg | Bank of America | | (2.261) | Antofagasta Plc | Goldman Sachs | (4.184) |
| | | Merrill Lynch | 411 | (937) | Antofagasta Plc | Morgan Stanley | (932) |
| (123) | Swisscom AG Reg | Goldman Sachs | 1.291 | (2.371) | AO World Plc | Bank of America | |
| (64) | Swisscom AG Reg | Morgan Stanley | (227) | | | Merrill Lynch | (160) |
| 18 | Swissquote Group Holding SA Reg | Bank of America | | (4.750) | AO World Plc | Goldman Sachs | (320) |
| | | Merrill Lynch | (36) | 1.363 | Ascential Plc | Bank of America | |
| 40 | Swissquote Group Holding SA Reg | Goldman Sachs | 88 | 1.379 | Ascential Plc | Merrill Lynch | 240 |
| 94 | Swissquote Group Holding SA Reg | | | 690 | Ashmore Group Plc | Goldman Sachs | 243 |
| (8) | Tecan Group AG Reg | Morgan Stanley | (265) | | | Bank of America | |
| | | Bank of America | | 1.396 | Ashmore Group Plc | Merrill Lynch | 151 |
| | | Merrill Lynch | (58) | (1.460) | Ashtead Group Plc | Goldman Sachs | 306 |
| (28) | Tecan Group AG Reg | Goldman Sachs | (204) | | | Bank of America | |
| 70 | Temenos AG Reg | Goldman Sachs | (330) | (1.050) | Ashtead Group Plc | Merrill Lynch | (4.821) |
| 59 | u-blox Holding AG | Bank of America | | (490) | Ashtead Group Plc | Goldman Sachs | (4.118) |
| | | Merrill Lynch | 510 | (544) | ASOS Plc | Morgan Stanley | (1.616) |
| 363 | u-blox Holding AG | Goldman Sachs | 3.140 | | | Bank of America | |
| 38 | Valiant Holding AG Reg | Bank of America | | (387) | ASOS Plc | Merrill Lynch | (979) |
| | | Merrill Lynch | (408) | 215 | Associated British Foods Plc | Goldman Sachs | (1.058) |
| 45 | Valiant Holding AG Reg | Goldman Sachs | (483) | | | Bank of America | |
| 6 | Valora Holding AG Reg | Bank of America | | 972 | Associated British Foods Plc | Merrill Lynch | 22 |
| | | Merrill Lynch | 16 | | | Morgan Stanley | 1.322 |
| 123 | VAT Group AG | Bank of America | | (24.798) | Assura Plc (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.616 | | | Merrill Lynch | (1.014) |
| 59 | VAT Group AG | Goldman Sachs | 1.053 | (14.213) | Assura Plc (REIT) | Goldman Sachs | (537) |
| 22 | VAT Group AG | Morgan Stanley | 486 | 349 | Aston Martin Lagonda Global Holdings Plc | Bank of America | |
| (12) | Vetropack Holding AG Reg | Goldman Sachs | (11) | | | Merrill Lynch | 103 |
| 18 | Vontobel Holding AG Reg | Bank of America | | 473 | Aston Martin Lagonda Global Holdings Plc | Goldman Sachs | 139 |
| | | Merrill Lynch | 120 | (219) | AstraZeneca Plc | Bank of America | |
| (33) | VZ Holding AG | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 379 |
| | | Merrill Lynch | (98) | (31) | AstraZeneca Plc | Goldman Sachs | 30 |
| (7) | VZ Holding AG | Goldman Sachs | (21) | (493) | AstraZeneca Plc | Morgan Stanley | 1.310 |
| 176 | Ypsomed Holding AG Reg | Bank of America | | (154) | Atalaya Mining Plc | Goldman Sachs | (68) |
| | | Merrill Lynch | 1.015 | (890) | Auction Technology Group Plc | Bank of America | |
| 92 | Ypsomed Holding AG Reg | Goldman Sachs | 591 | (756) | Auction Technology Group Plc | Merrill Lynch | (908) |
| (54) | Zehnder Group AG | Bank of America | | | | Goldman Sachs | (771) |
| | | Merrill Lynch | 6 | 1.470 | Auto Trader Group Plc | Bank of America | |
| (138) | Zehnder Group AG | Goldman Sachs | 14 | | | Merrill Lynch | 572 |
| (146) | Zur Rose Group AG | Bank of America | | 820 | Auto Trader Group Plc | Goldman Sachs | 388 |
| | | Merrill Lynch | (1.141) | 1.383 | Auto Trader Group Plc | Morgan Stanley | 533 |
| (84) | Zur Rose Group AG | Goldman Sachs | (657) | (7.096) | Avast Plc | Goldman Sachs | 536 |
| (55) | Zurich Insurance Group AG | Goldman Sachs | 985 | 219 | AVEVA Group Plc | Bank of America | |
| (10) | Zurich Insurance Group AG | Morgan Stanley | 38 | | | Merrill Lynch | 408 |
| | | | (1.725) | 293 | AVEVA Group Plc | Goldman Sachs | 546 |
| | | | | 61 | Avon Protection Plc | Bank of America | |
| (920) | 3i Group Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 55 |
| | | Merrill Lynch | 457 | (8.755) | B&M European Value Retail SA | Morgan Stanley | 3.362 |
| (1.134) | Abcam Plc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (1.042) | | | | |
| (125) | Abcam Plc | Goldman Sachs | (115) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|--|-------------------------------|---|-----------------------------------|--|-------------------------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| 3.850 | Babcock International Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.338 | (737) | Bunzl Plc | Morgan Stanley | 325 |
| 6.282 | Babcock International Group Plc | Goldman Sachs | 2.239 | (1.157) | Burberry Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.612) |
| 1.192 | BAE Systems Plc | Bank of America Merrill Lynch | 67 | (5.730) | Burberry Group Plc | Goldman Sachs | (7.010) |
| 5.548 | BAE Systems Plc | Morgan Stanley | (545) | (628) | Burberry Group Plc | Morgan Stanley | (767) |
| 2.548 | Balfour Beatty Plc | Bank of America Merrill Lynch | 334 | (416) | Burford Capital Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (351) |
| 5.432 | Balfour Beatty Plc | Goldman Sachs | 766 | (4.613) | Burford Capital Ltd | Goldman Sachs | (3.891) |
| 5.081 | Baltic Classifieds Group Plc | Goldman Sachs | (13) | 1.181 | Bytes Technology Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 479 |
| 723 | Bank of Georgia Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 2.294 | 2.518 | Bytes Technology Group Plc | Goldman Sachs | 1.021 |
| 2.361 | Bank of Georgia Group Plc | Goldman Sachs | 7.490 | (2.448) | C&C Group Plc | Goldman Sachs | 163 |
| (13.139) | Barclays Plc | Bank of America Merrill Lynch | (127) | (5.838) | Cairn Homes Plc | Bank of America Merrill Lynch | (271) |
| (6.240) | Barclays Plc | Goldman Sachs | (900) | (8.328) | Cairn Homes Plc | Goldman Sachs | (386) |
| (19.477) | Barclays Plc | Morgan Stanley | (2.512) | (2.416) | Capita Plc | Bank of America Merrill Lynch | (30) |
| 638 | Barratt Developments Plc | Bank of America Merrill Lynch | 166 | 1.213 | Capital & Counties Properties Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (43) |
| 5.737 | Barratt Developments Plc | Goldman Sachs | 1.495 | 2.034 | Capital & Counties Properties Plc (REIT) | Goldman Sachs | (72) |
| 2.704 | Barratt Developments Plc | Morgan Stanley | 123 | 3.268 | Capricorn Energy Plc | Bank of America Merrill Lynch | (90) |
| 7.603 | Beazley Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.474 | 4.460 | Capricorn Energy Plc | Goldman Sachs | (124) |
| 2.503 | Beazley Plc | Morgan Stanley | 95 | 2.548 | Carnival Plc | Goldman Sachs | 799 |
| (228) | Bellway Plc | Bank of America Merrill Lynch | (287) | 5.319 | Carnival Plc | Morgan Stanley | 3.976 |
| (81) | Berkeley Group Holdings Plc | Bank of America Merrill Lynch | (206) | 10.572 | Centamin Plc | Bank of America Merrill Lynch | (410) |
| (756) | Berkeley Group Holdings Plc | Morgan Stanley | (447) | 21.402 | Centamin Plc | Goldman Sachs | (830) |
| (726) | BHP Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 273 | (1.100) | Central Asia Metals Plc | Bank of America Merrill Lynch | (353) |
| (1.025) | BHP Group Ltd | Goldman Sachs | 368 | (431) | Central Asia Metals Plc | Goldman Sachs | (138) |
| (628) | BHP Group Ltd | Morgan Stanley | 1.368 | 19.212 | Centrica Plc | Bank of America Merrill Lynch | (191) |
| (832) | Biffa Plc | Bank of America Merrill Lynch | (13) | 65.178 | Centrica Plc | Goldman Sachs | (1.799) |
| (1.490) | Biffa Plc | Goldman Sachs | (23) | 37.105 | Centrica Plc | Morgan Stanley | (3.982) |
| 2.789 | Big Yellow Group Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 3.265 | (155) | Ceres Power Holdings Plc | Goldman Sachs | (38) |
| 2.143 | Big Yellow Group Plc (REIT) | Goldman Sachs | 2.509 | 1.129 | Chemring Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (45) |
| 435 | BMO Commercial Property Trust Ltd (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (15) | 1.888 | Chemring Group Plc | Goldman Sachs | (76) |
| 1.172 | BMO Commercial Property Trust Ltd (REIT) | Goldman Sachs | (41) | 10.434 | Cineworld Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 319 |
| 495 | Bodycote Plc | Bank of America Merrill Lynch | 125 | 16.342 | Cineworld Group Plc | Goldman Sachs | 501 |
| 760 | Bodycote Plc | Goldman Sachs | 191 | 17 | Clarkson Plc | Bank of America Merrill Lynch | (4) |
| (1.097) | boohoo Group Plc | Goldman Sachs | (77) | (258) | Close Brothers Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (42) |
| (2.530) | BP Plc | Bank of America Merrill Lynch | (620) | (346) | Close Brothers Group Plc | Goldman Sachs | (57) |
| (15.031) | BP Plc | Goldman Sachs | (3.592) | 336 | CLS Holdings Plc (REIT) | Goldman Sachs | 59 |
| (12.131) | BP Plc | Morgan Stanley | (1.504) | (2.724) | CMC Markets Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.389) |
| (8.071) | Breedon Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 91 | (1.806) | CMC Markets Plc | Goldman Sachs | (921) |
| (7.379) | Breedon Group Plc | Goldman Sachs | 84 | 700 | Coats Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (3) |
| (5.452) | Bridgepoint Group Plc Reg | Bank of America Merrill Lynch | (2.488) | 751 | Coca-Cola HBC AG | Morgan Stanley | 41 |
| (10.194) | Bridgepoint Group Plc Reg | Goldman Sachs | (4.727) | (1.926) | Compass Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (774) |
| 29 | British American Tobacco Plc | Goldman Sachs | 20 | (3.191) | Compass Group Plc | Goldman Sachs | (1.889) |
| 623 | British American Tobacco Plc | Morgan Stanley | 149 | (3.699) | Compass Group Plc | Morgan Stanley | (1.744) |
| (886) | British Land Co Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 17 | (1.161) | Computacenter Plc | Goldman Sachs | (2.109) |
| (4.530) | British Land Co Plc (REIT) | Goldman Sachs | (439) | (1.734) | ContourGlobal Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.301) |
| (807) | British Land Co Plc (REIT) | Morgan Stanley | 35 | 7.712 | ConvaTec Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (360) |
| (13.711) | BT Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (493) | 11.657 | ConvaTec Group Plc | Goldman Sachs | (438) |
| | | | | 16.810 | ConvaTec Group Plc | Morgan Stanley | (763) |
| | | | | (2.476) | Countryside Partnerships Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.465) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| (191) | Countryside Partnerships Plc | Goldman Sachs | (113) | (10.144) | Essentra Plc | Goldman Sachs | (2.235) |
| 471 | Craneware Plc | Bank of America Merrill Lynch | 316 | (116.776) | Eurasia Mining Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.602) |
| 395 | Craneware Plc | Goldman Sachs | 265 | 469 | Experian Plc | Bank of America Merrill Lynch | 672 |
| 275 | Crest Nicholson Holdings Plc | Goldman Sachs | 57 | 1.116 | Experian Plc | Goldman Sachs | 520 |
| 614 | Croda International Plc | Bank of America Merrill Lynch | 677 | 3.553 | Experian Plc | Morgan Stanley | 2.905 |
| 1.305 | Croda International Plc | Goldman Sachs | 1.423 | (44) | FD Technologies Plc | Goldman Sachs | 94 |
| 709 | Croda International Plc | Morgan Stanley | 553 | (40) | Ferguson Plc | Bank of America Merrill Lynch | 57 |
| 6.216 | Currys Plc | Bank of America Merrill Lynch | (598) | (348) | Ferguson Plc | Goldman Sachs | (201) |
| 2.115 | Currys Plc | Goldman Sachs | (204) | (87) | Ferguson Plc | Morgan Stanley | (107) |
| 1.204 | CVS Group Plc | Goldman Sachs | 2.243 | 1.371 | Ferrexpo Plc | Bank of America Merrill Lynch | 502 |
| (223) | DCC Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.864 | 132 | Fevertree Drinks Plc | Bank of America Merrill Lynch | (121) |
| (946) | DCC Plc | Morgan Stanley | 2.525 | 1.299 | Fevertree Drinks Plc | Goldman Sachs | (1.194) |
| 248 | Dechra Pharmaceuticals Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.093 | (458) | Forterra Plc | Bank of America Merrill Lynch | (182) |
| 502 | Dechra Pharmaceuticals Plc | Goldman Sachs | 2.212 | (1.779) | Frasers Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (112) |
| 414 | Dechra Pharmaceuticals Plc | Morgan Stanley | 605 | (3.524) | Frasers Group Plc | Goldman Sachs | (222) |
| (33.627) | Deliveroo Plc | Morgan Stanley | (1.626) | (3.460) | Fresnillo Plc | Bank of America Merrill Lynch | (330) |
| 96 | Derwent London Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (41) | (1.748) | Fresnillo Plc | Goldman Sachs | (146) |
| 59 | Derwent London Plc (REIT) | Goldman Sachs | (8) | (708) | Fresnillo Plc | Morgan Stanley | 121 |
| 451 | Derwent London Plc (REIT) | Morgan Stanley | (290) | (60) | Frontier Developments Plc | Bank of America Merrill Lynch | 2 |
| 465 | Diageo Plc | Bank of America Merrill Lynch | 163 | (78) | Frontier Developments Plc | Goldman Sachs | 33 |
| 185 | Diageo Plc | Morgan Stanley | 47 | (810) | Funding Circle Holdings Plc | Bank of America Merrill Lynch | (140) |
| 649 | Diploma Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.177 | (1.292) | Funding Circle Holdings Plc | Goldman Sachs | (223) |
| 1.686 | Diploma Plc | Goldman Sachs | 3.056 | (1.071) | Future Plc | Bank of America Merrill Lynch | 526 |
| 9.258 | Direct Line Insurance Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 874 | (1.438) | Future Plc | Goldman Sachs | (138) |
| 20.673 | Direct Line Insurance Group Plc | Goldman Sachs | 1.929 | (1.065) | Future Plc | Morgan Stanley | (416) |
| 5.513 | Direct Line Insurance Group Plc | Morgan Stanley | 298 | (695) | Games Workshop Group Plc | Morgan Stanley | (2.537) |
| (14.587) | Diversified Energy Co Plc | Bank of America Merrill Lynch | (481) | 1.763 | GB Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 277 |
| (7.700) | Diversified Energy Co Plc | Goldman Sachs | (272) | 165 | GB Group Plc | Goldman Sachs | 64 |
| (1.639) | Domino's Pizza Group Plc | Goldman Sachs | (149) | 104 | Genuit Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 56 |
| 7.147 | dotdigital group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 621 | 178 | Genuit Group Plc | Goldman Sachs | 96 |
| 7.178 | dotdigital group Plc | Goldman Sachs | 624 | 260 | Genus Plc | Goldman Sachs | 615 |
| (13.818) | Dr. Martens Plc | Bank of America Merrill Lynch | (3.844) | (1.644) | GlaxoSmithKline Plc | Goldman Sachs | 1.357 |
| (5.997) | Dr. Martens Plc | Goldman Sachs | (1.668) | (4.076) | GlaxoSmithKline Plc | Morgan Stanley | 2.812 |
| (1.279) | Dr. Martens Plc | Morgan Stanley | (296) | (2.619) | Glencore Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.724) |
| 2.356 | Drax Group Plc | Morgan Stanley | (3.930) | (14.093) | Glencore Plc | Goldman Sachs | (3.686) |
| (405) | DS Smith Plc | Goldman Sachs | (16) | (3.023) | Glencore Plc | Morgan Stanley | (215) |
| (6.581) | DS Smith Plc | Morgan Stanley | (447) | (153) | Go-Ahead Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (8) |
| 935 | Dunelm Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 109 | 87 | Grafton Group Plc (Unit) | Goldman Sachs | 28 |
| 722 | Dunelm Group Plc | Goldman Sachs | 94 | (510) | Grainger Plc | Goldman Sachs | (27) |
| 4.816 | easyJet Plc | Morgan Stanley | (570) | 573 | Great Portland Estates Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (92) |
| (11.533) | Elementis Plc | Bank of America Merrill Lynch | (581) | 627 | Great Portland Estates Plc (REIT) | Goldman Sachs | (128) |
| (9.843) | Elementis Plc | Goldman Sachs | (496) | (149.569) | Greatland Gold Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.130 |
| (9.313) | Empiric Student Property Plc (REIT) | Goldman Sachs | (692) | (52.349) | Greatland Gold Plc | Goldman Sachs | 395 |
| (89) | Energiean Plc | Bank of America Merrill Lynch | 28 | (18.448) | Greencore Group Plc | Goldman Sachs | 276 |
| (107) | Energiean Plc | Goldman Sachs | 48 | (2.187) | Greggs Plc | Bank of America Merrill Lynch | (2.703) |
| (34) | Ergomed Plc | Bank of America Merrill Lynch | (39) | (1.859) | Greggs Plc | Goldman Sachs | (2.545) |
| (26) | Ergomed Plc | Goldman Sachs | (29) | (1.238) | Greggs Plc | Morgan Stanley | (1.746) |
| (4.056) | Essentra Plc | Bank of America Merrill Lynch | (894) | 335 | Gym Group Plc | Goldman Sachs | 112 |
| | | | | (348) | Halfords Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (17) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|---------------------------|-----------------|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| (10.645) | Halfords Group Plc | Goldman Sachs | (509) | 5.546 | IntegraFin Holdings Plc | Bank of America | (3.647) |
| 216 | Halma Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | |
| | | Merrill Lynch | 235 | 2.915 | IntegraFin Holdings Plc | Goldman Sachs | (1.898) |
| 4.406 | Halma Plc | Goldman Sachs | 4.468 | 46 | InterContinental Hotels | | |
| 873 | Halma Plc | Morgan Stanley | 1.077 | | Group Plc | Morgan Stanley | 146 |
| 69.825 | Hammerson Plc (REIT) | Bank of America | | (758) | Intermediate Capital | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (137) | | Group Plc | Merrill Lynch | (1.436) |
| 64.638 | Hammerson Plc (REIT) | Goldman Sachs | (111) | (23.276) | International Consolidated | Bank of America | |
| 7 | Hammerson Plc (REIT) | Morgan Stanley | — | | Airlines Group SA | Merrill Lynch | (931) |
| (4.566) | Harbour Energy Plc | Bank of America | | (9.730) | International Consolidated | | |
| | | Merrill Lynch | 4.478 | | Airlines Group SA | Morgan Stanley | (186) |
| (1.161) | Harbour Energy Plc | Goldman Sachs | 1.139 | 536 | Intertek Group Plc | Bank of America | |
| (3.074) | Harbour Energy Plc | Morgan Stanley | 2.593 | | | Merrill Lynch | |
| 7.936 | Hargreaves Lansdown Plc | Bank of America | | 173 | Intertek Group Plc | Goldman Sachs | (457) |
| | | Merrill Lynch | 202 | 667 | Intertek Group Plc | Morgan Stanley | (67) |
| 6.723 | Hargreaves Lansdown Plc | Goldman Sachs | (1.253) | (2.967) | Investec Plc | Morgan Stanley | (34) |
| 6.151 | Hargreaves Lansdown Plc | Morgan Stanley | (975) | (8.124) | IP Group Plc | Bank of America | |
| (7.443) | Hays Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (706) |
| | | Merrill Lynch | (319) | (6.684) | IP Group Plc | Goldman Sachs | (581) |
| (6.864) | Hays Plc | Goldman Sachs | (294) | (6.671) | IQE Plc | Bank of America | |
| 89 | Helical Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (521) |
| | | Merrill Lynch | (6) | 12.193 | ITV Plc | Bank of America | |
| 1.224 | Helios Towers Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (204) |
| | | Merrill Lynch | (40) | 4.903 | ITV Plc | Goldman Sachs | 28 |
| 341 | Helios Towers Plc | Goldman Sachs | 9 | 30.499 | ITV Plc | Morgan Stanley | (1.543) |
| 2.418 | Hikma Pharmaceuticals Plc | Bank of America | | 2.028 | IWG Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (6) | | | Merrill Lynch | 231 |
| 333 | Hikma Pharmaceuticals Plc | Goldman Sachs | (202) | 7.032 | IWG Plc | Goldman Sachs | 789 |
| 1.763 | Hikma Pharmaceuticals Plc | Morgan Stanley | (1.099) | (69) | J D Wetherspoon Plc | Goldman Sachs | (17) |
| 650 | Hill & Smith Holdings Plc | Bank of America | | 3.982 | J Sainsbury Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 835 | | | Merrill Lynch | (719) |
| 674 | Hill & Smith Holdings Plc | Goldman Sachs | 865 | 3.859 | J Sainsbury Plc | Goldman Sachs | (232) |
| 1.978 | Hiscox Ltd | Bank of America | | 5.748 | J Sainsbury Plc | Morgan Stanley | (234) |
| | | Merrill Lynch | (991) | (4.390) | JD Sports Fashion Plc | Bank of America | |
| 1.574 | Hiscox Ltd | Goldman Sachs | (789) | | | Merrill Lynch | (386) |
| 2.474 | Hiscox Ltd | Morgan Stanley | (1.233) | (16.492) | JD Sports Fashion Plc | Goldman Sachs | 731 |
| (10.696) | Hochschild Mining Plc | Bank of America | | (43.641) | JD Sports Fashion Plc | Morgan Stanley | 421 |
| | | Merrill Lynch | (1.293) | (142) | JET2 Plc | Bank of America | |
| (9.623) | Hochschild Mining Plc | Goldman Sachs | (1.147) | | | Merrill Lynch | (49) |
| 512 | Hotel Chocolat Group Plc | Bank of America | | (1.242) | JET2 Plc | Goldman Sachs | (430) |
| | | Merrill Lynch | (3) | (1.652) | JET2 Plc | Morgan Stanley | (187) |
| 747 | Hotel Chocolat Group Plc | Goldman Sachs | (4) | (4.414) | John Wood Group Plc | Bank of America | |
| (8.595) | Howden Joinery Group Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (917) |
| | | Merrill Lynch | (630) | (9.075) | John Wood Group Plc | Goldman Sachs | (2.114) |
| (5.743) | Howden Joinery Group Plc | Goldman Sachs | (275) | 208 | Johnson Matthey Plc | Bank of America | |
| (3.751) | Howden Joinery Group Plc | Morgan Stanley | (1.199) | | | Merrill Lynch | (495) |
| (10.008) | HSBC Holdings Plc | Morgan Stanley | (4.044) | 478 | Johnson Matthey Plc | Goldman Sachs | (1.358) |
| 705 | Hunting Plc | Bank of America | | (61) | JTC Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 222 | | | Merrill Lynch | (18) |
| 3.555 | Hunting Plc | Goldman Sachs | 1.119 | 88 | Judges Scientific Plc | Bank of America | |
| (8.058) | Ibstock Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 715 |
| | | Merrill Lynch | (557) | 166 | Judges Scientific Plc | Goldman Sachs | 1.348 |
| (5.068) | Ibstock Plc | Goldman Sachs | (406) | 1.503 | Jupiter Fund | Bank of America | |
| (5.827) | IG Design Group Plc | Bank of America | | | Management Plc | Merrill Lynch | 54 |
| | | Merrill Lynch | 624 | 4.287 | Jupiter Fund | | |
| (4.480) | IG Design Group Plc | Goldman Sachs | 479 | | Management Plc | Goldman Sachs | 216 |
| 451 | IG Group Holdings Plc | Goldman Sachs | (52) | (1.896) | Just Group Plc | Bank of America | |
| 6.443 | IG Group Holdings Plc | Morgan Stanley | 101 | | | Merrill Lynch | (39) |
| (413) | IMI Plc | Goldman Sachs | (686) | (1.874) | Just Group Plc | Goldman Sachs | (39) |
| 572 | Impax Asset Management | | | 649 | Kainos Group Plc | Bank of America | |
| | Group Plc | Goldman Sachs | 662 | | | Merrill Lynch | 1.797 |
| 2.633 | Imperial Brands Plc | Bank of America | | 295 | Kainos Group Plc | Goldman Sachs | 817 |
| | | Merrill Lynch | 2.370 | (1.784) | Kape Technologies Plc | Bank of America | |
| 1.036 | Inchcape Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 22 |
| | | Merrill Lynch | 126 | (109) | Kape Technologies Plc | Goldman Sachs | 8 |
| 692 | Inchcape Plc | Goldman Sachs | 197 | (1.103) | Keller Group Plc | Bank of America | |
| (641) | Informa Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 69 |
| | | Merrill Lynch | 35 | 445 | Keywords Studios Plc | Bank of America | |
| (204) | Informa Plc | Goldman Sachs | 24 | | | Merrill Lynch | 863 |
| (2.511) | Informa Plc | Morgan Stanley | 632 | 745 | Keywords Studios Plc | Goldman Sachs | 1.444 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|--|-------------------------------|---|-----------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| (3.843) | Kier Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (188) | (526) | Moonpig Group Plc | Goldman Sachs | (30) |
| 480 | Lancashire Holdings Ltd | Goldman Sachs | (41) | 1.678 | Morgan Advanced Materials Plc | Bank of America Merrill Lynch | 661 |
| (11.661) | Land Securities Group Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (3.514) | 4.484 | Morgan Advanced Materials Plc | Goldman Sachs | 1.767 |
| (4.396) | Land Securities Group Plc (REIT) | Goldman Sachs | (1.239) | (138) | Morgan Sindall Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (215) |
| 5.566 | Learning Technologies Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 639 | (79) | Morgan Sindall Group Plc | Goldman Sachs | (123) |
| 5.383 | Learning Technologies Group Plc | Goldman Sachs | 590 | (2.641) | Naked Wines Plc | Bank of America Merrill Lynch | (692) |
| (12.200) | Legal & General Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.560) | (408) | Naked Wines Plc | Goldman Sachs | (107) |
| (6.494) | Legal & General Group Plc | Goldman Sachs | (664) | 1.279 | National Express Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 268 |
| (22.739) | Legal & General Group Plc | Morgan Stanley | (1.059) | 1.456 | National Express Group Plc | Goldman Sachs | 305 |
| (145) | Liontrust Asset Management Plc | Bank of America Merrill Lynch | (66) | (2.151) | National Grid Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.638 |
| (447) | Liontrust Asset Management Plc | Goldman Sachs | (203) | 1.010 | Natwest Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 58 |
| (38.646) | Lloyds Banking Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (562) | 11.252 | NatWest Group Plc | Morgan Stanley | 1.412 |
| (6.855) | Lloyds Banking Group Plc | Goldman Sachs | (100) | (1.846) | NCC Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (209) |
| (117.803) | Lloyds Banking Group Plc | Morgan Stanley | (467) | (637) | NCC Group Plc | Goldman Sachs | (72) |
| 26 | London Stock Exchange Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 45 | 5.531 | Network International Holdings Plc | Goldman Sachs | 613 |
| (5.210) | LondonMetric Property Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (557) | (1.220) | Next Plc | Bank of America Merrill Lynch | (237) |
| (689) | LondonMetric Property Plc (REIT) | Morgan Stanley | (62) | (1.322) | Next Plc | Goldman Sachs | (3.879) |
| 1.940 | Luceco Plc | Bank of America Merrill Lynch | 130 | (1.189) | Next Plc | Morgan Stanley | (4.820) |
| 6.370 | Luceco Plc | Goldman Sachs | 426 | 2.664 | Ninety One Plc | Bank of America Merrill Lynch | (157) |
| (4.028) | M&G Plc | Bank of America Merrill Lynch | (28) | 2.729 | Ninety One Plc | Goldman Sachs | (73) |
| (1.957) | M&G Plc | Goldman Sachs | (253) | (407) | Ninety One Plc | Morgan Stanley | (1.157) |
| (6.220) | M&G Plc | Morgan Stanley | (63) | 1.070 | Ocado Group Plc | Goldman Sachs | 1.498 |
| (7.755) | Man Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.435) | 195 | Ocado Group Plc | Morgan Stanley | 342 |
| (9.335) | Man Group Plc | Goldman Sachs | (1.840) | (190) | On the Beach Group Plc | Goldman Sachs | 42 |
| (4.659) | Man Group Plc | Morgan Stanley | (610) | 310 | OSB Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (5) |
| (11.020) | Marks & Spencer Group Plc | Goldman Sachs | (646) | (2.830) | Oxford Biomedica Plc | Bank of America Merrill Lynch | (392) |
| (3.747) | Marks & Spencer Group Plc | Morgan Stanley | (646) | (3.338) | Oxford Biomedica Plc | Goldman Sachs | (462) |
| (82) | Marshalls Plc | Bank of America Merrill Lynch | (2) | 348 | Pagegroup Plc ^{††} | Bank of America Merrill Lynch | — |
| (410) | Marshalls Plc | Goldman Sachs | (10) | (591) | Paragon Banking Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (118) |
| 787 | Marston's Plc | Goldman Sachs | (67) | (240) | Paragon Banking Group Plc | Goldman Sachs | (48) |
| (1.843) | Mediclinic International Plc | Bank of America Merrill Lynch | (552) | (5.646) | Pearson Plc | Morgan Stanley | 640 |
| (2.922) | Mediclinic International Plc | Goldman Sachs | (875) | 2.421 | Pennon Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (2.433) |
| 14.964 | Melrose Industries Plc | Goldman Sachs | 3.560 | 464 | Pennon Group Plc | Goldman Sachs | (527) |
| 386 | Melrose Industries Plc | Morgan Stanley | 67 | (124) | Persimmon Plc | Morgan Stanley | (38) |
| 3.959 | Micro Focus International Plc | Bank of America Merrill Lynch | 219 | (3.753) | Petrofac Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 414 |
| 2.136 | Micro Focus International Plc | Goldman Sachs | 126 | (6.527) | Petrofac Ltd | Goldman Sachs | 933 |
| (763) | Mitchells & Butlers Plc | Bank of America Merrill Lynch | (36) | 8.456 | Pets at Home Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 6.238 |
| (617) | Mitchells & Butlers Plc | Goldman Sachs | (28) | 5.622 | Pets at Home Group Plc | Goldman Sachs | 4.147 |
| (26.647) | Mitie Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.137) | 1.075 | Phoenix Group Holdings Plc | Morgan Stanley | (103) |
| (10.886) | Mitie Group Plc | Goldman Sachs | (465) | (29) | Plus500 Ltd ^{††} | Bank of America Merrill Lynch | — |
| (1.070) | Mondi Plc | Goldman Sachs | (81) | (1.801) | Plus500 Ltd | Goldman Sachs | 23 |
| (1.771) | Mondi Plc | Morgan Stanley | (892) | (750) | Polar Capital Holdings Plc | Bank of America Merrill Lynch | (755) |
| 2 | Moneysupermarket.com Group Plc ^{††} | Bank of America Merrill Lynch | — | (405) | Polar Capital Holdings Plc | Goldman Sachs | (408) |
| (5.035) | Moneysupermarket.com Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.040) | (983) | Premier Foods Plc | Goldman Sachs | 16 |
| (1.287) | Moneysupermarket.com Group Plc | Goldman Sachs | (266) | (8.012) | Primary Health Properties Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (383) |
| 2 | Moneysupermarket.com Group Plc ^{††} | Morgan Stanley | — | (2.793) | Primary Health Properties Plc (REIT) | Goldman Sachs | (134) |
| | | | | (978) | Provident Financial Plc | Bank of America Merrill Lynch | (111) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|---|-----------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| (913) | Provident Financial Plc | Goldman Sachs | (103) | 708 | Schroders Plc | Morgan Stanley | 584 |
| (1.577) | Prudential Plc | Bank of America Merrill Lynch | (768) | (88) | Secure Income Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1 |
| (3.612) | Prudential Plc | Goldman Sachs | (3.371) | 721 | Segro Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (141) |
| (6.508) | Prudential Plc | Morgan Stanley | (2.829) | 8.816 | Segro Plc (REIT) | Goldman Sachs | (921) |
| 4.992 | Quilter Plc | Goldman Sachs | (1.678) | 1.043 | Segro Plc (REIT) | Morgan Stanley | (33) |
| 4.579 | Quilter Plc | Morgan Stanley | (69) | (627) | Senior Plc | Bank of America Merrill Lynch | 28 |
| (5.405) | Rank Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (585) | (5.121) | Serco Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.704) |
| (1.535) | Rank Group Plc | Goldman Sachs | (166) | (6.579) | Serco Group Plc | Goldman Sachs | (2.212) |
| (148) | Rathbones Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 7 | 3.489 | Serica Energy Plc | Bank of America Merrill Lynch | (2.943) |
| (386) | Reach Plc | Goldman Sachs | (14) | 2.747 | Serica Energy Plc | Goldman Sachs | (2.317) |
| 172 | Reckitt Benckiser Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (132) | (289) | Severn Trent Plc | Bank of America Merrill Lynch | 702 |
| 164 | Reckitt Benckiser Group Plc | Morgan Stanley | (197) | (722) | Severn Trent Plc | Goldman Sachs | 1.754 |
| (3.242) | Redde Northgate Plc | Bank of America Merrill Lynch | (673) | (329) | Severn Trent Plc | Morgan Stanley | 890 |
| (1.565) | Redde Northgate Plc | Goldman Sachs | (325) | (927) | Shaftesbury Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (268) |
| 2.285 | Redrow Plc | Bank of America Merrill Lynch | 662 | (698) | Shaftesbury Plc (REIT) | Goldman Sachs | (202) |
| 3.895 | Redrow Plc | Goldman Sachs | 1.128 | (953) | Shell Plc | Goldman Sachs | (852) |
| 684 | RELX Plc | Bank of America Merrill Lynch | (203) | (1.385) | Shell Plc | Morgan Stanley | (366) |
| 1.081 | RELX Plc | Goldman Sachs | (176) | 2.985 | SIG Plc | Bank of America Merrill Lynch | (75) |
| (113) | Renalytix Plc | Goldman Sachs | 21 | 24.225 | SIG Plc | Goldman Sachs | (610) |
| (3.127) | Renewi Plc | Goldman Sachs | (1.614) | 727 | Sirius Real Estate Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 22 |
| 306 | Renishaw Plc | Morgan Stanley | 550 | (423) | Sirius Real Estate Ltd | Goldman Sachs | 17 |
| 452 | Rentokil Initial Plc | Goldman Sachs | (14) | (194) | Smith & Nephew Plc | Goldman Sachs | (11) |
| 2.536 | Rentokil Initial Plc | Morgan Stanley | 311 | (341) | Smith & Nephew Plc | Morgan Stanley | (45) |
| 31.477 | Restaurant Group Plc | Goldman Sachs | (476) | 819 | Smiths Group Plc | Goldman Sachs | 593 |
| 174 | RHI Magnesita NV | Bank of America Merrill Lynch | (61) | 76 | Smiths Group Plc | Morgan Stanley | 25 |
| 110 | RHI Magnesita NV | Goldman Sachs | (39) | 760 | Softcat Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.119 |
| (1.790) | Rightmove Plc | Morgan Stanley | (793) | (4.740) | Softcat Plc | Goldman Sachs | 878 |
| (477) | Rio Tinto Plc | Morgan Stanley | (1.489) | (28.617) | SolGold Plc | Bank of America Merrill Lynch | (236) |
| 11.785 | Rolls-Royce Holdings Plc | Goldman Sachs | 889 | 1.924 | SolGold Plc | Goldman Sachs | (1.423) |
| 9.028 | Rolls-Royce Holdings Plc | Morgan Stanley | 401 | 1.924 | Spectris Plc | Bank of America Merrill Lynch | 993 |
| (852) | Rotork Plc | Bank of America Merrill Lynch | (112) | 105 | Spectris Plc | Goldman Sachs | (16) |
| (1.853) | Rotork Plc | Goldman Sachs | (243) | 205 | Spectris Plc | Morgan Stanley | (21) |
| (8.773) | Royal Mail Plc | Bank of America Merrill Lynch | 2.209 | 391 | Spirax-Sarco Engineering Plc | Goldman Sachs | 435 |
| (6.413) | Royal Mail Plc | Goldman Sachs | 1.615 | 815 | Spirax-Sarco Engineering Plc | Morgan Stanley | 1.649 |
| (433) | Royal Mail Plc | Morgan Stanley | 93 | 2.583 | Spirent Communications Plc | Bank of America Merrill Lynch | 169 |
| 720 | RS GROUP Plc | Bank of America Merrill Lynch | 612 | 1.681 | Spirent Communications Plc | Goldman Sachs | 110 |
| 3.110 | RS GROUP Plc | Goldman Sachs | 2.643 | 104 | SSE Plc | Goldman Sachs | 21 |
| 2.281 | RS GROUP Plc | Morgan Stanley | 1.364 | 2.087 | SSE Plc | Morgan Stanley | (3.864) |
| 3.240 | RWS Holdings Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.640 | 3.644 | SSP Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.798 |
| 4.336 | RWS Holdings Plc | Goldman Sachs | 2.194 | 10.933 | SSP Group Plc | Goldman Sachs | 5.395 |
| (1.554) | Sabre Insurance Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 29 | 1.636 | SSP Group Plc | Morgan Stanley | 692 |
| (339) | Sabre Insurance Group Plc | Goldman Sachs | 6 | 1.810 | St James's Place Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.013 |
| 972 | Safestore Holdings Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 713 | 1.263 | St James's Place Plc | Goldman Sachs | 632 |
| 1.840 | Safestore Holdings Plc (REIT) | Goldman Sachs | 1.401 | 2.409 | St James's Place Plc | Morgan Stanley | 1.035 |
| (279) | Saga Plc | Bank of America Merrill Lynch | (20) | (2.745) | Standard Chartered Plc | Goldman Sachs | (1.368) |
| (139) | Saga Plc | Goldman Sachs | (10) | (5.925) | Standard Chartered Plc | Morgan Stanley | (1.880) |
| 717 | Sage Group Plc | Goldman Sachs | (39) | 901 | Standard Life Aberdeen Plc | Goldman Sachs | 82 |
| (334) | Savills Plc | Bank of America Merrill Lynch | (198) | 2.599 | Standard Life Aberdeen Plc | Morgan Stanley | 140 |
| (830) | Savills Plc | Goldman Sachs | (491) | 5.159 | SThree Plc | Goldman Sachs | 2.111 |
| 565 | Schroders Plc | Bank of America Merrill Lynch | 713 | | | | |
| 634 | Schroders Plc | Goldman Sachs | 575 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------|---|---------------------------------------|------------------------------|-------------------------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| (277) | Synthomer Plc | Bank of America Merrill Lynch | (83) | (10.136) | Victorian Plumbing Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (2.705) |
| (2.672) | Target Healthcare Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (114) | (109) | Victrex Plc | Bank of America Merrill Lynch | (19) |
| (3.136) | Target Healthcare Plc (REIT) | Goldman Sachs | (134) | (247) | Victrex Plc | Goldman Sachs | (73) |
| 5.261 | Tate & Lyle Plc | Bank of America Merrill Lynch | (2.322) | 12.203 | Virgin Money UK Plc | Bank of America Merrill Lynch | 320 |
| 5.393 | Tate & Lyle Plc | Goldman Sachs | (2.380) | 11.195 | Virgin Money UK Plc | Goldman Sachs | 262 |
| 5.982 | Tate & Lyle Plc | Morgan Stanley | (1.322) | 392 | Vistry Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 211 |
| 7.014 | Taylor Wimpey Plc | Goldman Sachs | 393 | 274 | Vistry Group Plc | Goldman Sachs | 382 |
| 1.110 | Taylor Wimpey Plc | Morgan Stanley | 28 | (44.397) | Vodafone Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (5.698) |
| (60) | TBC Bank Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (96) | (17.099) | Vodafone Group Plc | Goldman Sachs | (2.428) |
| (132) | TBC Bank Group Plc | Goldman Sachs | (280) | (73.706) | Vodafone Group Plc | Morgan Stanley | (3.932) |
| 213 | Team17 Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 156 | (302) | Volex Plc | Goldman Sachs | (137) |
| (17) | Telecom Plus Plc | Bank of America Merrill Lynch | (23) | (3.921) | Volution Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (2.419) |
| (31) | Telecom Plus Plc | Goldman Sachs | (41) | (1.828) | Volution Group Plc | Goldman Sachs | (1.116) |
| (1.680) | Tesco Plc | Bank of America Merrill Lynch | 334 | 2.093 | Watkin Jones Plc | Bank of America Merrill Lynch | (6) |
| (2.160) | Tesco Plc | Goldman Sachs | (97) | 644 | Watkin Jones Plc | Goldman Sachs | (2) |
| (2.230) | Tesco Plc | Morgan Stanley | 91 | 547 | Weir Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 654 |
| (4.389) | THG Plc | Morgan Stanley | (406) | 201 | Weir Group Plc | Goldman Sachs | 240 |
| (10.023) | TI Fluid Systems Plc | Bank of America Merrill Lynch | 959 | 1.012 | Weir Group Plc | Morgan Stanley | 745 |
| (5.786) | TI Fluid Systems Plc | Goldman Sachs | 554 | (2.461) | WH Smith Plc | Bank of America Merrill Lynch | (2.924) |
| 305 | TP ICAP Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 20 | (799) | WH Smith Plc | Goldman Sachs | (929) |
| 1.576 | TP ICAP Group Plc | Goldman Sachs | 105 | (726) | WH Smith Plc | Morgan Stanley | (516) |
| (1.637) | Trainline Plc | Bank of America Merrill Lynch | (598) | 672 | Whitbread Plc | Bank of America Merrill Lynch | 592 |
| (2.269) | Trainline Plc | Goldman Sachs | (828) | 1.888 | Whitbread Plc | Goldman Sachs | 1.642 |
| 1.740 | Travis Perkins Plc | Morgan Stanley | 843 | 2.679 | Whitbread Plc | Morgan Stanley | 1.585 |
| 16.849 | Tritax Big Box Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (212) | 4.094 | Wickes Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 608 |
| 16.263 | Tritax Big Box Plc (REIT) | Goldman Sachs | (186) | 3.887 | Wickes Group Plc | Goldman Sachs | 577 |
| 5.820 | Tritax Big Box Plc (REIT) | Morgan Stanley | (29) | (12.692) | Wise Plc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (6.439) |
| (5.935) | Trustpilot Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.076 | (3.819) | Wise Plc 'A' | Goldman Sachs | (1.938) |
| (5.665) | Trustpilot Group Plc | Goldman Sachs | 786 | (131) | Woodside Energy Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.373) |
| 824 | TUI AG | Bank of America Merrill Lynch | (474) | (185) | Woodside Energy Group Ltd | Goldman Sachs | (3.351) |
| 4.614 | TUI AG | Goldman Sachs | (2.655) | (113) | Woodside Energy Group Ltd | Morgan Stanley | (2.047) |
| 940 | TUI AG | Morgan Stanley | (39) | 2.808 | Workspace Group Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.558 |
| (4.370) | Tullow Oil Plc | Bank of America Merrill Lynch | (79) | 2.090 | Workspace Group Plc (REIT) | Goldman Sachs | 1.167 |
| (15.224) | Tullow Oil Plc | Goldman Sachs | (335) | (2.770) | WPP Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.670 |
| (1.644) | Tyman Plc | Bank of America Merrill Lynch | (450) | (2.436) | WPP Plc | Goldman Sachs | 798 |
| 18.856 | UK Commercial Property Ltd (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (525) | (2.550) | WPP Plc | Morgan Stanley | 1.477 |
| 27.801 | UK Commercial Property Ltd (REIT) | Goldman Sachs | (586) | (2.627) | Yellow Cake Plc | Bank of America Merrill Lynch | (352) |
| (275) | Unilever Plc | Bank of America Merrill Lynch | (947) | (392) | Yellow Cake Plc | Goldman Sachs | (7) |
| (1.715) | Unilever Plc | Goldman Sachs | (5.789) | 488 | YouGov Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.149 |
| (2.006) | Unilever Plc | Morgan Stanley | (5.935) | 464 | YouGov Plc | Goldman Sachs | 1.092 |
| (1.576) | UNITE Group Plc (REIT) | Morgan Stanley | (1.726) | (24) | Young & Co's Brewery Plc 'A' | Goldman Sachs | 18 |
| 1.381 | United Utilities Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.314) | | | | (106.180) |
| 2.534 | United Utilities Group Plc | Goldman Sachs | (2.220) | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 2.138 | United Utilities Group Plc | Morgan Stanley | (1.228) | (1.042) | 10X Genomics Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (4.524) |
| 2.956 | Vesuvius Plc | Bank of America Merrill Lynch | 948 | (581) | 10X Genomics Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.638) |
| 4.739 | Vesuvius Plc | Goldman Sachs | 1.416 | (617) | 10X Genomics Inc 'A' | Morgan Stanley | (3.334) |
| (1.340) | Victoria Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.383 | 131 | 1-800-Flowers.com Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (121) |
| (301) | Victoria Plc | Goldman Sachs | 311 | 2.036 | 1-800-Flowers.com Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.873) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|-----------------|---|---|--------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 2.062 | 1Life Healthcare Inc | Goldman Sachs | 1.113 | 458 | ACCO Brands Corp | Bank of America | |
| 13 | 1st Source Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 5 |
| | | Merrill Lynch | 29 | 6.284 | ACCO Brands Corp | Goldman Sachs | 63 |
| 51 | 1st Source Corp | Goldman Sachs | 113 | (278) | Accolade Inc | Bank of America | |
| (1.526) | 23andMe Holding Co 'A' | Goldman Sachs | (170) | (1.697) | Accolade Inc | Merrill Lynch | (81) |
| (970) | 2seventy bio Inc | Goldman Sachs | (281) | 192 | ACI Worldwide Inc | Goldman Sachs | (362) |
| 93 | 3D Systems Corp | Goldman Sachs | 86 | | | Bank of America | |
| (255) | 3M Co | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 124 |
| | | Merrill Lynch | 62 | 463 | ACI Worldwide Inc | Goldman Sachs | 369 |
| (130) | 3M Co | Goldman Sachs | (329) | 98 | Aclaris Therapeutics Inc | Bank of America | |
| (273) | 3M Co | Morgan Stanley | (448) | | | Merrill Lynch | 174 |
| (154) | 4D Molecular | Bank of America | | 230 | ACM Research Inc 'A' | Bank of America | |
| | Therapeutics Inc | Merrill Lynch | 117 | | | Merrill Lynch | 366 |
| (63) | 4D Molecular | | | 315 | ACM Research Inc 'A' | Goldman Sachs | 501 |
| | Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 48 | (309) | Acuity Brands Inc | Goldman Sachs | (2.361) |
| 991 | 8x8 Inc | Bank of America | (500) | (344) | Acuity Brands Inc | Morgan Stanley | (2.446) |
| | | Merrill Lynch | (114) | (420) | Acushnet Holdings Corp | Bank of America | |
| 225 | 8x8 Inc | Goldman Sachs | | | | Merrill Lynch | 389 |
| (594) | 908 Devices Inc | Bank of America | 222 | (499) | Acushnet Holdings Corp | Goldman Sachs | 463 |
| | | Merrill Lynch | 409 | (73) | ACV Auctions Inc 'A' | Bank of America | |
| (382) | 908 Devices Inc | Goldman Sachs | (31) | (288) | ACV Auctions Inc 'A' | Merrill Lynch | 1 |
| (37) | A O Smith Corp | Bank of America | (69) | (269) | AdaptHealth Corp | Goldman Sachs | 3 |
| (131) | A O Smith Corp | Merrill Lynch | (190) | (218) | AdaptHealth Corp | Bank of America | |
| (876) | A O Smith Corp | Goldman Sachs | 592 | 1.772 | Adaptive Biotechnologies Corp | Merrill Lynch | (72) |
| 883 | A10 Networks Inc | Morgan Stanley | | | | Goldman Sachs | (126) |
| | | Bank of America | | 220 | Addus HomeCare Corp | Bank of America | (213) |
| (115) | AAON Inc | Merrill Lynch | (160) | | | Merrill Lynch | 152 |
| | | Goldman Sachs | (239) | 164 | Addus HomeCare Corp | Goldman Sachs | 113 |
| (172) | AAON Inc | Goldman Sachs | (110) | 498 | Adient Plc | Bank of America | |
| (45) | AAR Corp | Goldman Sachs | 126 | | | Merrill Lynch | 1.828 |
| (107) | Aaron's Co Inc | Bank of America | 27 | 1.230 | Adient Plc | Goldman Sachs | 4.723 |
| | | Merrill Lynch | 20 | 1.134 | Adient Plc | Morgan Stanley | 2.869 |
| (23) | Aaron's Co Inc | Goldman Sachs | 507 | 105 | Adobe Inc | Bank of America | |
| 172 | Abbott Laboratories | Goldman Sachs | 20 | | | Merrill Lynch | 1.693 |
| 84 | Abbott Laboratories | Morgan Stanley | 1.885 | 125 | Adobe Inc | Goldman Sachs | 2.565 |
| (294) | AbbVie Inc | Goldman Sachs | 6 | 181 | Adobe Inc | Morgan Stanley | 1.864 |
| (13) | AbbVie Inc | Morgan Stanley | | 110 | ADT Inc | Bank of America | |
| (80) | AbCellera Biologics Inc | Bank of America | 6 | | | Merrill Lynch | 53 |
| | | Merrill Lynch | 47 | 74 | Adtalem Global | Bank of America | |
| (675) | AbCellera Biologics Inc | Goldman Sachs | (31) | | Education Inc | Merrill Lynch | 121 |
| (440) | AbCellera Biologics Inc | Morgan Stanley | | (85) | Advance Auto Parts Inc | Bank of America | |
| (258) | Abercrombie & Fitch Co 'A' | Bank of America | 3.117 | (277) | Advance Auto Parts Inc | Merrill Lynch | 1.956 |
| | | Merrill Lynch | 4.856 | (520) | Advanced Drainage Systems Inc | Morgan Stanley | (1.328) |
| (402) | Abercrombie & Fitch Co 'A' | Goldman Sachs | 770 | 23 | Advanced Energy Industries Inc | Goldman Sachs | (31) |
| 78 | ABIOMED Inc | Bank of America | 591 | 154 | Advanced Micro Devices Inc | Morgan Stanley | 978 |
| | | Merrill Lynch | 2.277 | (39) | AdvanSix Inc | Goldman Sachs | (5) |
| 93 | ABIOMED Inc | Goldman Sachs | (265) | 808 | Advantage Solutions Inc | Bank of America | |
| 213 | ABIOMED Inc | Morgan Stanley | 302 | | | Merrill Lynch | (20) |
| (93) | ABM Industries Inc | Goldman Sachs | (1.279) | 536 | Advantage Solutions Inc | Goldman Sachs | (13) |
| 110 | Academy Sports & Outdoors Inc | Bank of America | 29 | 147 | AECOM | Goldman Sachs | 492 |
| | | Merrill Lynch | (118) | 693 | AECOM | Morgan Stanley | 1.192 |
| 414 | Academy Sports & Outdoors Inc | Goldman Sachs | | (420) | AerCap Holdings NV | Bank of America | |
| | | Bank of America | 129 | | | Merrill Lynch | (1.166) |
| (50) | Acadia Healthcare Co Inc | Merrill Lynch | 134 | (438) | AerCap Holdings NV | Goldman Sachs | (1.069) |
| | | Goldman Sachs | 31 | (1.924) | AerCap Holdings NV | Morgan Stanley | (1.058) |
| (195) | Acadia Healthcare Co Inc | Bank of America | 28 | (141) | Aerie Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| 1.021 | ACADIA Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | 242 | | | Merrill Lynch | 211 |
| | | Goldman Sachs | 42 | 163 | AeroVironment Inc | Bank of America | |
| 889 | ACADIA Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 3.946 | | | Merrill Lynch | 2.389 |
| 779 | Acadia Realty Trust (REIT) | Bank of America | 2.020 | 145 | AeroVironment Inc | Goldman Sachs | 2.146 |
| | | Merrill Lynch | 639 | 604 | AES Corp | Morgan Stanley | 664 |
| 860 | Acadia Realty Trust (REIT) | Goldman Sachs | | (4.207) | Aeva Technologies Inc | Bank of America | |
| 1.513 | Accel Entertainment Inc | Goldman Sachs | | | | Merrill Lynch | 122 |
| (2.892) | Accelerate Diagnostics Inc | Goldman Sachs | | (2.230) | Aeva Technologies Inc | Goldman Sachs | 112 |
| 166 | Accenture Plc 'A' | Bank of America | | (2.508) | AEye Inc | Goldman Sachs | (602) |
| | | Merrill Lynch | | | | | |
| 100 | Accenture Plc 'A' | Goldman Sachs | | | | | |
| 33 | Accenture Plc 'A' | Morgan Stanley | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|----------------------------------|---|---|--|--|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 74 | Affiliated Managers Group Inc | Goldman Sachs | 696 | (105) | Albireo Pharma Inc | Goldman Sachs | 820 |
| (1.410) | Affirm Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (9.889) | 183 | Alcoa Corp | Bank of America Merrill Lynch | 818 |
| (1.128) | Affirm Holdings Inc | Goldman Sachs | (7.558) | 811 | Alcoa Corp | Goldman Sachs | 3.423 |
| (1.265) | Affirm Holdings Inc | Morgan Stanley | (7.155) | 552 | Alcoa Corp | Morgan Stanley | 834 |
| (190) | AGCO Corp | Bank of America Merrill Lynch | (923) | 489 | Alector Inc | Bank of America Merrill Lynch | 147 |
| (497) | AGCO Corp | Goldman Sachs | (2.415) | 220 | Alector Inc | Goldman Sachs | 81 |
| (677) | Agenus Inc | Bank of America Merrill Lynch | (78) | 196 | Alexander & Baldwin Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (145) |
| (4.586) | Agenus Inc | Goldman Sachs | (527) | 569 | Alexander & Baldwin Inc (REIT) | Goldman Sachs | (332) |
| 273 | Agilent Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.413 | (77) | Alexander's Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (830) |
| 975 | Agilent Technologies Inc | Goldman Sachs | 7.094 | (136) | Alexander's Inc (REIT) | Goldman Sachs | (1.466) |
| 795 | Agilent Technologies Inc | Morgan Stanley | 2.971 | 127 | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 505 |
| (256) | Agiliti Inc | Bank of America Merrill Lynch | (251) | 530 | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.579 |
| (83) | Agiliti Inc | Goldman Sachs | (81) | 318 | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.923 |
| (840) | agilon health Inc | Goldman Sachs | (403) | (596) | Alight Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 155 |
| (1.230) | agilon health Inc | Morgan Stanley | (590) | (973) | Alight Inc 'A' | Goldman Sachs | 10.464 |
| (71) | Agilysys Inc | Bank of America Merrill Lynch | (314) | 16 | Align Technology Inc | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch | (185) |
| (93) | Agilysys Inc | Goldman Sachs | (411) | 145 | Align Technology Inc | Goldman Sachs | 550 |
| 113 | Agios Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (272) | 83 | Align Technology Inc | Morgan Stanley | (84) |
| 50 | Agios Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (121) | 793 | Alignment Healthcare Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.427 |
| (716) | AGNC Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 14 | 340 | Alignment Healthcare Inc | Goldman Sachs | 612 |
| (7.011) | AGNC Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 140 | (1.390) | Alkami Technology Inc | Goldman Sachs | (5.143) |
| (720) | AGNC Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (194) | 64 | Alkermes Plc | Bank of America Merrill Lynch | 88 |
| (569) | Agree Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | (6) | 361 | Alkermes Plc | Goldman Sachs | 515 |
| (856) | Air Lease Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.438) | 1.178 | Alkermes Plc | Morgan Stanley | 1.178 |
| (103) | Air Lease Corp | Goldman Sachs | (173) | 216 | Allakos Inc | Bank of America Merrill Lynch | (69) |
| (201) | Air Products & Chemicals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.797) | (998) | Allegheny Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.493) |
| (85) | Air Products & Chemicals Inc | Goldman Sachs | (932) | (693) | Allegheny Technologies Inc | Goldman Sachs | (754) |
| (92) | Air Products & Chemicals Inc | Morgan Stanley | (936) | 21 | Allegiant Travel Co | Bank of America Merrill Lynch | 110 |
| (35) | Air Transport Services Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (22) | 39 | Allegiant Travel Co | Goldman Sachs | 204 |
| 26 | Airbnb Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (35) | (78) | Allegion Plc | Bank of America Merrill Lynch | 30 |
| 174 | Airbnb Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.385 | (30) | Allegion Plc | Morgan Stanley | (86) |
| 172 | Airbnb Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.045 | 114 | Allegro MicroSystems Inc | Bank of America Merrill Lynch | 182 |
| 328 | Akamai Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 528 | 176 | Allegro MicroSystems Inc | Goldman Sachs | 282 |
| (45) | Akero Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 24 | 285 | ALLETE Inc | Bank of America Merrill Lynch | 154 |
| 127 | Alarm.com Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 842 | 610 | ALLETE Inc | Goldman Sachs | 329 |
| 411 | Alarm.com Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.725 | (472) | Alliant Energy Corp | Morgan Stanley | (1.765) |
| 178 | Alaska Air Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 249 | 114 | Allison Transmission Holdings Inc | Goldman Sachs | 146 |
| 203 | Alaska Air Group Inc | Goldman Sachs | 528 | 1.496 | Allogene Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.309 |
| 985 | Alaska Air Group Inc | Morgan Stanley | 1.024 | 1.781 | Allogene Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.558 |
| (534) | Alaunos Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (33) | 883 | Allovir Inc | Bank of America Merrill Lynch | (636) |
| (137) | Albany International Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (368) | 628 | Allovir Inc | Goldman Sachs | (452) |
| (190) | Albany International Corp 'A' | Goldman Sachs | (343) | (795) | Allscripts Healthcare Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 684 |
| (11) | Albemarle Corp | Bank of America Merrill Lynch | (213) | (303) | Allscripts Healthcare Solutions Inc | Goldman Sachs | 261 |
| (120) | Albemarle Corp | Morgan Stanley | (2.003) | 39 | Allstate Corp | Bank of America Merrill Lynch | 237 |
| 1.078 | Albertsons Cos Inc | Goldman Sachs | 3.277 | 188 | Allstate Corp | Morgan Stanley | 1.693 |
| (124) | Albireo Pharma Inc | Bank of America Merrill Lynch | 968 | 208 | Ally Financial Inc | Morgan Stanley | 597 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 32 | Alnylam Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (83) | 162 | Ameresco Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.855 |
| 85 | Alnylam Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (407) | 170 | Ameresco Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.946 |
| 80 | Alnylam Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (444) | 917 | American Airlines Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.137 |
| (45) | Alpha & Omega Semiconductor Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (291) | 5.454 | American Airlines Group Inc | Goldman Sachs | 7.462 |
| (685) | Alpha & Omega Semiconductor Ltd | Goldman Sachs | (4.432) | 2.038 | American Airlines Group Inc | Morgan Stanley | 2.853 |
| 25 | Alpha Metallurgical Resources Inc | Goldman Sachs | 552 | 898 | American Assets Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 718 |
| 4 | Alphabet Inc 'A' | Goldman Sachs | 186 | 629 | American Assets Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 503 |
| 3 | Alphabet Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (155) | 1.109 | American Eagle Outfitters Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.487) |
| 1 | Alphabet Inc 'C' | Morgan Stanley | 61 | 2.437 | American Eagle Outfitters Inc | Goldman Sachs | (5.495) |
| 7 | Alphabet Inc 'C' | Bank of America Merrill Lynch | 186 | (547) | American Electric Power Co Inc | Morgan Stanley | (821) |
| 68 | Alphatec Holdings Inc | Morgan Stanley | 644 | 64 | American Express Co | Bank of America Merrill Lynch | 822 |
| 103 | Altair Engineering Inc 'A' | Goldman Sachs | (7) | 15 | American Express Co | Goldman Sachs | 193 |
| 38 | Altair Engineering Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 208 | 245 | American Express Co | Morgan Stanley | 2.506 |
| (126) | Alteryx Inc 'A' | Goldman Sachs | 77 | 153 | American Financial Group Inc | Goldman Sachs | 494 |
| (113) | Alteryx Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (319) | 36 | American Financial Group Inc | Morgan Stanley | 215 |
| (443) | Alteryx Inc 'A' | Goldman Sachs | (20) | 1.216 | American Homes 4 Rent 'A' (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 538 |
| 3.126 | Altime USA Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.532 | 1.436 | American Homes 4 Rent 'A' (REIT) | Goldman Sachs | 1.253 |
| 596 | Alto Ingredients Inc | Bank of America Merrill Lynch | (149) | 2.176 | American Homes 4 Rent 'A' (REIT) | Morgan Stanley | 1.458 |
| 946 | Alto Ingredients Inc | Goldman Sachs | (237) | (470) | American International Group Inc | Goldman Sachs | (858) |
| 535 | Altra Industrial Motion Corp | Bank of America Merrill Lynch | 760 | (1.361) | American Public Education Inc | Goldman Sachs | (857) |
| 500 | Altra Industrial Motion Corp | Goldman Sachs | 710 | 33 | American Software Inc 'A' | Goldman Sachs | 42 |
| 886 | Altria Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.306 | (41) | American States Water Co | Goldman Sachs | 27 |
| 1.497 | Altria Group Inc | Morgan Stanley | 1.976 | 338 | American Tower Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 6.900 |
| (21) | ALX Oncology Holdings Inc | Goldman Sachs | 40 | 42 | American Tower Corp (REIT) | Goldman Sachs | 1.151 |
| 169 | Amalgamated Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 142 | 398 | American Tower Corp (REIT) | Morgan Stanley | 3.335 |
| 188 | Amalgamated Financial Corp | Goldman Sachs | 158 | (84) | American Vanguard Corp | Goldman Sachs | (234) |
| (11) | A-Mark Precious Metals Inc | Goldman Sachs | (3) | 83 | American Water Works Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 196 |
| 37 | Amazon.com Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.733 | 364 | American Water Works Co Inc | Goldman Sachs | 955 |
| 11 | Amazon.com Inc | Goldman Sachs | 1.409 | 153 | American Water Works Co Inc | Morgan Stanley | 96 |
| 26 | Amazon.com Inc | Morgan Stanley | 4.924 | (803) | American Well Corp 'A' | Goldman Sachs | (494) |
| (2.052) | Ambac Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.735) | 567 | American Woodmark Corp | Goldman Sachs | 2.115 |
| 222 | Ambarella Inc | Goldman Sachs | 2.091 | (116) | America's Car-Mart Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.016) |
| 4 | Ambarella Inc | Morgan Stanley | 34 | (46) | America's Car-Mart Inc | Goldman Sachs | (1.089) |
| 481 | AMC Entertainment Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.561 | (2.783) | Americold Realty Trust Inc | Morgan Stanley | (6.083) |
| 2.091 | AMC Entertainment Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 5.918 | 43 | Ameriprise Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | 658 |
| (32) | AMC Networks Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (5) | 67 | Ameriprise Financial Inc | Goldman Sachs | 1.043 |
| (182) | AMC Networks Inc 'A' | Goldman Sachs | 247 | 66 | Ameriprise Financial Inc | Morgan Stanley | 890 |
| (4.861) | Ancor Plc | Morgan Stanley | (243) | 311 | AMERISAFE Inc | Bank of America Merrill Lynch | 591 |
| (653) | Amdocs Ltd | Morgan Stanley | (855) | 213 | AMERISAFE Inc | Goldman Sachs | 405 |
| 44 | Amedisys Inc | Bank of America Merrill Lynch | (396) | 360 | AmerisourceBergen Corp | Bank of America Merrill Lynch | 123 |
| 98 | Amedisys Inc | Goldman Sachs | (896) | 83 | AmerisourceBergen Corp | Goldman Sachs | 199 |
| 199 | Amedisys Inc | Morgan Stanley | (1.129) | 425 | AmerisourceBergen Corp | Morgan Stanley | 676 |
| (51) | Amerant Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (23) | (42) | AMETEK Inc | Goldman Sachs | (150) |
| (96) | Amerant Bancorp Inc | Goldman Sachs | (44) | (246) | AMETEK Inc | Morgan Stanley | (231) |
| (47) | AMERCO | Morgan Stanley | 1.053 | (147) | Amgen Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.097) |
| 148 | Ameren Corp | Bank of America Merrill Lynch | 181 | | | | |
| 182 | Ameren Corp | Goldman Sachs | 226 | | | | |
| 66 | Ameren Corp | Morgan Stanley | 26 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------------|-------------------------------|---|---|---|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (26) | Amgen Inc | Goldman Sachs | (11) | (180) | Apartment Income Corp (REIT) | Morgan Stanley | (150) |
| (9) | Amgen Inc | Morgan Stanley | (21) | | | | |
| 362 | Amicus Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 123 | 1.126 | Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT) | Goldman Sachs | 552 |
| 813 | Amicus Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 292 | (61) | Apellis Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (199) |
| (104) | Amkor Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (115) | (160) | Apellis Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 371 |
| (766) | Amkor Technology Inc | Goldman Sachs | (850) | 375 | Apergy Corp | Bank of America Merrill Lynch | 765 |
| (904) | Amkor Technology Inc | Morgan Stanley | (958) | 536 | Apergy Corp | Goldman Sachs | 1.093 |
| (4.305) | AMMO Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.626) | 532 | Apergy Corp | Morgan Stanley | 1.085 |
| 266 | AMN Healthcare Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | 910 | (601) | API Group Corp | Bank of America Merrill Lynch | (683) |
| 299 | AMN Healthcare Services Inc | Goldman Sachs | 1.023 | (2.747) | API Group Corp | Goldman Sachs | (3.152) |
| 203 | AMN Healthcare Services Inc | Morgan Stanley | 978 | (245) | Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT) | Morgan Stanley | (82) |
| 229 | Amneal Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 18 | (358) | Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT) | Goldman Sachs | (120) |
| 126 | Amneal Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 10 | (92) | Apollo Global Management Inc | Bank of America Merrill Lynch | (532) |
| 24 | Amphastar Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 99 | (1.297) | Apollo Global Management Inc | Goldman Sachs | (6.820) |
| (503) | Amphenol Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.135) | (1.436) | Apollo Global Management Inc | Morgan Stanley | (5.299) |
| (819) | Amphenol Corp 'A' | Morgan Stanley | (840) | (127) | Apollo Medical Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (344) |
| (1.615) | Amyris Inc | Goldman Sachs | (662) | (428) | Apollo Medical Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.160) |
| (104) | Analog Devices Inc | Bank of America Merrill Lynch | (78) | 10 | Appfolio Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 152 |
| (24) | Analog Devices Inc | Goldman Sachs | (98) | (119) | Appian Corp | Bank of America Merrill Lynch | (588) |
| (127) | Anavex Life Sciences Corp | Bank of America Merrill Lynch | (49) | (109) | Appian Corp | Goldman Sachs | 585 |
| (812) | Anavex Life Sciences Corp | Goldman Sachs | (665) | (224) | Appian Corp | Morgan Stanley | (56) |
| 96 | Andersons Inc | Bank of America Merrill Lynch | 139 | (691) | Apple Hospitality Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (228) |
| 22 | Andersons Inc | Goldman Sachs | 22 | (908) | Apple Hospitality Inc (REIT) | Goldman Sachs | (300) |
| 98 | ANGI Homeservices Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 74 | 158 | Apple Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.684 |
| 50 | AngioDynamics Inc | Goldman Sachs | 39 | (78) | Applied Industrial Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 93 |
| 30 | ANI Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 38 | (247) | Applied Industrial Technologies Inc | Goldman Sachs | 886 |
| 23 | Anika Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 15 | 488 | Applied Materials Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.800 |
| 66 | Anika Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (15) | 381 | Applied Materials Inc | Morgan Stanley | 2.703 |
| (616) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | Goldman Sachs | 37 | 137 | Applied Molecular Transport Inc | Goldman Sachs | (97) |
| (6.781) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | Morgan Stanley | (1.288) | (175) | Applied Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 26 |
| (477) | Annexon Inc | Goldman Sachs | (8) | (607) | AppLovin Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (701) |
| 354 | ANSYS Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.452 | (1.495) | AppLovin Corp 'A' | Goldman Sachs | (2.965) |
| 69 | ANSYS Inc | Goldman Sachs | 228 | (2.262) | AppLovin Corp 'A' | Morgan Stanley | (2.991) |
| 69 | ANSYS Inc | Morgan Stanley | 159 | 76 | AptarGroup Inc | Bank of America Merrill Lynch | 163 |
| (18) | Anterix Inc | Bank of America Merrill Lynch | 140 | 200 | AptarGroup Inc | Morgan Stanley | 620 |
| 1.467 | Antero Midstream Corp | Bank of America Merrill Lynch | 954 | 209 | Aptiv Plc | Goldman Sachs | 1.722 |
| 2.975 | Antero Midstream Corp | Goldman Sachs | 1.934 | 260 | Aptiv Plc | Morgan Stanley | 2.434 |
| 3.298 | Antero Midstream Corp | Morgan Stanley | 1.979 | (92) | Aramark | Bank of America Merrill Lynch | (1) |
| (634) | Antero Resources Corp | Morgan Stanley | (3.309) | (531) | Aramark | Morgan Stanley | (871) |
| (6) | Anthem Inc | Bank of America Merrill Lynch | (142) | 1.866 | Arbor Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (1.120) |
| (41) | Anthem Inc | Goldman Sachs | (971) | 7 | ArcBest Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2 |
| (5) | Anthem Inc | Morgan Stanley | (85) | 241 | Arch Capital Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 227 |
| (45) | Aon Plc 'A' | Morgan Stanley | (414) | 341 | Arch Capital Group Ltd | Goldman Sachs | 321 |
| 1.612 | APA Corp | Goldman Sachs | 11.250 | (899) | Archer-Daniels-Midland Co | Bank of America Merrill Lynch | (3.862) |
| 1.005 | APA Corp | Morgan Stanley | 5.126 | (3.202) | Archer-Daniels-Midland Co | Morgan Stanley | (10.375) |
| (457) | Apartment Income Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (674) | | | | |
| (193) | Apartment Income Corp (REIT) | Goldman Sachs | (403) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 90 | Archrock Inc | Bank of America Merrill Lynch | 98 | (169) | Ashland Global Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.286) |
| 68 | Arconic Rolled Products Corp | Bank of America Merrill Lynch | 52 | (81) | Ashland Global Holdings Inc | Morgan Stanley | (460) |
| 97 | Arconic Rolled Products Corp | Goldman Sachs | 74 | 197 | Aspen Aerogels Inc | Goldman Sachs | 234 |
| 78 | Arcosa Inc | Bank of America Merrill Lynch | 109 | (38) | Aspen Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (210) |
| 45 | Arcosa Inc | Goldman Sachs | 63 | (88) | Aspen Technology Inc | Goldman Sachs | (452) |
| (229) | Arcturus Therapeutics Holdings Inc | Goldman Sachs | (655) | (42) | Aspen Technology Inc | Morgan Stanley | (179) |
| (371) | Arcus Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | 297 | 26 | Assetmark Financial Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 36 |
| (103) | Arcus Biosciences Inc | Goldman Sachs | 82 | 2.290 | AssetMark Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.160 |
| (79) | Arcutis Biotherapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (208) | 869 | Associated Banc-Corp | Bank of America Merrill Lynch | 858 |
| (85) | Ares Commercial Real Estate Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (35) | 1.461 | Associated Banc-Corp | Goldman Sachs | 1.461 |
| (176) | Ares Commercial Real Estate Corp (REIT) | Goldman Sachs | 92 | (153) | Assurant Inc | Goldman Sachs | 223 |
| (63) | Ares Management Corp 'A' | Goldman Sachs | (276) | (478) | Assurant Inc | Morgan Stanley | (253) |
| 69 | Argan Inc | Bank of America Merrill Lynch | 258 | 345 | Astec Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 621 |
| 42 | Argan Inc | Goldman Sachs | 157 | 527 | Astec Industries Inc | Goldman Sachs | 949 |
| 122 | Argo Group International Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 21 | (623) | Astra Space Inc | Goldman Sachs | (39) |
| 275 | Argo Group International Holdings Ltd | Goldman Sachs | 44 | (981) | AT&T Inc | Morgan Stanley | (466) |
| 1.832 | Armada Hoffer Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.191 | (1.217) | Atara Biotherapeutics Inc | Goldman Sachs | 231 |
| 1.672 | Armada Hoffer Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.087 | (642) | Atea Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (433) |
| (204) | ARMOUR Residential Inc (REIT) | Goldman Sachs | 4 | (1.117) | Atea Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (590) |
| (835) | Armstrong World Industries Inc | Morgan Stanley | (225) | (143) | Atkore Inc | Goldman Sachs | (163) |
| (713) | Array Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.500) | (142) | Atkore Inc | Morgan Stanley | (599) |
| (1.097) | Array Technologies Inc | Goldman Sachs | (3.904) | (114) | Atlantic Union Bankshares Corp | Bank of America Merrill Lynch | (81) |
| (112) | Arrow Electronics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (322) | 455 | Atlantica Sustainable Infrastructure Plc | Bank of America Merrill Lynch | 2 |
| (212) | Arrow Electronics Inc | Morgan Stanley | (284) | 244 | Atlantica Sustainable Infrastructure Plc | Goldman Sachs | (111) |
| 44 | Arrow Financial Corp | Goldman Sachs | 55 | 2.010 | Atlantica Sustainable Infrastructure Plc | Morgan Stanley | 342 |
| (472) | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 991 | (18) | Atlantius Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (114) |
| (63) | Arthur J Gallagher & Co | Bank of America Merrill Lynch | (116) | (108) | Atlas Air Worldwide Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 89 |
| (276) | Arthur J Gallagher & Co | Goldman Sachs | (509) | (28) | Atlas Air Worldwide Holdings Inc | Goldman Sachs | 16 |
| (170) | Arthur J Gallagher & Co | Morgan Stanley | (757) | 133 | Atlas Corp Marshall Islands | Bank of America Merrill Lynch | 48 |
| 428 | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.537 | 36 | Atlas Corp Marshall Islands | Goldman Sachs | 13 |
| 249 | Artivion Inc | Bank of America Merrill Lynch | 466 | 149 | Atlassian Corp Plc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 640 |
| 391 | Artivion Inc | Goldman Sachs | 731 | 118 | Atlassian Corp Plc 'A' | Morgan Stanley | 404 |
| 85 | Arvinas Inc | Bank of America Merrill Lynch | (73) | 393 | Atmos Energy Corp | Morgan Stanley | 884 |
| 86 | Arvinas Inc | Goldman Sachs | (74) | 17 | ATN International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 49 |
| (1.111) | Asana Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (199) | 66 | AtriCure Inc | Bank of America Merrill Lynch | (16) |
| (921) | Asana Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.605) | 34 | AtriCure Inc | Goldman Sachs | (24) |
| (130) | Asana Inc 'A' | Morgan Stanley | (52) | 277 | Audacy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 26 |
| 65 | Asbury Automotive Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (267) | 327 | Audacy Inc | Goldman Sachs | (43) |
| 33 | Asbury Automotive Group Inc | Goldman Sachs | (135) | (319) | Aurinia Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (185) |
| 189 | Asbury Automotive Group Inc | Morgan Stanley | 2.952 | 235 | Autodesk Inc | Morgan Stanley | 5.330 |
| 102 | ASGN Inc | Bank of America Merrill Lynch | (818) | 99 | Autoliv Inc | Morgan Stanley | 134 |
| 920 | ASGN Inc | Morgan Stanley | (4.002) | (210) | Automatic Data Processing Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.776) |
| | | | | (42) | Automatic Data Processing Inc | Goldman Sachs | (565) |
| | | | | (51) | Automatic Data Processing Inc | Morgan Stanley | (534) |
| | | | | 304 | AutoNation Inc | Bank of America Merrill Lynch | (308) |
| | | | | (99) | Avalara Inc | Morgan Stanley | (378) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|-------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 163 | AvalonBay Communities Inc (REIT) | Goldman Sachs | 632 | (34) | Balchem Corp | Bank of America Merrill Lynch | (231) |
| 458 | AvalonBay Communities Inc (REIT) | Morgan Stanley | 2.079 | (105) | Balchem Corp | Goldman Sachs | (694) |
| (490) | Avangrid Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.259) | (108) | Ball Corp | Morgan Stanley | (60) |
| 58 | Avanos Medical Inc | Goldman Sachs | 72 | (336) | Bally's Corp | Bank of America Merrill Lynch | (330) |
| (383) | Avantor Inc | Goldman Sachs | (284) | 406 | Banc of California Inc | Bank of America Merrill Lynch | 430 |
| 1.492 | Avaya Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.064) | 1.049 | Banc of California Inc | Goldman Sachs | 1.112 |
| 1.914 | Avaya Holdings Corp | Goldman Sachs | (3.624) | (368) | BancFirst Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.948) |
| (740) | AvePoint Inc | Goldman Sachs | (250) | (176) | BancFirst Corp | Goldman Sachs | (1.410) |
| (133) | Avery Dennison Corp | Bank of America Merrill Lynch | (780) | 656 | Bandwidth Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 2.749 |
| (386) | Avery Dennison Corp | Goldman Sachs | (20) | 606 | Bandwidth Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.539 |
| (302) | Avery Dennison Corp | Morgan Stanley | (1.267) | 93 | Bank of America Corp | Goldman Sachs | 171 |
| 93 | Avid Bioservices Inc | Bank of America Merrill Lynch | 166 | 894 | Bank of America Corp | Morgan Stanley | 1.180 |
| 291 | Avid Bioservices Inc | Goldman Sachs | 518 | 193 | Bank of Hawaii Corp | Bank of America Merrill Lynch | 611 |
| (270) | Avid Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.220) | 73 | Bank of Hawaii Corp | Goldman Sachs | 179 |
| (123) | Avid Technology Inc | Goldman Sachs | (556) | (16) | Bank of Marin Bancorp | Goldman Sachs | (38) |
| (43) | Avidity Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | (27) | 80 | Bank of New York Mellon Corp | Goldman Sachs | 230 |
| 119 | Avient Corp | Bank of America Merrill Lynch | 296 | 2.179 | Bank of New York Mellon Corp | Morgan Stanley | 3.138 |
| 128 | Avient Corp | Goldman Sachs | 319 | (321) | Bank OZK | Morgan Stanley | (690) |
| (8) | Avis Budget Group Inc | Goldman Sachs | 64 | (545) | Banner Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.393) |
| (160) | Avis Budget Group Inc | Morgan Stanley | (2.382) | 235 | Bar Harbor Bankshares | Bank of America Merrill Lynch | 402 |
| 250 | Avista Corp | Bank of America Merrill Lynch | 23 | 88 | Bar Harbor Bankshares | Goldman Sachs | 150 |
| 541 | Avnet Inc | Morgan Stanley | 855 | (6.422) | BARK Inc | Goldman Sachs | (771) |
| 1.080 | Axalta Coating Systems Ltd | Goldman Sachs | 1.706 | 341 | Barnes Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 576 |
| 78 | Axcelis Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 406 | 117 | Barnes Group Inc | Goldman Sachs | 192 |
| 107 | Axcelis Technologies Inc | Goldman Sachs | 556 | 112 | Barrett Business Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | 121 |
| 721 | Axis Capital Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.562 | 153 | Barrett Business Services Inc | Goldman Sachs | 165 |
| 830 | Axis Capital Holdings Ltd | Goldman Sachs | 1.139 | 175 | Baxter International Inc | Goldman Sachs | 340 |
| 167 | Axis Capital Holdings Ltd | Morgan Stanley | 3 | 30 | Baxter International Inc | Morgan Stanley | 64 |
| (174) | Axogen Inc | Goldman Sachs | (4) | (362) | Beachbody Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (384) |
| 214 | Axon Enterprise Inc | Bank of America Merrill Lynch | 914 | (161) | Beacon Roofing Supply Inc | Bank of America Merrill Lynch | 188 |
| 25 | Axon Enterprise Inc | Goldman Sachs | 107 | (852) | Beacon Roofing Supply Inc | Goldman Sachs | 997 |
| 155 | Axon Enterprise Inc | Morgan Stanley | 770 | (794) | Beam Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.739) |
| (83) | Axonics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (263) | (183) | Beam Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (631) |
| (179) | Axonics Inc | Goldman Sachs | (567) | (929) | Beauty Health Co | Bank of America Merrill Lynch | (2.309) |
| 244 | Axos Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | 646 | (1.891) | Beauty Health Co | Goldman Sachs | (4.651) |
| 518 | Axos Financial Inc | Goldman Sachs | 1.440 | 224 | Becton Dickinson and Co | Bank of America Merrill Lynch | (444) |
| (624) | AZEK Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.622) | 269 | Becton Dickinson and Co | Goldman Sachs | 423 |
| (293) | AZEK Co Inc | Goldman Sachs | (762) | 129 | Becton Dickinson and Co | Morgan Stanley | (520) |
| (1.990) | AZEK Co Inc | Morgan Stanley | (3.025) | (310) | Belden Inc | Bank of America Merrill Lynch | (558) |
| (328) | Azenta Inc | Morgan Stanley | (1.627) | (303) | Belden Inc | Goldman Sachs | (506) |
| 60 | AZZ Inc | Bank of America Merrill Lynch | 79 | (232) | Bellring Distribution LLC | Bank of America Merrill Lynch | (302) |
| 69 | AZZ Inc | Goldman Sachs | 90 | (148) | Bellring Distribution LLC | Goldman Sachs | (192) |
| (338) | B Riley Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.649) | 49 | Benchmark Electronics Inc | Goldman Sachs | 48 |
| (812) | B Riley Financial Inc | Goldman Sachs | (3.963) | 54 | Benefitfocus Inc | Goldman Sachs | 8 |
| 108 | B&G Foods Inc | Bank of America Merrill Lynch | (60) | (58) | Bentley Systems Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (151) |
| 177 | B&G Foods Inc | Goldman Sachs | (174) | (429) | Bentley Systems Inc 'B' | Goldman Sachs | (1.138) |
| 132 | Badger Meter Inc | Bank of America Merrill Lynch | 30 | (1.596) | Berkshire Grey Inc | Bank of America Merrill Lynch | (311) |
| 217 | Badger Meter Inc | Goldman Sachs | 50 | | | | |
| (281) | Baker Hughes Co | Morgan Stanley | (433) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|--|---|---|--|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (203) | Berkshire Grey Inc | Goldman Sachs | (40) | 99 | Blackbaud Inc | Goldman Sachs | 529 |
| (23) | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (200) | 109 | Blackline Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.268 |
| (304) | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Goldman Sachs | (2.571) | 78 | Blackline Inc | Goldman Sachs | 485 |
| (106) | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Morgan Stanley | (589) | 694 | Blackline Inc | Morgan Stanley | 1.112 |
| (219) | Berkshire Hills Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (153) | (2.638) | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.710) |
| (34) | Berkshire Hills Bancorp Inc | Goldman Sachs | (24) | (593) | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (369) |
| 285 | Berry Corp | Bank of America Merrill Lynch | 462 | 549 | Bloom Energy Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 2.212 |
| 595 | Berry Corp | Goldman Sachs | 964 | 592 | Bloom Energy Corp 'A' | Goldman Sachs | 2.386 |
| (58) | Berry Global Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (202) | (48) | Bloomin' Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | (79) |
| (826) | Berry Global Group Inc | Goldman Sachs | (1.890) | (337) | Bloomin' Brands Inc | Goldman Sachs | (128) |
| (1.364) | Berry Global Group Inc | Morgan Stanley | (2.338) | (887) | Blucora Inc | Goldman Sachs | (1.118) |
| (29) | Best Buy Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3) | (632) | Blue Bird Corp | Goldman Sachs | (196) |
| (158) | Best Buy Co Inc | Goldman Sachs | (109) | (2.204) | Blue Owl Capital Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.799) |
| (118) | Best Buy Co Inc | Morgan Stanley | (849) | (2.293) | Blue Owl Capital Inc | Goldman Sachs | (2.912) |
| 199 | BGC Partners Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 33 | (5.944) | Blue Owl Capital Inc | Morgan Stanley | (3.685) |
| 883 | BGC Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | 116 | (1.058) | Bluebird Bio Inc | Bank of America Merrill Lynch | 116 |
| 49 | Big Lots Inc | Bank of America Merrill Lynch | (250) | (1.389) | Bluebird Bio Inc | Goldman Sachs | 153 |
| 180 | Big Lots Inc | Goldman Sachs | (1.289) | 57 | Blueprint Medicines Corp | Bank of America Merrill Lynch | (64) |
| (1.749) | BigCommerce Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.447) | 393 | Blueprint Medicines Corp | Goldman Sachs | (440) |
| (46) | Bill.com Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (532) | 344 | Blueprint Medicines Corp | Morgan Stanley | (626) |
| (32) | Bill.com Holdings Inc | Goldman Sachs | (370) | 239 | Boeing Co | Bank of America Merrill Lynch | 1.986 |
| (174) | Bill.com Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.096) | 821 | Boeing Co | Goldman Sachs | 6.500 |
| (343) | BioAtla Inc | Bank of America Merrill Lynch | (38) | 873 | Boeing Co | Morgan Stanley | 5.264 |
| (335) | BioCryst Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (345) | (553) | Boise Cascade Co | Goldman Sachs | 304 |
| (343) | BioCryst Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (353) | 49 | BOK Financial Corp | Goldman Sachs | 196 |
| 43 | Biogen Inc | Bank of America Merrill Lynch | 166 | 12 | Booking Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.124 |
| 144 | Biogen Inc | Goldman Sachs | 563 | 27 | Booking Holdings Inc | Morgan Stanley | 3.001 |
| 42 | Biogen Inc | Morgan Stanley | 119 | 30 | Boot Barn Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (410) |
| 67 | BioLife Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 100 | 251 | Boot Barn Holdings Inc | Goldman Sachs | (3.434) |
| 48 | BioMarin Pharmaceutical Inc | Bank of America Merrill Lynch | (23) | 274 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.932 |
| 72 | BioMarin Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs | (34) | 386 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Goldman Sachs | 1.525 |
| 462 | BioMarin Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs | (34) | 1.922 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Morgan Stanley | 7.604 |
| (7.638) | Bionano Genomics Inc | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch | (1.622) (993) (874) | 310 | BorgWarner Inc | Goldman Sachs | 682 |
| (6.261) | Bionano Genomics Inc | Goldman Sachs | (874) | 1.491 | BorgWarner Inc | Morgan Stanley | 2.162 |
| 20 | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 399 | 13 | Boston Beer Co Inc 'A' | Goldman Sachs | (37) |
| (31) | Bio-Techne Corp | Goldman Sachs | (440) | 56 | Boston Beer Co Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.168 |
| (125) | Bio-Techne Corp | Morgan Stanley | (1.478) | (48) | Boston Omaha Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (99) |
| (99) | Bioxcel Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (24) | (211) | Boston Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 58 |
| (245) | Bioxcel Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (59) | 694 | Boston Scientific Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.135 |
| 894 | BJ's Restaurants Inc | Goldman Sachs | 1.716 | 2.675 | Boston Scientific Corp | Goldman Sachs | 3.034 |
| 263 | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.815) | 1.664 | Boston Scientific Corp | Morgan Stanley | 1.867 |
| 50 | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | Morgan Stanley | 143 | 272 | Box Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (432) |
| 253 | Black Hills Corp | Bank of America Merrill Lynch | (20) | 178 | Box Inc 'A' | Goldman Sachs | (38) |
| 449 | Black Hills Corp | Goldman Sachs | 234 | 334 | Box Inc 'A' | Morgan Stanley | 197 |
| 526 | Black Hills Corp | Morgan Stanley | 851 | (55) | Boyd Gaming Corp | Bank of America Merrill Lynch | (200) |
| 104 | Blackbaud Inc | Bank of America Merrill Lynch | 555 | (416) | Boyd Gaming Corp | Morgan Stanley | (1.656) |
| | | | | (198) | Brady Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (770) |
| | | | | (203) | Brady Corp 'A' | Goldman Sachs | (776) |
| | | | | 190 | Brandywine Realty Trust (REIT) | Goldman Sachs | 55 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 408 | Bread Financial Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.819 | 838 | Bruker Corp | Morgan Stanley | 1.567 |
| 560 | Bread Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.456 | (248) | Brunswick Corp | Bank of America Merrill Lynch | 848 |
| 751 | Bridgebio Pharma Inc | Bank of America Merrill Lynch | 225 | (637) | Brunswick Corp | Goldman Sachs | 2.179 |
| 818 | Bridgebio Pharma Inc | Goldman Sachs | 245 | (1.090) | Brunswick Corp | Morgan Stanley | (3.870) |
| 624 | Brigham Minerals Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.884 | (700) | BTRS Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (260) |
| (88) | Bright Horizons Family Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (957) | (103) | BTRS Holdings Inc | Goldman Sachs | (19) |
| (216) | Bright Horizons Family Solutions Inc | Goldman Sachs | (2.350) | (216) | Buckle Inc | Bank of America Merrill Lynch | 69 |
| (179) | Brightcove Inc | Bank of America Merrill Lynch | (27) | (220) | Buckle Inc | Goldman Sachs | 70 |
| (3.394) | Brightcove Inc | Goldman Sachs | (509) | 38 | Builders FirstSource Inc | Goldman Sachs | (37) |
| 454 | Brighthouse Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.153 | 331 | Builders FirstSource Inc | Morgan Stanley | 983 |
| 2.184 | Brighthouse Financial Inc | Goldman Sachs | 6.038 | (172) | Bumble Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (247) |
| 443 | Brighthouse Financial Inc | Morgan Stanley | 1.152 | (667) | Bumble Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.501) |
| 331 | BrightSphere Investment Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 182 | (2.026) | Bumble Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.054) |
| 126 | BrightSphere Investment Group Inc | Goldman Sachs | 69 | (381) | Bunge Ltd | Morgan Stanley | (1.440) |
| (481) | BrightSpire Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | (173) | 95 | Burlington Stores Inc | Morgan Stanley | 860 |
| (60) | BrightView Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (50) | (8.887) | Butterfly Network Inc | Goldman Sachs | (654) |
| (592) | Brinker International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.042 | 134 | BWX Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 225 |
| (800) | Brinker International Inc | Goldman Sachs | 1.408 | 201 | BWX Technologies Inc | Morgan Stanley | 285 |
| (274) | Brink's Co | Bank of America Merrill Lynch | (1.027) | 222 | Byline Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 406 |
| (331) | Brink's Co | Goldman Sachs | (881) | 500 | Byline Bancorp Inc | Goldman Sachs | 915 |
| (794) | Bristow Group Inc | Goldman Sachs | (2.064) | (905) | C3.ai Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.829) |
| 590 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 277 | (87) | C4 Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (44) |
| 1.166 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | Goldman Sachs | 548 | (12) | Cable One Inc | Morgan Stanley | (826) |
| 1.300 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | Morgan Stanley | 2.379 | (337) | Cabot Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.523) |
| (33) | Broadcom Inc | Bank of America Merrill Lynch | 112 | (307) | Cabot Corp | Goldman Sachs | (2.314) |
| (114) | Broadcom Inc | Morgan Stanley | (6.034) | 38 | CACI International Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 541 |
| (1.039) | Broadmark Realty Capital Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 21 | 337 | CACI International Inc 'A' | Goldman Sachs | 5.716 |
| (4.046) | Broadmark Realty Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | 81 | 66 | CACI International Inc 'A' | Morgan Stanley | 936 |
| (124) | Broadridge Financial Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (812) | (375) | Cactus Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.188) |
| (261) | Broadridge Financial Solutions Inc | Goldman Sachs | (1.710) | (380) | Cactus Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.228) |
| (68) | Broadridge Financial Solutions Inc | Morgan Stanley | (348) | (134) | Cadence Bank | Goldman Sachs | (229) |
| (1.573) | Broadstone Net Lease Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (840) | (919) | Cadence Bank | Morgan Stanley | (818) |
| 942 | Brookdale Senior Living Inc | Bank of America Merrill Lynch | 166 | (90) | Cadence Design Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.238) |
| 395 | Brookdale Senior Living Inc | Goldman Sachs | 84 | (113) | Cadence Design Systems Inc | Goldman Sachs | (1.554) |
| (515) | Brown & Brown Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.184) | (162) | Cadence Design Systems Inc | Morgan Stanley | (891) |
| (1.474) | Brown & Brown Inc | Goldman Sachs | (3.738) | (141) | Caesars Entertainment Inc | Goldman Sachs | 199 |
| (343) | Brown & Brown Inc | Morgan Stanley | (991) | (850) | Caesars Entertainment Inc | Morgan Stanley | (1.981) |
| 536 | Brown-Forman Corp 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 683 | 21 | Caesarstone Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (5) |
| 537 | Brown-Forman Corp 'B' | Goldman Sachs | 619 | 2.788 | Caesarstone Ltd | Goldman Sachs | (669) |
| 737 | Brown-Forman Corp 'B' | Morgan Stanley | 1.732 | 189 | Calavo Growers Inc | Bank of America Merrill Lynch | 141 |
| (211) | BRP Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (572) | 244 | Calavo Growers Inc | Goldman Sachs | 276 |
| 84 | Bruker Corp | Bank of America Merrill Lynch | 250 | (292) | Caleres Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.416) |
| | | | | (71) | Caleres Inc | Goldman Sachs | (288) |
| | | | | (85) | California Resources Corp | Bank of America Merrill Lynch | (137) |
| | | | | (369) | California Resources Corp | Goldman Sachs | (1.064) |
| | | | | 53 | California Water Service Group | Bank of America Merrill Lynch | (38) |
| | | | | 50 | California Water Service Group | Goldman Sachs | (28) |
| | | | | 263 | Calix Inc | Bank of America Merrill Lynch | 736 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 496 | Calix Inc | Goldman Sachs | 1.592 | (24) | CarMax Inc | Bank of America | |
| (3.393) | Callaway Golf Co | Bank of America | | (46) | CarMax Inc | Merrill Lynch | (182) |
| | | Merrill Lynch | (2.626) | (204) | CarMax Inc | Goldman Sachs | (107) |
| (793) | Callaway Golf Co | Goldman Sachs | (95) | 7.215 | Carnival Corp | Morgan Stanley | (1.430) |
| (2.478) | Callaway Golf Co | Morgan Stanley | (4.138) | 2.128 | Carnival Corp | Bank of America | |
| (48) | Callon Petroleum Co | Goldman Sachs | (219) | 8.557 | Carnival Corp | Merrill Lynch | 5.761 |
| 402 | Cal-Maine Foods Inc | Bank of America | | (252) | Carpenter Technology Corp | Goldman Sachs | 32 |
| | | Merrill Lynch | 226 | (1.230) | Carpenter Technology Corp | Morgan Stanley | 10.335 |
| 355 | Cal-Maine Foods Inc | Goldman Sachs | 528 | 30 | Carriage Services Inc | Bank of America | |
| 34 | Cambium Networks Corp | Goldman Sachs | 32 | 92 | Carriage Services Inc | Merrill Lynch | 11 |
| 156 | Camden National Corp | Bank of America | | 551 | Carrier Global Corp | Goldman Sachs | 34 |
| | | Merrill Lynch | 318 | | Carrier Global Corp | Bank of America | |
| 77 | Camden National Corp | Goldman Sachs | 157 | 154 | Carrier Global Corp | Merrill Lynch | 281 |
| 84 | Camden Property Trust (REIT) | Goldman Sachs | (40) | 556 | Carrier Global Corp | Goldman Sachs | (49) |
| 643 | Camden Property Trust (REIT) | Morgan Stanley | 1.858 | (1.331) | Cars.com Inc | Morgan Stanley | 497 |
| 1.000 | Campbell Soup Co | Bank of America | | 32 | Carter's Inc | Goldman Sachs | (253) |
| | | Merrill Lynch | (1.186) | | Carter's Inc | Bank of America | |
| 665 | Campbell Soup Co | Goldman Sachs | 591 | 362 | Carter's Inc | Merrill Lynch | (31) |
| 2.035 | Campbell Soup Co | Morgan Stanley | 2.035 | (584) | Carvana Co | Goldman Sachs | (1.261) |
| 834 | Canada Goose Holdings Inc | Bank of America | | | Carvana Co | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 133 | (3.137) | Carvana Co | Merrill Lynch | (285) |
| 1.081 | Canada Goose Holdings Inc | Goldman Sachs | 173 | (469) | Carvana Co | Goldman Sachs | 6.430 |
| 217 | Canada Goose Holdings Inc | Morgan Stanley | 169 | (93) | Casa Systems Inc | Morgan Stanley | (614) |
| (29) | Canadian Solar Inc | Bank of America | | | Casella Waste Systems Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (217) | (13) | Casella Waste Systems Inc 'A' | Merrill Lynch | (41) |
| (295) | Canadian Solar Inc | Goldman Sachs | (2.204) | (114) | Casey's General Stores Inc | Goldman Sachs | (30) |
| (559) | Canadian Solar Inc | Morgan Stanley | (1.431) | | Casey's General Stores Inc | Bank of America | |
| 241 | Cannae Holdings Inc | Bank of America | | (22) | Casey's General Stores Inc | Merrill Lynch | (43) |
| | | Merrill Lynch | 482 | (108) | Casey's General Stores Inc | Goldman Sachs | 70 |
| 854 | Cannae Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.708 | (23) | Castle Biosciences Inc | Morgan Stanley | (731) |
| (352) | Cano Health Inc | Bank of America | | | Castle Biosciences Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 25 | (24) | Catalent Inc | Merrill Lynch | (63) |
| (194) | Cano Health Inc | Goldman Sachs | 28 | 1.066 | Catalyst | Goldman Sachs | (60) |
| (1.977) | Canoo Inc | Bank of America | | | Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (148) | 1.301 | Catalyst | Merrill Lynch | 174 |
| 1.800 | Capital City Bank Group Inc | Goldman Sachs | 1.296 | | Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 192 |
| 294 | Capital One Financial Corp | Bank of America | | (1.103) | CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 3.878 | (316) | Caterpillar Inc | Goldman Sachs | (4.611) |
| 204 | Capital One Financial Corp | Morgan Stanley | 1.705 | (721) | Caterpillar Inc | Goldman Sachs | (3.309) |
| (230) | Capitol Federal Financial Inc | Bank of America | | (221) | Cathay General Bancorp | Morgan Stanley | (9.048) |
| | | Merrill Lynch | (140) | | Cathay General Bancorp | Bank of America | |
| 266 | Capri Holdings Ltd | Bank of America | | (108) | Cathay General Bancorp | Merrill Lynch | (424) |
| | | Merrill Lynch | 851 | (19) | Cavco Industries Inc | Goldman Sachs | (218) |
| 361 | Capri Holdings Ltd | Goldman Sachs | 1.503 | 13 | CBIZ Inc | Goldman Sachs | 162 |
| 984 | Capri Holdings Ltd | Morgan Stanley | 5.820 | | CBIZ Inc | Bank of America | |
| 51 | Cara Therapeutics Inc | Bank of America | | 162 | Cboe Global Markets Inc | Merrill Lynch | (4) |
| | | Merrill Lynch | (15) | | Cboe Global Markets Inc | Bank of America | |
| 628 | Cara Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (201) | 132 | Cboe Global Markets Inc | Merrill Lynch | 342 |
| 275 | Cardinal Health Inc | Bank of America | | 258 | Cboe Global Markets Inc | Goldman Sachs | 279 |
| | | Merrill Lynch | 30 | (126) | CBRE Group Inc 'A' | Morgan Stanley | 967 |
| 341 | Cardinal Health Inc | Goldman Sachs | 38 | (204) | CBRE Group Inc 'A' | Bank of America | |
| 28 | Cardinal Health Inc | Morgan Stanley | (20) | (54) | CBRE Group Inc 'A' | Merrill Lynch | (483) |
| 944 | Cardiovascular Systems Inc | Goldman Sachs | 774 | 18 | CBTX Inc | Goldman Sachs | (673) |
| 75 | Cardlytics Inc | Bank of America | | (61) | CDW Corp | Morgan Stanley | (122) |
| | | Merrill Lynch | (233) | | CDW Corp | Bank of America | |
| 24 | Cardlytics Inc | Goldman Sachs | (75) | (62) | CDW Corp | Merrill Lynch | (494) |
| 37 | CareDx Inc | Bank of America | | (213) | CDW Corp | Goldman Sachs | (506) |
| | | Merrill Lynch | 39 | (92) | Celanese Corp | Morgan Stanley | (1.618) |
| 165 | CareDx Inc | Goldman Sachs | 70 | | Celanese Corp | Bank of America | |
| 46 | CareTrust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 41 | (71) | Celanese Corp | Merrill Lynch | (494) |
| (596) | Cargurus Inc | Morgan Stanley | (1.722) | (221) | Celanese Corp | Goldman Sachs | (661) |
| (80) | Caribou Biosciences Inc | Bank of America | | | Celanese Corp | Morgan Stanley | (1.323) |
| | | Merrill Lynch | 114 | | | | |
| 28 | Carlisle Cos Inc | Goldman Sachs | 32 | | | | |
| (12.160) | CarLotz Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 97 | | | | |
| (837) | CarLotz Inc | Goldman Sachs | 7 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|-----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (630) | Celldex Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.783 | 391 | Cheesecake Factory Inc | Bank of America | |
| (683) | Celsius Holdings Inc | Morgan Stanley | (3.374) | | | Merrill Lynch | 461 |
| (385) | Centene Corp | Bank of America | | 369 | Cheesecake Factory Inc | Goldman Sachs | 1.108 |
| | | Merrill Lynch | 392 | 128 | Chefs' Warehouse Inc | Bank of America | |
| (585) | Centene Corp | Goldman Sachs | 667 | | | Merrill Lynch | (65) |
| (459) | Centene Corp | Morgan Stanley | 1.102 | 66 | Chefs' Warehouse Inc | Goldman Sachs | (34) |
| 434 | Centennial Resource Development Inc 'A' | Bank of America | | 325 | Chegg Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 267 | | | Merrill Lynch | 184 |
| 1.820 | Centennial Resource Development Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.119 | 1.679 | Chegg Inc | Goldman Sachs | 890 |
| | | Morgan Stanley | (897) | (6) | Chemed Corp | Bank of America | |
| (812) | CenterPoint Energy Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 47 |
| 119 | Centerspace (REIT) | Merrill Lynch | (227) | (25) | Chemed Corp | Goldman Sachs | 7 |
| | | Goldman Sachs | (1.199) | (5) | Chemed Corp | Morgan Stanley | 18 |
| 628 | Centerspace (REIT) | Bank of America | | 547 | ChemoCentryx Inc | Bank of America | |
| 11 | Central Garden & Pet Co | Merrill Lynch | 6 | | | Merrill Lynch | 1.673 |
| | | Bank of America | 72 | 267 | ChemoCentryx Inc | Goldman Sachs | 862 |
| 453 | Central Garden & Pet Co 'A' | Merrill Lynch | (41) | 191 | Chemours Co | Bank of America | |
| | | Bank of America | (687) | | | Merrill Lynch | 193 |
| (12) | Centrus Energy Corp 'A' | Goldman Sachs | (518) | 11 | Cheniere Energy Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (467) | | | Merrill Lynch | 32 |
| (201) | Centrus Energy Corp 'A' | Bank of America | (518) | 236 | Cheniere Energy Inc | Goldman Sachs | 696 |
| 648 | Century Aluminum Co | Merrill Lynch | 78 | 488 | Cheniere Energy Inc | Morgan Stanley | 4.202 |
| | | Goldman Sachs | (294) | 1.481 | Chesapeake Energy Corp | Bank of America | |
| 429 | Century Aluminum Co | Bank of America | (484) | | | Merrill Lynch | 15.216 |
| 177 | Century Communities Inc | Merrill Lynch | (135) | 1.888 | Chesapeake Energy Corp | Morgan Stanley | 11.838 |
| (127) | Cerence Inc | Goldman Sachs | (293) | (185) | Chevron Corp | Morgan Stanley | (1.595) |
| (266) | Cerevel Therapeutics Holdings Inc | Bank of America | | (580) | Chewy Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 74 | | | Merrill Lynch | 145 |
| (74) | Cerevel Therapeutics Holdings Inc | Goldman Sachs | (816) | (39) | Chewy Inc 'A' | Morgan Stanley | (55) |
| (345) | Ceridian HCM Holding Inc | Morgan Stanley | (1.427) | 20 | Children's Place Inc [†] | Goldman Sachs | — |
| (446) | Certara Inc | Bank of America | | (498) | Chimera Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (149) |
| | | Merrill Lynch | 310 | | | Morgan Stanley | 9.813 |
| (780) | Certara Inc | Goldman Sachs | 223 | 94 | Chipotle Mexican Grill Inc | Bank of America | |
| 128 | CEVA Inc | Bank of America | 74 | 13 | Choice Hotels International Inc | Merrill Lynch | 13 |
| | | Merrill Lynch | 1.402 | 322 | Choice Hotels International Inc | Goldman Sachs | 325 |
| 92 | CEVA Inc | Goldman Sachs | 102 | (214) | Chubb Ltd | Bank of America | (126) |
| (75) | CF Industries Holdings Inc | Bank of America | 25 | | | Merrill Lynch | (178) |
| | | Merrill Lynch | 45 | (83) | Chubb Ltd | Goldman Sachs | (373) |
| (205) | CF Industries Holdings Inc | Goldman Sachs | 764 | (316) | Chubb Ltd | Morgan Stanley | 401 |
| (111) | CF Industries Holdings Inc | Morgan Stanley | 714 | (692) | Church & Dwight Co Inc | Morgan Stanley | |
| (255) | CH Robinson Worldwide Inc | Bank of America | 548 | (20) | Churchill Downs Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 407 | | | Merrill Lynch | (180) |
| (247) | CH Robinson Worldwide Inc | Morgan Stanley | 1.312 | (52) | Churchill Downs Inc | Goldman Sachs | (468) |
| 878 | ChannelAdvisor Corp | Bank of America | 473 | (417) | Churchill Downs Inc | Morgan Stanley | (6.822) |
| | | Merrill Lynch | 276 | 568 | Chuy's Holdings Inc | Bank of America | |
| 821 | ChannelAdvisor Corp | Goldman Sachs | 4.405 | | | Merrill Lynch | 165 |
| 78 | Charles River Laboratories International Inc | Bank of America | 2.432 | 89 | Chuy's Holdings Inc | Goldman Sachs | 26 |
| | | Merrill Lynch | 3.365 | 924 | Ciena Corp | Bank of America | 1.347 |
| 58 | Charles River Laboratories International Inc | Goldman Sachs | 10 | | | Merrill Lynch | 1.626 |
| 188 | Charles River Laboratories International Inc | Bank of America | 552 | 949 | Ciena Corp | Goldman Sachs | 785 |
| | | Merrill Lynch | 553 | 701 | Ciena Corp | Morgan Stanley | |
| 90 | Charles Schwab Corp | Goldman Sachs | 256 | 29 | Cigna Corp | Bank of America | 110 |
| | | Merrill Lynch | 167 | | | Merrill Lynch | 87 |
| 100 | Charles Schwab Corp | Bank of America | 344 | 23 | Cigna Corp | Goldman Sachs | 663 |
| 860 | Charles Schwab Corp | Goldman Sachs | | 96 | Cigna Corp | Morgan Stanley | 7 |
| 199 | Chart Industries Inc | Bank of America | | 168 | Cimpress Plc | Goldman Sachs | |
| 102 | Charter Communications Inc 'A' | Merrill Lynch | | (22) | Cincinnati Financial Corp | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | | | | Merrill Lynch | (97) |
| 18 | Chase Corp | Bank of America | | (54) | Cincinnati Financial Corp | Goldman Sachs | (243) |
| 1.105 | Chatham Lodging Trust (REIT) | Merrill Lynch | | (62) | Cincinnati Financial Corp | Morgan Stanley | (72) |
| | | Goldman Sachs | | 2.470 | Cinemark Holdings Inc | Bank of America | |
| 1.107 | Chatham Lodging Trust (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 2.791 |
| | | Merrill Lynch | | 1.931 | Cinemark Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.182 |
| 99 | Check Point Software Technologies Ltd | Bank of America | | (180) | Cintas Corp | Morgan Stanley | (4.221) |
| | | Merrill Lynch | | (2.613) | Cipher Mining Inc | Goldman Sachs | (1.411) |
| 82 | Check Point Software Technologies Ltd | Goldman Sachs | | (835) | CIRCOR International Inc | Goldman Sachs | 75 |
| | | Bank of America | | 25 | Cirrus Logic Inc | Bank of America | |
| 302 | Check Point Software Technologies Ltd | Morgan Stanley | | | | Merrill Lynch | 46 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|----------------------------------|---|---|--|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 455 | Cirrus Logic Inc | Morgan Stanley | 864 | 636 | Codexis Inc | Goldman Sachs | 309 |
| (128) | Cisco Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (138) | 2.376 | Coeur Mining Inc | Bank of America Merrill Lynch | 964 |
| (406) | Cisco Systems Inc | Goldman Sachs | (617) | 1.171 | Coeur Mining Inc | Goldman Sachs | 538 |
| (741) | Cisco Systems Inc | Morgan Stanley | 152 | 206 | Cogent Communications Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 478 |
| (115) | Citi Trends Inc | Bank of America Merrill Lynch | 14 | 370 | Cogent Communications Holdings Inc | Goldman Sachs | 763 |
| (164) | Citi Trends Inc | Goldman Sachs | 20 | 256 | Cognex Corp | Bank of America Merrill Lynch | (15) |
| (364) | Citigroup Inc | Goldman Sachs | 52 | 1.041 | Cognex Corp | Goldman Sachs | 741 |
| (214) | Citizens Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (631) | 150 | Cognex Corp | Morgan Stanley | 87 |
| (224) | Citizens Financial Group Inc | Goldman Sachs | (598) | 414 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.058 |
| (65) | Citizens Financial Group Inc | Morgan Stanley | (81) | 492 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | Goldman Sachs | 919 |
| (9) | City Holding Co | Bank of America Merrill Lynch | (25) | 1.034 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | Morgan Stanley | 2.288 |
| (887) | Civitas Resources Inc | Morgan Stanley | (8.143) | 1.121 | Cognyte Software Ltd | Goldman Sachs | 303 |
| (67) | Clarivate Plc | Goldman Sachs | (25) | (40) | Cohen & Steers Inc | Bank of America Merrill Lynch | 18 |
| (2.181) | Clarivate Plc | Morgan Stanley | — | (396) | Coherent Inc | Morgan Stanley | (1.018) |
| 1.054 | Clean Energy Fuels Corp | Bank of America Merrill Lynch | 681 | 2.086 | Coherus Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | (591) |
| 1.277 | Clean Energy Fuels Corp | Goldman Sachs | 790 | 2.368 | Coherus Biosciences Inc | Goldman Sachs | (556) |
| (22) | Clean Harbors Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1 | 136 | Cohu Inc | Goldman Sachs | 371 |
| (73) | Clean Harbors Inc | Morgan Stanley | (147) | 454 | Colgate-Palmolive Co | Bank of America Merrill Lynch | (206) |
| 1.845 | Clear Channel Outdoor Holdings Inc | Goldman Sachs | (424) | 337 | Colgate-Palmolive Co | Goldman Sachs | 174 |
| 263 | Clear Secure Inc 'A' | Morgan Stanley | (68) | 444 | Colgate-Palmolive Co | Morgan Stanley | 688 |
| (44) | Clearfield Inc | Bank of America Merrill Lynch | (357) | (1.007) | Collegium Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs | (181) |
| (154) | Clearfield Inc | Goldman Sachs | (1.250) | (260) | Columbia Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | (125) |
| 63 | Clearwater Paper Corp | Goldman Sachs | 88 | (215) | Columbia Financial Inc | Goldman Sachs | (103) |
| 136 | Clearway Energy Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 325 | (558) | Columbia Sportswear Co | Bank of America Merrill Lynch | (354) |
| 440 | Clearway Energy Inc 'A' | Goldman Sachs | 888 | (477) | Columbia Sportswear Co | Goldman Sachs | 585 |
| (44) | Clearway Energy Inc 'C' | Bank of America Merrill Lynch | (105) | (1.102) | Columbia Sportswear Co | Morgan Stanley | (2.105) |
| (322) | Clearway Energy Inc 'C' | Goldman Sachs | (931) | 35 | Columbus McKinnon Corp | Bank of America Merrill Lynch | 23 |
| (163) | Cleveland-Cliffs Inc | Goldman Sachs | (353) | (984) | Comcast Corp 'A' | Goldman Sachs | (1.478) |
| 61 | Clorox Co | Bank of America Merrill Lynch | (435) | (1.149) | Comcast Corp 'A' | Morgan Stanley | (790) |
| 217 | Clorox Co | Goldman Sachs | (2.545) | 31 | Comerica Inc | Bank of America Merrill Lynch | 102 |
| 123 | Clorox Co | Morgan Stanley | 710 | 147 | Comerica Inc | Goldman Sachs | 470 |
| (53) | Cloudflare Inc 'A' | Goldman Sachs | 52 | 81 | Comerica Inc | Morgan Stanley | 439 |
| (148) | Cloudflare Inc 'A' | Morgan Stanley | 55 | (149) | Comfort Systems USA Inc | Bank of America Merrill Lynch | (827) |
| (599) | Clover Health Investments Corp | Goldman Sachs | (21) | (48) | Comfort Systems USA Inc | Goldman Sachs | (317) |
| 2 | Clovis Oncology Inc [†] | Goldman Sachs | — | 133 | Commerce Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | 197 |
| 42 | CME Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (33) | 442 | Commercial Metals Co | Bank of America Merrill Lynch | 1.258 |
| 65 | CME Group Inc | Goldman Sachs | 236 | 1.108 | Commercial Metals Co | Goldman Sachs | 4.095 |
| 195 | CME Group Inc | Morgan Stanley | 1.415 | 575 | Commercial Metals Co | Morgan Stanley | 1.327 |
| 437 | CMS Energy Corp | Bank of America Merrill Lynch | 668 | 166 | CommScope Holding Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 61 |
| 573 | CMS Energy Corp | Goldman Sachs | 605 | 1.543 | CommScope Holding Co Inc | Goldman Sachs | 571 |
| 398 | CMS Energy Corp | Morgan Stanley | 402 | (187) | Community Bank System Inc | Bank of America Merrill Lynch | (419) |
| 1.121 | CNO Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 600 | (1.352) | Community Bank System Inc | Goldman Sachs | (3.028) |
| 1.006 | CNO Financial Group Inc | Goldman Sachs | 521 | (45) | Community Health Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | 48 |
| 197 | CNX Resources Corp | Bank of America Merrill Lynch | 6 | (157) | Community Healthcare Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (111) |
| 629 | Coca-Cola Co | Goldman Sachs | (1.540) | (14) | Community Trust Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (13) |
| 2.874 | Coca-Cola Co | Morgan Stanley | (2.748) | | | | |
| (27) | Coca-Cola Consolidated Inc | Goldman Sachs | (761) | | | | |
| 216 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Bank of America Merrill Lynch | 131 | | | | |
| 323 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Goldman Sachs | 268 | | | | |
| 452 | Codexis Inc | Bank of America Merrill Lynch | 217 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 61 | CommVault Systems Inc | Goldman Sachs | 182 | (530) | Corporate Office Properties Trust (REIT) | Goldman Sachs | (694) |
| 114 | Compass Minerals International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 41 | 86 | Corsair Gaming Inc | Bank of America Merrill Lynch | 25 |
| 187 | Compass Minerals International Inc | Goldman Sachs | 170 | 42 | Corsair Gaming Inc | Goldman Sachs | 32 |
| (250) | Compugen Ltd | Goldman Sachs | 41 | 750 | Corteva Inc | Morgan Stanley | 1.830 |
| (54) | Computer Programs and Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | 8 | 49 | CorVel Corp | Bank of America Merrill Lynch | (106) |
| (281) | Comstock Resources Inc | Goldman Sachs | (1.242) | 43 | CorVel Corp | Goldman Sachs | (93) |
| 129 | Comtech Telecommunications Corp | Bank of America Merrill Lynch | 85 | 356 | CoStar Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.443 |
| 184 | Comtech Telecommunications Corp | Goldman Sachs | 77 | 415 | CoStar Group Inc | Goldman Sachs | 1.665 |
| (450) | Conagra Brands Inc | Morgan Stanley | (36) | 468 | CoStar Group Inc | Morgan Stanley | 1.502 |
| (139) | Concentrix Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.414) | 74 | Costco Wholesale Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.969 |
| (346) | Concentrix Corp | Morgan Stanley | (2.993) | 165 | Costco Wholesale Corp | Goldman Sachs | 453 |
| (463) | Confluent Inc 'A' | Goldman Sachs | (907) | 531 | Costco Wholesale Corp | Morgan Stanley | 16.758 |
| (95) | CONMED Corp | Bank of America Merrill Lynch | 81 | (225) | Coterra Energy Inc | Goldman Sachs | (1.123) |
| (65) | CONMED Corp | Bank of America Merrill Lynch | 55 | (1.769) | Coterra Energy Inc | Morgan Stanley | (5.625) |
| 327 | ConnectOne Bancorp Inc | Goldman Sachs | 284 | (612) | Coty Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (465) |
| 273 | ConnectOne Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 238 | (2.859) | Coty Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.173) |
| (32) | ConocoPhillips | Bank of America Merrill Lynch | (365) | (2.193) | Coty Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.557) |
| (326) | ConocoPhillips | Morgan Stanley | (2.564) | (50) | Couchbase Inc | Bank of America Merrill Lynch | (55) |
| (59) | Consensus Cloud Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (83) | (2.085) | Couchbase Inc | Goldman Sachs | (2.249) |
| (17) | Consensus Cloud Solutions Inc | Goldman Sachs | (24) | 469 | Coupa Software Inc | Bank of America Merrill Lynch | 715 |
| (149) | Consolidated Communications Holdings Inc | Goldman Sachs | (57) | 357 | Coupa Software Inc | Goldman Sachs | 270 |
| (184) | Consolidated Edison Inc | Morgan Stanley | (344) | 348 | Coupa Software Inc | Morgan Stanley | 146 |
| 175 | Constellation Brands Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (818) | (511) | Coursera Inc | Bank of America Merrill Lynch | (818) |
| (640) | Constellation Energy Corp | Morgan Stanley | (4.115) | (715) | Coursera Inc | Goldman Sachs | (1.123) |
| (526) | Constellium SE | Bank of America Merrill Lynch | (500) | (858) | Cousins Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (661) |
| (805) | Constellium SE | Goldman Sachs | (765) | (417) | Cousins Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (321) |
| (596) | Constellium SE | Morgan Stanley | (298) | (842) | Cousins Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (530) |
| (190) | Construction Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | (91) | 354 | Covetrus Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.454 |
| 56 | Container Store Group Inc | Goldman Sachs | 20 | 398 | Covetrus Inc | Goldman Sachs | 1.684 |
| (12.268) | ContextLogic Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.797) | 605 | Cowen Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.517 |
| 1.976 | Continental Resources Inc | Morgan Stanley | 14.622 | 1.199 | Cowen Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.072 |
| 46 | Cooper Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | 977 | (8) | CRA International Inc | Goldman Sachs | (17) |
| 78 | Cooper Cos Inc | Morgan Stanley | 814 | (638) | Cracker Barrel Old Country Store Inc | Goldman Sachs | 542 |
| 20 | Copart Inc | Goldman Sachs | (14) | (30) | Crane Holdings Co | Bank of America Merrill Lynch | (81) |
| 156 | Copart Inc | Morgan Stanley | 535 | (192) | Crane Holdings Co | Goldman Sachs | (735) |
| 367 | Corcept Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 507 | 13 | Credit Acceptance Corp | Morgan Stanley | 194 |
| 1.013 | Corcept Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.815 | (968) | Crescent Energy Co 'A' | Goldman Sachs | (1.065) |
| (209) | Core & Main Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (614) | (297) | Crinetics Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.006 |
| (168) | Core & Main Inc 'A' | Goldman Sachs | (494) | (103) | Crinetics Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 226 |
| (50) | Core Laboratories NV | Bank of America Merrill Lynch | (227) | (546) | CRISPR Therapeutics AG | Bank of America Merrill Lynch | (3.527) |
| (222) | Core Laboratories NV | Goldman Sachs | (1.008) | (144) | CRISPR Therapeutics AG | Goldman Sachs | (930) |
| (228) | CoreCivic Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (381) | (161) | CRISPR Therapeutics AG | Morgan Stanley | (634) |
| (540) | CoreCivic Inc (REIT) | Goldman Sachs | (902) | 1.113 | Crocs Inc | Bank of America Merrill Lynch | 737 |
| (813) | Corning Inc | Bank of America Merrill Lynch | (138) | 506 | Crocs Inc | Goldman Sachs | (661) |
| (288) | Corning Inc | Goldman Sachs | (583) | 651 | Crocs Inc | Morgan Stanley | 1.510 |
| (2.676) | Corning Inc | Morgan Stanley | (4.308) | 253 | Cross Country Healthcare Inc | Bank of America Merrill Lynch | 207 |
| (12) | Corporate Office Properties Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (16) | 169 | Cross Country Healthcare Inc | Goldman Sachs | 135 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|-----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 384 | CrossFirst Bankshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | 227 | (597) | Datadog Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.660) |
| 461 | CrossFirst Bankshares Inc | Goldman Sachs | 272 | 513 | Dave & Buster's Entertainment Inc | Bank of America Merrill Lynch | 279 |
| (60) | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.242) | 373 | Dave & Buster's Entertainment Inc | Goldman Sachs | 116 |
| (23) | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (619) | 148 | DaVita Inc | Morgan Stanley | 400 |
| (38) | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | (649) | 877 | Deciphera Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 614 |
| 119 | Crown Castle International Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 779 | 101 | Deciphera Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 71 |
| 211 | Crown Castle International Corp (REIT) | Goldman Sachs | 2.678 | (97) | Deckers Outdoor Corp | Morgan Stanley | (1.778) |
| 918 | Crown Castle International Corp (REIT) | Morgan Stanley | 4.461 | (61) | Deere & Co | Bank of America Merrill Lynch | (398) |
| (128) | Crown Holdings Inc | Morgan Stanley | (429) | (32) | Deere & Co | Goldman Sachs | (1.434) |
| (180) | CryoPort Inc | Bank of America Merrill Lynch | (473) | (221) | Deere & Co | Morgan Stanley | (4.596) |
| (25) | CryoPort Inc | Goldman Sachs | (102) | 293 | Delek US Holdings Inc | Goldman Sachs | 466 |
| (73) | CSG Systems International Inc | Goldman Sachs | (191) | 51 | Dell Technologies Inc 'C' | Bank of America Merrill Lynch | 190 |
| 24 | CSW Industrials Inc | Bank of America Merrill Lynch | 10 | 768 | Dell Technologies Inc 'C' | Goldman Sachs | 4.209 |
| 40 | CSW Industrials Inc | Goldman Sachs | 17 | 55 | Dell Technologies Inc 'C' | Morgan Stanley | 449 |
| (2.918) | CSX Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4.144 | (142) | Delta Air Lines Inc | Bank of America Merrill Lynch | (379) |
| (208) | CTS Corp | Bank of America Merrill Lynch | (672) | 354 | Deluxe Corp | Bank of America Merrill Lynch | (125) |
| (413) | CTS Corp | Goldman Sachs | (1.334) | 974 | Deluxe Corp | Goldman Sachs | (514) |
| 257 | CubeSmart (REIT) | Goldman Sachs | 532 | 262 | Denali Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 307 |
| 320 | CubeSmart (REIT) | Morgan Stanley | 771 | 49 | Denali Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 57 |
| (125) | Cue Biopharma Inc | Goldman Sachs | (28) | (6) | Denbury Inc | Bank of America Merrill Lynch | (12) |
| (308) | Cullen/Frost Bankers Inc | Bank of America Merrill Lynch | (594) | (21) | Denbury Inc | Goldman Sachs | (204) |
| (56) | Cullen/Frost Bankers Inc | Goldman Sachs | (108) | (834) | Denny's Corp | Bank of America Merrill Lynch | (367) |
| (17) | Cullen/Frost Bankers Inc | Morgan Stanley | (59) | (903) | Denny's Corp | Goldman Sachs | (397) |
| (37) | Cullinan Oncology Inc | Goldman Sachs | (19) | 108 | DENTSPLY SIRONA Inc | Goldman Sachs | 130 |
| 14 | Cummins Inc | Bank of America Merrill Lynch | 63 | 610 | DENTSPLY SIRONA Inc | Morgan Stanley | 586 |
| 322 | Cummins Inc | Morgan Stanley | 2.718 | (326) | DermTech Inc | Bank of America Merrill Lynch | 72 |
| (254) | CuriosityStream Inc | Goldman Sachs | 43 | (129) | DermTech Inc | Goldman Sachs | (56) |
| (57) | Curo Group Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (8) | (229) | Designer Brands Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (355) |
| (128) | Curtiss-Wright Corp | Bank of America Merrill Lynch | (696) | (82) | Designer Brands Inc 'A' | Goldman Sachs | (127) |
| (454) | Curtiss-Wright Corp | Goldman Sachs | (2.192) | (1.896) | Desktop Metal Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (294) |
| (202) | Curtiss-Wright Corp | Morgan Stanley | (319) | (10.707) | Desktop Metal Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.660) |
| (130) | Cushman & Wakefield Plc | Bank of America Merrill Lynch | (48) | (1.041) | Devon Energy Corp | Goldman Sachs | (7.671) |
| (140) | Cushman & Wakefield Plc | Goldman Sachs | (52) | (1.392) | Devon Energy Corp | Morgan Stanley | (9.682) |
| 125 | Cutera Inc | Bank of America Merrill Lynch | (369) | 46 | Dexcom Inc | Bank of America Merrill Lynch | (224) |
| 81 | Cutera Inc | Goldman Sachs | (239) | 75 | Dexcom Inc | Goldman Sachs | 10 |
| (1.505) | CVB Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.640) | 123 | DexCom Inc | Morgan Stanley | 2.111 |
| (3.072) | CVB Financial Corp | Goldman Sachs | (3.348) | (175) | Diamondback Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.652) |
| (182) | CVS Health Corp | Goldman Sachs | 198 | (356) | Diamondback Energy Inc | Goldman Sachs | (9.563) |
| (1.294) | CVS Health Corp | Morgan Stanley | (2.113) | (59) | Diamondback Energy Inc | Morgan Stanley | (1.284) |
| 56 | Cytokinetics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (161) | (1.360) | DiamondRock Hospitality Co (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (476) |
| 31 | Cytokinetics Inc | Goldman Sachs | (89) | 590 | Dick's Sporting Goods Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.305) |
| (1.221) | Dana Inc | Goldman Sachs | (1.795) | 1.221 | Dick's Sporting Goods Inc | Goldman Sachs | (6.950) |
| 303 | Danaher Corp | Goldman Sachs | 3.800 | 1.190 | Dick's Sporting Goods Inc | Morgan Stanley | 8.202 |
| 584 | Danaher Corp | Morgan Stanley | 5.327 | (160) | Diebold Nixdorf Inc | Bank of America Merrill Lynch | 13 |
| (800) | Darden Restaurants Inc | Morgan Stanley | (6.440) | (1.919) | Diebold Nixdorf Inc | Goldman Sachs | 154 |
| (39) | Darling Ingredients Inc | Bank of America Merrill Lynch | (218) | 24 | Digi International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 13 |
| (44) | Darling Ingredients Inc | Goldman Sachs | (159) | 324 | Digital Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 2.892 |
| (760) | Darling Ingredients Inc | Morgan Stanley | (2.333) | 214 | Digital Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.359 |
| (139) | Datadog Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (539) | | | | |
| (595) | Datadog Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.309) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-------------------------------|---|---|-------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 50 | Digital Realty Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 256 | 390 | Douglas Emmett Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 315 |
| 127 | Digital Turbine Inc | Bank of America Merrill Lynch | 280 | 496 | Douglas Emmett Inc (REIT) | Goldman Sachs | 311 |
| 750 | Digital Turbine Inc | Goldman Sachs | 188 | 1.850 | Douglas Emmett Inc (REIT) | Morgan Stanley | 557 |
| (703) | DigitalBridge Group Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (176) | (254) | Dover Corp | Bank of America Merrill Lynch | 173 |
| (197) | DigitalBridge Group Inc (REIT) | Goldman Sachs | (49) | (192) | Dover Corp | Morgan Stanley | (363) |
| (647) | DigitalOcean Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.271) | (214) | Dow Inc | Bank of America Merrill Lynch | (428) |
| (1.195) | DigitalOcean Holdings Inc | Goldman Sachs | (12.274) | (852) | Dow Inc | Goldman Sachs | (452) |
| (994) | DigitalOcean Holdings Inc | Morgan Stanley | (6.391) | (1.569) | Dow Inc | Morgan Stanley | (1.643) |
| 86 | Dime Community Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | 181 | (47) | Doximity Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (139) |
| 44 | Dime Community Bancshares Inc | Goldman Sachs | 97 | (345) | Doximity Inc 'A' | Goldman Sachs | (994) |
| (240) | Dine Brands Global Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.255) | (1.053) | Doximity Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.790) |
| (102) | Dine Brands Global Inc | Goldman Sachs | (482) | (219) | DR Horton Inc | Goldman Sachs | (1.141) |
| (38) | Diodes Inc | Bank of America Merrill Lynch | (71) | (484) | DR Horton Inc | Morgan Stanley | (2.972) |
| 133 | Discover Financial Services | Morgan Stanley | 541 | 4.418 | DraftKings Inc 'A' | Morgan Stanley | (133) |
| (4.251) | Discovery Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.294) | (27) | Dril-Quip Inc | Bank of America Merrill Lynch | (73) |
| (1.988) | Discovery Inc | Goldman Sachs | (1.559) | (885) | Driven Brands Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.481) |
| (542) | Discovery Inc | Morgan Stanley | 38 | (572) | Driven Brands Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.603) |
| (452) | DISH Network Corp 'A' | Morgan Stanley | (868) | (1.087) | Dropbox Inc 'A' | Morgan Stanley | (446) |
| (31) | DMC Global Inc | Bank of America Merrill Lynch | (167) | 196 | DT Midstream Inc | Bank of America Merrill Lynch | 249 |
| (120) | DMC Global Inc | Goldman Sachs | (647) | 197 | DT Midstream Inc | Goldman Sachs | 312 |
| 288 | DocuSign Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.739 | 116 | DT Midstream Inc | Morgan Stanley | 66 |
| 85 | DocuSign Inc | Goldman Sachs | 808 | (65) | DTE Energy Co | Bank of America Merrill Lynch | (139) |
| 149 | DocuSign Inc | Morgan Stanley | 854 | (33) | DTE Energy Co | Goldman Sachs | (148) |
| (118) | Dolby Laboratories Inc 'A' | Morgan Stanley | (261) | (72) | DTE Energy Co | Morgan Stanley | (124) |
| 137 | Dollar General Corp | Bank of America Merrill Lynch | 18 | (551) | Duck Creek Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (473) |
| 24 | Dollar General Corp | Morgan Stanley | (149) | (913) | Duck Creek Technologies Inc | Goldman Sachs | (1.148) |
| (3.438) | Doma Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (622) | (508) | Duckhorn Portfolio Inc | Bank of America Merrill Lynch | 129 |
| (2.416) | Doma Holdings Inc | Goldman Sachs | (324) | (293) | Duckhorn Portfolio Inc | Goldman Sachs | 70 |
| 174 | Dominion Energy Inc | Goldman Sachs | 78 | 128 | Ducommun Inc | Bank of America Merrill Lynch | 42 |
| 31 | Domino's Pizza Inc | Bank of America Merrill Lynch | 667 | 206 | Ducommun Inc | Goldman Sachs | 37 |
| 105 | Domino's Pizza Inc | Goldman Sachs | 2.821 | (527) | Duke Energy Corp | Bank of America Merrill Lynch | (834) |
| 49 | Domino's Pizza Inc | Morgan Stanley | 882 | (884) | Duke Energy Corp | Goldman Sachs | (2.696) |
| (45) | Domo Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (80) | (804) | Duke Energy Corp | Morgan Stanley | (1.479) |
| 60 | Donaldson Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 109 | (572) | Dun & Bradstreet Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (698) |
| 965 | Donaldson Co Inc | Morgan Stanley | 1.544 | (448) | Dun & Bradstreet Holdings Inc | Goldman Sachs | (547) |
| 2.254 | Donegal Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.037 | (5.872) | Dun & Bradstreet Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.231) |
| (474) | Donnelley Financial Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.018) | (166) | Duolingo Inc | Goldman Sachs | (160) |
| (333) | Donnelley Financial Solutions Inc | Goldman Sachs | (748) | (137) | DuPont de Nemours Inc | Bank of America Merrill Lynch | (519) |
| (167) | DoorDash Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.032) | 331 | DXC Technology Co | Bank of America Merrill Lynch | 1.854 |
| (414) | DoorDash Inc 'A' | Morgan Stanley | (4.202) | 447 | DXC Technology Co | Goldman Sachs | 2.077 |
| 409 | Dorian LPG Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 405 | 560 | DXC Technology Co | Morgan Stanley | 2.913 |
| 402 | Dorian LPG Ltd | Goldman Sachs | 398 | 745 | DXP Enterprises Inc | Goldman Sachs | 1.550 |
| (120) | Dorman Products Inc | Bank of America Merrill Lynch | (23) | (91) | Dycom Industries Inc | Goldman Sachs | (1.249) |
| (132) | Dorman Products Inc | Goldman Sachs | 13 | (494) | Dynatrace Inc | Bank of America Merrill Lynch | 325 |
| 113 | Douglas Dynamics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 93 | (581) | Dynavax Technologies Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.097) |
| 109 | Douglas Dynamics Inc | Goldman Sachs | 133 | (525) | Dynavax Technologies Corp | Goldman Sachs | (1.171) |
| (1.662) | Douglas Elliman Inc | Bank of America Merrill Lynch | 66 | 406 | Dyne Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (325) |
| (2.062) | Douglas Elliman Inc | Goldman Sachs | 82 | 1.184 | Dyne Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (947) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (166) | Dynex Capital Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 3 | 374 | Elanco Animal Health Inc | Morgan Stanley | 108 |
| (2.304) | Dynex Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | 46 | 225 | Elastic NV | Bank of America Merrill Lynch | 712 |
| (67) | E2open Parent Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (28) | 670 | Elastic NV | Goldman Sachs | 2.377 |
| (49) | Eagle Bancorp Inc | Goldman Sachs | (35) | 194 | Elastic NV | Morgan Stanley | 570 |
| (51) | Eagle Materials Inc | Bank of America Merrill Lynch | (460) | 167 | Electronic Arts Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.146 |
| (108) | Eagle Materials Inc | Goldman Sachs | (974) | 284 | Electronic Arts Inc | Goldman Sachs | 2.024 |
| (197) | Eagle Materials Inc | Morgan Stanley | (1.133) | 243 | Electronic Arts Inc | Morgan Stanley | 940 |
| 81 | Eagle Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 162 | (2.565) | Element Solutions Inc | Morgan Stanley | (1.308) |
| 77 | Eagle Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 154 | 962 | elf Beauty Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.861 |
| (332) | East West Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (789) | 702 | elf Beauty Inc | Goldman Sachs | 2.120 |
| 1.300 | Easterly Government Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 533 | 152 | Eli Lilly & Co | Bank of America Merrill Lynch | 2.111 |
| 1.177 | Easterly Government Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 483 | 102 | Eli Lilly & Co | Goldman Sachs | 1.288 |
| (944) | Eastern Bankshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (906) | 104 | Eli Lilly & Co | Morgan Stanley | 1.037 |
| (2.740) | Eastern Bankshares Inc | Goldman Sachs | (2.623) | (306) | Embeckta Corp | Bank of America Merrill Lynch | 56 |
| 86 | EastGroup Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (218) | (234) | Embeckta Corp | Goldman Sachs | 80 |
| 69 | EastGroup Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 34 | (339) | EMCOR Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.479) |
| (844) | Eastman Chemical Co | Bank of America Merrill Lynch | (5.969) | (495) | EMCOR Group Inc | Goldman Sachs | (2.133) |
| (587) | Eastman Chemical Co | Goldman Sachs | (3.780) | (250) | EMCOR Group Inc | Morgan Stanley | (892) |
| (349) | Eastman Chemical Co | Morgan Stanley | (2.209) | 322 | Emergent BioSolutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.723 |
| (357) | Eastman Kodak Co | Bank of America Merrill Lynch | (57) | 701 | Emergent BioSolutions Inc | Goldman Sachs | 3.750 |
| (6.054) | Eastman Kodak Co | Goldman Sachs | (969) | (533) | Emerson Electric Co | Bank of America Merrill Lynch | (2.344) |
| (237) | Eaton Corp Plc | Bank of America Merrill Lynch | 105 | (243) | Emerson Electric Co | Goldman Sachs | (658) |
| (285) | Eaton Corp Plc | Goldman Sachs | 158 | (663) | Emerson Electric Co | Morgan Stanley | (1.857) |
| (508) | Eaton Corp Plc | Morgan Stanley | (305) | (683) | Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (20) |
| (207) | eBay Inc | Bank of America Merrill Lynch | (588) | (585) | Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (18) |
| (281) | eBay Inc | Morgan Stanley | (776) | (79) | Employers Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (50) |
| (141) | Ebix Inc | Bank of America Merrill Lynch | 165 | (303) | Employers Holdings Inc | Goldman Sachs | (191) |
| (287) | Ebix Inc | Goldman Sachs | 336 | 202 | Enanta Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (622) |
| 253 | EchoStar Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 824 | 234 | Enanta Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (1.104) |
| 985 | EchoStar Corp 'A' | Goldman Sachs | 3.077 | (330) | Encompass Health Corp | Bank of America Merrill Lynch | (493) |
| 109 | Ecolab Inc | Bank of America Merrill Lynch | 341 | (958) | Encompass Health Corp | Goldman Sachs | (467) |
| 78 | Ecolab Inc | Goldman Sachs | 244 | (902) | Encompass Health Corp | Morgan Stanley | (758) |
| 172 | Ecolab Inc | Morgan Stanley | 248 | 110 | Encore Capital Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 142 |
| 1.660 | Ecovyst Inc | Bank of America Merrill Lynch | 714 | (133) | Encore Wire Corp | Bank of America Merrill Lynch | (98) |
| 3.127 | Ecovyst Inc | Goldman Sachs | 1.345 | (236) | Encore Wire Corp | Goldman Sachs | (175) |
| (302) | Edgewell Personal Care Co | Bank of America Merrill Lynch | 157 | (233) | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (701) |
| (931) | Edgewell Personal Care Co | Goldman Sachs | 547 | (914) | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | (695) |
| 70 | Edison International | Goldman Sachs | 184 | 462 | Energizer Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.210) |
| 671 | Edison International | Morgan Stanley | 1.859 | 600 | Energizer Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.572) |
| 265 | Editas Medicine Inc | Bank of America Merrill Lynch | 130 | 834 | Energy Recovery Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.086 |
| 356 | Editas Medicine Inc | Goldman Sachs | 174 | 642 | Energy Recovery Inc | Goldman Sachs | 1.443 |
| 221 | Edwards Lifesciences Corp | Bank of America Merrill Lynch | 791 | (692) | Enerpac Tool Group Corp | Bank of America Merrill Lynch | 138 |
| 878 | Edwards Lifesciences Corp | Goldman Sachs | 4.212 | (1.096) | Enerpac Tool Group Corp | Goldman Sachs | 219 |
| 215 | Edwards Lifesciences Corp | Morgan Stanley | 991 | 179 | EnerSys | Bank of America Merrill Lynch | 983 |
| (360) | eHealth Inc | Bank of America Merrill Lynch | 109 | 35 | EnerSys | Goldman Sachs | 192 |
| (89) | eHealth Inc | Goldman Sachs | (38) | 45 | Ennis Inc | Bank of America Merrill Lynch | 17 |
| (2.023) | El Pollo Loco Holdings Inc | Goldman Sachs | 162 | 15 | Enova International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (11) |
| 1.128 | Elanco Animal Health Inc | Bank of America Merrill Lynch | 756 | (296) | Enovis Corp | Morgan Stanley | (189) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (1.450) | Enovix Corp | Bank of America Merrill Lynch | (5.083) | (62) | Establishment Labs Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (335) |
| (581) | Enovix Corp | Goldman Sachs | (2.068) | (43) | Establishment Labs Holdings Inc | Goldman Sachs | (232) |
| (105) | Enphase Energy Inc | Morgan Stanley | (1.849) | (74) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.779) |
| 172 | EnPro Industries Inc | Goldman Sachs | (29) | (228) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Goldman Sachs | (4.524) |
| 73 | Ensign Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 244 | (922) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Morgan Stanley | (17.765) |
| 184 | Ensign Group Inc | Goldman Sachs | 527 | 590 | Ethan Allen Interiors Inc | Bank of America Merrill Lynch | (566) |
| (4) | Enstar Group Ltd | Goldman Sachs | (11) | 369 | Ethan Allen Interiors Inc | Goldman Sachs | (354) |
| (613) | Entegris Inc | Goldman Sachs | (2.556) | 100 | Etsy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 201 |
| (110) | Entergy Corp | Bank of America Merrill Lynch | (194) | 569 | Etsy Inc | Goldman Sachs | (2.132) |
| (12) | Enterprise Financial Services Corp | Bank of America Merrill Lynch | (37) | 326 | Etsy Inc | Morgan Stanley | 1.940 |
| (473) | Envista Holdings Corp | Morgan Stanley | (270) | (49) | Euronet Worldwide Inc | Morgan Stanley | (263) |
| 192 | EOG Resources Inc | Morgan Stanley | 2.287 | (44) | European Wax Center Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (72) |
| 108 | EPAM Systems Inc | Morgan Stanley | 958 | (248) | European Wax Center Inc 'A' | Goldman Sachs | (303) |
| (38) | ePlus Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5) | 91 | Eventbrite Inc 'A' | Goldman Sachs | 52 |
| (1.069) | EPR Properties (REIT) | Goldman Sachs | (951) | 196 | Everbridge Inc | Goldman Sachs | 743 |
| 59 | EQT Corp | Bank of America Merrill Lynch | 418 | 84 | Evercore Inc 'A' | Morgan Stanley | 275 |
| 1.813 | EQT Corp | Goldman Sachs | 13.230 | 66 | Everest Re Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 261 |
| 819 | EQT Corp | Morgan Stanley | 2.719 | 95 | Everest Re Group Ltd | Goldman Sachs | 1.040 |
| 106 | Equifax Inc | Morgan Stanley | 421 | 27 | Everest Re Group Ltd | Morgan Stanley | 216 |
| 54 | Equinix Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.463 | 111 | Evergy Inc | Morgan Stanley | 16 |
| 82 | Equinix Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.060 | 518 | Everi Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 606 |
| 102 | Equinix Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.886 | 415 | Everi Holdings Inc | Goldman Sachs | 389 |
| 220 | Equitable Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 610 | (279) | EverQuote Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (20) |
| 103 | Equitable Holdings Inc | Goldman Sachs | 169 | (1.249) | Eversource Energy | Morgan Stanley | (1.174) |
| 619 | Equitable Holdings Inc | Morgan Stanley | 982 | (54) | EVERTEC Inc | Bank of America Merrill Lynch | (16) |
| 1.182 | Equitrans Midstream Corp | Bank of America Merrill Lynch | 591 | (223) | EVERTEC Inc | Goldman Sachs | (67) |
| 1.101 | Equitrans Midstream Corp | Goldman Sachs | 550 | (201) | Evo Payments Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (163) |
| (139) | Equity Commonwealth (REIT) | Goldman Sachs | (86) | (183) | Evo Payments Inc 'A' | Goldman Sachs | (148) |
| 434 | Equity LifeStyle Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.667 | 645 | Evolent Health Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | — |
| 594 | Equity Residential (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.756 | 229 | Evolent Health Inc 'A' | Goldman Sachs | — |
| 1.314 | Equity Residential (REIT) | Goldman Sachs | 3.892 | (885) | Evolv Technologies Holdings Inc | Goldman Sachs | (602) |
| 788 | Equity Residential (REIT) | Morgan Stanley | 1.237 | 623 | Evoqua Water Technologies Corp | Goldman Sachs | 274 |
| 336 | Erie Indemnity Co 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.042 | 15 | Evoqua Water Technologies Corp | Morgan Stanley | (12) |
| 117 | Erie Indemnity Co 'A' | Goldman Sachs | 363 | 775 | EW Scripps Co 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 303 |
| 32 | Erie Indemnity Co 'A' | Morgan Stanley | 115 | 1.428 | EW Scripps Co 'A' | Goldman Sachs | 600 |
| 64 | Esab Corp | Bank of America Merrill Lynch | (49) | (325) | Exact Sciences Corp | Morgan Stanley | 188 |
| 18 | ESCO Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 26 | 1.328 | Exelixis Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.616) |
| 95 | ESCO Technologies Inc | Goldman Sachs | 135 | 334 | Exelixis Inc | Goldman Sachs | (699) |
| (80) | Essa Pharma Inc | Goldman Sachs | 35 | 924 | Exelixis Inc | Morgan Stanley | 499 |
| 678 | Essent Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.244 | (290) | Exelon Corp | Bank of America Merrill Lynch | (163) |
| 141 | Essent Group Ltd | Goldman Sachs | 105 | (696) | Exelon Corp | Goldman Sachs | (1.296) |
| 50 | Essent Group Ltd | Morgan Stanley | 66 | (1.086) | Exelon Corp | Morgan Stanley | (1.368) |
| 1.375 | Essential Properties Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (215) | (46) | ExlService Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (286) |
| 746 | Essential Properties Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (74) | (112) | ExlService Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.098) |
| 1.223 | Essential Utilities Inc | Bank of America Merrill Lynch | 367 | (135) | ExlService Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.455) |
| 434 | Essential Utilities Inc | Morgan Stanley | (40) | 682 | eXp World Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 368 |
| 195 | Essex Property Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 34 | 865 | eXp World Holdings Inc | Goldman Sachs | 467 |
| 121 | Essex Property Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 29 | 119 | Expedia Group Inc | Goldman Sachs | 746 |
| | | | | 279 | Expedia Group Inc | Morgan Stanley | 1.872 |
| | | | | (240) | Expeditors International of Washington Inc | Bank of America Merrill Lynch | (469) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (78) | Expeditors International of Washington Inc | Goldman Sachs | (145) | 138 | First Advantage Corp | Goldman Sachs | (59) |
| (549) | Expeditors International of Washington Inc | Morgan Stanley | (1.219) | (308) | First American Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (49) |
| 69 | Exponent Inc | Bank of America Merrill Lynch | 92 | (453) | First American Financial Corp | Goldman Sachs | (281) |
| 48 | Exponent Inc | Goldman Sachs | 46 | (116) | First American Financial Corp | Morgan Stanley | (10) |
| 27 | Extra Space Storage Inc (REIT) | Morgan Stanley | 82 | (1.491) | First Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (1.965) |
| (439) | Extreme Networks Inc | Bank of America Merrill Lynch | (171) | (1.803) | First Bancorp | Goldman Sachs | (2.665) |
| (747) | Extreme Networks Inc | Goldman Sachs | (291) | 1.092 | First Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (120) |
| 149 | Exxon Mobil Corp | Bank of America Merrill Lynch | 969 | 1.117 | First Bancshares Inc | Goldman Sachs | (123) |
| 871 | Exxon Mobil Corp | Morgan Stanley | 4.503 | 583 | First Busey Corp | Bank of America Merrill Lynch | 530 |
| 71 | F45 Training Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (42) | 332 | First Busey Corp | Goldman Sachs | 362 |
| 44 | F45 Training Holdings Inc | Goldman Sachs | (26) | (10) | First Citizens BancShares Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (415) |
| (14) | F5 Inc | Bank of America Merrill Lynch | 55 | (36) | First Citizens BancShares Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.495) |
| (24) | F5 Inc | Goldman Sachs | (121) | (84) | First Citizens BancShares Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.481) |
| (82) | Fabrinet | Bank of America Merrill Lynch | 142 | (62) | First Commonwealth Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (49) |
| (42) | FactSet Research Systems Inc | Goldman Sachs | (415) | 19 | First Community Bankshares Inc | Goldman Sachs | 29 |
| 8 | Fair Isaac Corp | Bank of America Merrill Lynch | 289 | (44) | First Financial Bancorp | Goldman Sachs | (38) |
| 48 | Fair Isaac Corp | Goldman Sachs | 1.736 | 23 | First Financial Bankshares Inc | Goldman Sachs | 37 |
| 10 | Fair Isaac Corp | Morgan Stanley | 19 | 1.136 | First Financial Corp | Goldman Sachs | 1.068 |
| (360) | Farfetch Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (470) | 58 | First Foundation Inc | Bank of America Merrill Lynch | 74 |
| 33 | FARO Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (17) | 2.592 | First Foundation Inc | Goldman Sachs | 3.292 |
| (443) | Fastly Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (642) | (296) | First Hawaiian Inc | Bank of America Merrill Lynch | (368) |
| (812) | Fastly Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.177) | (561) | First Hawaiian Inc | Goldman Sachs | (708) |
| 40 | FB Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 158 | 834 | First Industrial Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 21 |
| 132 | FB Financial Corp | Goldman Sachs | 521 | 680 | First Industrial Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 37 |
| 34 | Federal Agricultural Mortgage Corp 'C' | Bank of America Merrill Lynch | 36 | 1.230 | First Industrial Realty Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.451 |
| 11 | Federal Agricultural Mortgage Corp 'C' | Goldman Sachs | 12 | 853 | First Interstate BancSystem Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.357 |
| 182 | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Morgan Stanley | 941 | 642 | First Interstate BancSystem Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.576 |
| (374) | Federal Signal Corp | Bank of America Merrill Lynch | (748) | 108 | First Merchants Corp | Bank of America Merrill Lynch | 188 |
| (71) | Federal Signal Corp | Goldman Sachs | (142) | 211 | First of Long Island Corp | Bank of America Merrill Lynch | 65 |
| (599) | Federated Hermes Inc | Goldman Sachs | (1.432) | 287 | First of Long Island Corp | Goldman Sachs | 89 |
| (124) | FedEx Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.990) | (43) | First Republic Bank | Bank of America Merrill Lynch | (725) |
| 1.625 | FibroGen Inc | Bank of America Merrill Lynch | 929 | (93) | First Republic Bank | Goldman Sachs | (1.569) |
| 2.202 | FibroGen Inc | Goldman Sachs | 1.145 | (671) | First Republic Bank | Morgan Stanley | (4.576) |
| (63) | Fidelity National Financial Inc | Goldman Sachs | (139) | (101) | First Solar Inc | Morgan Stanley | (633) |
| (684) | Fidelity National Financial Inc | Morgan Stanley | (798) | (150) | FirstCash Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (101) |
| (143) | Fidelity National Information Services Inc | Goldman Sachs | (281) | (250) | FirstCash Holdings Inc | Goldman Sachs | (162) |
| (188) | Fidelity National Information Services Inc | Morgan Stanley | (493) | (115) | FirstEnergy Corp | Bank of America Merrill Lynch | 42 |
| (1.944) | Fifth Third Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (6.380) | (448) | FirstEnergy Corp | Goldman Sachs | (217) |
| (56) | Fifth Third Bancorp | Goldman Sachs | (185) | (464) | FirstEnergy Corp | Morgan Stanley | (74) |
| (892) | Fifth Third Bancorp | Morgan Stanley | (2.021) | (1.326) | Fiserv Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.489) |
| 630 | Figs Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (315) | (784) | Fiserv Inc | Morgan Stanley | (1.514) |
| 353 | Figs Inc 'A' | Goldman Sachs | (177) | 48 | Five Below Inc | Bank of America Merrill Lynch | (345) |
| 309 | First Advantage Corp | Bank of America Merrill Lynch | (112) | 147 | Five Below Inc | Goldman Sachs | 130 |
| | | | | 97 | Five Below Inc | Morgan Stanley | 1.679 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (183) | Five9 Inc | Bank of America Merrill Lynch | (948) | 294 | Franchise Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 59 |
| (135) | Five9 Inc | Goldman Sachs | (699) | 271 | Franchise Group Inc | Goldman Sachs | 54 |
| (239) | Five9 Inc | Morgan Stanley | (1.123) | (35) | Franklin Electric Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (84) |
| (127) | FleetCor Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.956) | (142) | Franklin Electric Co Inc | Goldman Sachs | (339) |
| (108) | FleetCor Technologies Inc | Goldman Sachs | (1.867) | 394 | Franklin Resources Inc | Bank of America Merrill Lynch | 616 |
| (137) | FleetCor Technologies Inc | Morgan Stanley | (1.196) | 172 | Franklin Resources Inc | Goldman Sachs | 76 |
| 2.019 | Flex Ltd | Morgan Stanley | 2.797 | 300 | Franklin Resources Inc | Morgan Stanley | 402 |
| 349 | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.902 | (192) | Franklin Street Properties Corp (REIT) | Goldman Sachs | 4 |
| 320 | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.744 | (254) | Freeport-McMoRan Inc | Morgan Stanley | (366) |
| 154 | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 859 | (270) | Fresh Del Monte Produce Inc | Bank of America Merrill Lynch | (65) |
| 596 | Flowers Foods Inc | Bank of America Merrill Lynch | 506 | (1.102) | Fresh Del Monte Produce Inc | Goldman Sachs | (264) |
| 1.313 | Flowers Foods Inc | Goldman Sachs | (126) | (264) | Freshpet Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.608) |
| 159 | Flowers Foods Inc | Morgan Stanley | 151 | (125) | Freshpet Inc | Goldman Sachs | (761) |
| (1.174) | Flowserve Corp | Morgan Stanley | (1.010) | (1.445) | Freshworks Inc 'A' | Goldman Sachs | (535) |
| 468 | Fluor Corp | Bank of America Merrill Lynch | 476 | (2.816) | Freshworks Inc 'A' | Morgan Stanley | — |
| 377 | Fluor Corp | Goldman Sachs | 331 | 871 | frontdoor Inc | Goldman Sachs | (1.681) |
| 416 | Flushing Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 300 | (95) | Frontier Communications Parent Inc | Bank of America Merrill Lynch | (303) |
| 741 | Flushing Financial Corp | Goldman Sachs | 534 | (691) | Frontier Communications Parent Inc | Goldman Sachs | (2.204) |
| (54) | FMC Corp | Bank of America Merrill Lynch | (357) | (2.257) | Frontier Communications Parent Inc | Morgan Stanley | (5.915) |
| (148) | FMC Corp | Goldman Sachs | (980) | 526 | Frontier Group Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 537 |
| (1.873) | FNB Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.199) | 3.286 | Frontier Group Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.136 |
| (3.614) | FNB Corp | Morgan Stanley | (1.301) | 174 | FRP Holdings Inc | Goldman Sachs | 727 |
| 172 | Focus Financial Partners Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 268 | 61 | FTI Consulting Inc | Bank of America Merrill Lynch | (270) |
| 420 | Focus Financial Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | 655 | 114 | FTI Consulting Inc | Morgan Stanley | 329 |
| 180 | Foot Locker Inc | Bank of America Merrill Lynch | 365 | (218) | Fulcrum Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 187 |
| (2.865) | Ford Motor Co | Bank of America Merrill Lynch | (2.193) | (93) | Fulcrum Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 80 |
| (1.255) | Ford Motor Co | Goldman Sachs | (765) | (434) | Fulgent Genetics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (990) |
| (1.350) | Ford Motor Co | Morgan Stanley | (894) | (492) | Fulgent Genetics Inc | Goldman Sachs | (1.122) |
| (58) | Forma Therapeutics Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 48 | 898 | Fulton Financial Corp | Goldman Sachs | 665 |
| (27) | FormFactor Inc | Bank of America Merrill Lynch | (11) | 38 | Funko Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 18 |
| (181) | FormFactor Inc | Goldman Sachs | (257) | 652 | Funko Inc 'A' | Goldman Sachs | 313 |
| 599 | Forrester Research Inc | Goldman Sachs | 791 | (996) | Futu Holdings Ltd ADR | Morgan Stanley | (2.933) |
| (46) | Fortinet Inc | Goldman Sachs | (2) | (48) | FutureFuel Corp | Goldman Sachs | (24) |
| (216) | Fortive Corp | Morgan Stanley | (503) | 43 | G1 Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 43 |
| (160) | Fortune Brands Home & Security Inc | Bank of America Merrill Lynch | (159) | (295) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (602) |
| (261) | Fortune Brands Home & Security Inc | Goldman Sachs | (131) | (695) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (1.418) |
| (112) | Fortune Brands Home & Security Inc | Morgan Stanley | (200) | (312) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (796) |
| (34) | Forward Air Corp | Goldman Sachs | 95 | (1.355) | GAN Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 88 |
| (123) | Four Corners Property Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (86) | (1.745) | GAN Ltd | Goldman Sachs | 312 |
| (145) | Four Corners Property Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (102) | (1.812) | Gannett Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 109 |
| 999 | Fox Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.669 | (907) | Gannett Co Inc | Goldman Sachs | 54 |
| 3.038 | Fox Corp 'A' | Goldman Sachs | 5.404 | 2.232 | Gap Inc | Bank of America Merrill Lynch | 970 |
| 2.803 | Fox Corp 'A' | Morgan Stanley | 3.392 | 3.115 | Gap Inc | Goldman Sachs | (2.571) |
| 865 | Fox Corp 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 1.403 | 4.763 | Gap Inc | Morgan Stanley | 2.572 |
| 679 | Fox Corp 'B' | Goldman Sachs | 1.052 | 64 | Garmin Ltd | Goldman Sachs | 188 |
| 681 | Fox Corp 'B' | Morgan Stanley | 708 | 650 | Garmin Ltd | Morgan Stanley | 1.739 |
| 166 | Fox Factory Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | (480) | (13) | Gartner Inc | Bank of America Merrill Lynch | (168) |
| | | | | (13) | Gartner Inc | Goldman Sachs | (159) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|----------------------------------|---|---|--------------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (92) | Gartner Inc | Morgan Stanley | (1.164) | 34 | Glaukos Corp | Goldman Sachs | 39 |
| (1.137) | Gatos Silver Inc | Bank of America Merrill Lynch | (190) | 309 | Global Blood Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (723) |
| (1.565) | Gatos Silver Inc | Goldman Sachs | (249) | 163 | Global Blood Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (377) |
| (35) | GATX Corp | Bank of America Merrill Lynch | 198 | 11 | Global Indemnity Group LLC 'A' | Goldman Sachs | 15 |
| (180) | GATX Corp | Goldman Sachs | 1.017 | 67 | Global Industrial Co | Bank of America Merrill Lynch | 43 |
| 266 | Genco Shipping & Trading Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 984 | 63 | Global Industrial Co | Goldman Sachs | 25 |
| 247 | Genco Shipping & Trading Ltd | Goldman Sachs | 914 | (199) | Global Medical Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (2) |
| (75) | Generac Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.076) | (466) | Global Medical Inc (REIT) | Goldman Sachs | (5) |
| (95) | Generac Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.601) | 25 | Global Payments Inc | Goldman Sachs | 162 |
| 679 | General Electric Co | Bank of America Merrill Lynch | 2.873 | 242 | Global Payments Inc | Morgan Stanley | 1.437 |
| 173 | General Electric Co | Goldman Sachs | 554 | (337) | Global-e Online Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (256) |
| 1.054 | General Electric Co | Morgan Stanley | 3.541 | (119) | Global-e Online Ltd | Goldman Sachs | (90) |
| (191) | General Mills Inc | Bank of America Merrill Lynch | (33) | (790) | Global-e Online Ltd | Morgan Stanley | (419) |
| (1.501) | General Mills Inc | Morgan Stanley | (2.282) | (94) | GLOBALFOUNDRIES Inc | Morgan Stanley | (426) |
| (2.409) | General Motors Co | Bank of America Merrill Lynch | (5.738) | (19.307) | Globalstar Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.089) |
| (437) | General Motors Co | Goldman Sachs | (1.001) | (38) | Globant SA | Bank of America Merrill Lynch | 195 |
| (340) | General Motors Co | Morgan Stanley | (775) | 273 | Globus Medical Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 625 |
| (409) | Generation Bio Co | Bank of America Merrill Lynch | 123 | 496 | Globus Medical Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.136 |
| (210) | Generation Bio Co | Goldman Sachs | 63 | 120 | Globus Medical Inc 'A' | Morgan Stanley | 47 |
| (200) | Genesco Inc | Bank of America Merrill Lynch | 276 | 23 | GMS Inc | Bank of America Merrill Lynch | 46 |
| (248) | Genesco Inc | Goldman Sachs | 342 | (194) | GoDaddy Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (665) |
| (1.848) | Gentex Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.905) | (227) | GoDaddy Inc 'A' | Goldman Sachs | (779) |
| (174) | Gentex Corp | Goldman Sachs | (226) | (451) | GoDaddy Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.263) |
| (312) | Gentex Corp | Morgan Stanley | (399) | 91 | Gogo Inc | Bank of America Merrill Lynch | 250 |
| (80) | Gentherm Inc | Bank of America Merrill Lynch | (118) | 633 | Gogo Inc | Goldman Sachs | 1.706 |
| (604) | Gentherm Inc | Goldman Sachs | (894) | (818) | GoHealth Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (174) |
| (567) | Genuine Parts Co | Bank of America Merrill Lynch | (1.342) | (299) | GoHealth Inc 'A' | Goldman Sachs | (64) |
| (171) | Genuine Parts Co | Goldman Sachs | (1.071) | (344) | Golar LNG Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (764) |
| (605) | Genuine Parts Co | Morgan Stanley | (3.642) | (147) | Golar LNG Ltd | Goldman Sachs | (318) |
| (10) | German American Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (28) | (205) | Golar LNG Ltd | Morgan Stanley | (514) |
| (2.296) | Geron Corp | Bank of America Merrill Lynch | 92 | 112 | Golden Entertainment Inc | Bank of America Merrill Lynch | 240 |
| (661) | Geron Corp | Goldman Sachs | 26 | (3) | Goldman Sachs Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (70) |
| 388 | Getty Realty Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 319 | (187) | Goldman Sachs Group Inc | Morgan Stanley | (1.887) |
| 307 | Getty Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | 258 | 1.705 | Goodyear Tire & Rubber Co | Bank of America Merrill Lynch | 1.279 |
| (5.924) | Gevo Inc | Goldman Sachs | (3.199) | 702 | Goodyear Tire & Rubber Co | Goldman Sachs | 526 |
| 389 | Gibraltar Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.517 | 3.148 | Goodyear Tire & Rubber Co | Morgan Stanley | 2.235 |
| 513 | Gibraltar Industries Inc | Goldman Sachs | 2.001 | (109) | Goosehead Insurance Inc 'A' | Goldman Sachs | (556) |
| 427 | G-III Apparel Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 138 | 697 | GoPro Inc 'A' | Goldman Sachs | (28) |
| 407 | G-III Apparel Group Ltd | Goldman Sachs | 86 | (12) | Gorman-Rupp Co | Bank of America Merrill Lynch | 8 |
| 556 | Gilead Sciences Inc | Morgan Stanley | 133 | (2.504) | Grab Holdings Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (238) |
| (378) | Gitlab Inc 'A' | Goldman Sachs | (552) | (5.000) | Grab Holdings Ltd 'A' | Morgan Stanley | 1.100 |
| (61) | Gitlab Inc 'A' | Morgan Stanley | (210) | (536) | Graco Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.227) |
| (12) | Glacier Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (33) | (218) | Graco Inc | Goldman Sachs | (473) |
| (150) | Glacier Bancorp Inc | Goldman Sachs | (416) | (788) | Graco Inc | Morgan Stanley | (1.458) |
| (43) | Gladstone Commercial Corp (REIT) | Goldman Sachs | (8) | (654) | GraffTech International Ltd | Goldman Sachs | (235) |
| 104 | Gladstone Land Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 180 | (1) | Graham Holdings Co 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (7) |
| 193 | Gladstone Land Corp (REIT) | Goldman Sachs | 178 | (6) | Graham Holdings Co 'B' | Goldman Sachs | (41) |
| (587) | Glatfelter Corp | Goldman Sachs | (505) | (101) | Grand Canyon Education Inc | Bank of America Merrill Lynch | (184) |
| 284 | Glaukos Corp | Bank of America Merrill Lynch | 567 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|----------------------------------|---|---|--|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (174) | Grand Canyon Education Inc | Goldman Sachs | (317) | (667) | Halliburton Co | Morgan Stanley | (2.155) |
| 288 | Granite Construction Inc | Bank of America Merrill Lynch | 466 | 530 | Halozyyme Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 3.021 |
| 479 | Granite Construction Inc | Goldman Sachs | 785 | (55) | Hamilton Lane Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (274) |
| 70 | Granite Point Mortgage Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 40 | (10) | Hamilton Lane Inc 'A' | Goldman Sachs | (50) |
| (3.061) | Graphic Packaging Holding Co | Morgan Stanley | (5.142) | (185) | Hancock Whitney Corp | Bank of America Merrill Lynch | (544) |
| 685 | Gray Television Inc | Bank of America Merrill Lynch | (191) | (149) | Hancock Whitney Corp | Goldman Sachs | (381) |
| 121 | Gray Television Inc | Goldman Sachs | (31) | 1.711 | Hanesbrands Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.222) |
| 95 | Great Lakes Dredge & Dock Corp | Bank of America Merrill Lynch | 57 | 225 | Hanesbrands Inc | Goldman Sachs | 20 |
| (56) | Great Southern Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (70) | 2.559 | Hanesbrands Inc | Morgan Stanley | 364 |
| (9) | Great Southern Bancorp Inc | Goldman Sachs | (1) | 32 | Hanger Inc | Bank of America Merrill Lynch | 17 |
| 558 | Green Brick Partners Inc | Goldman Sachs | 870 | 115 | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | 227 |
| (105) | Greenbrier Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | 120 | 190 | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT) | Morgan Stanley | 359 |
| (184) | Greif Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 201 | (17) | Hanover Insurance Group Inc | Morgan Stanley | (34) |
| (809) | Greif Inc 'A' | Goldman Sachs | 882 | (80) | HarborOne Bancorp Inc | Goldman Sachs | (35) |
| (37) | Greif Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (24) | 384 | Harley-Davidson Inc | Bank of America Merrill Lynch | 465 |
| (20) | Greif Inc 'B' | Goldman Sachs | (13) | 1.401 | Harley-Davidson Inc | Goldman Sachs | (1.877) |
| (160) | Grid Dynamics Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (309) | 1.103 | Harley-Davidson Inc | Morgan Stanley | 3.085 |
| (247) | Grid Dynamics Holdings Inc | Goldman Sachs | (477) | (49) | Harmonic Inc | Bank of America Merrill Lynch | (30) |
| 747 | Griffon Corp | Goldman Sachs | 568 | 57 | Harmony Biosciences Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 254 |
| 35 | Grocery Outlet Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | 77 | 419 | Harmony Biosciences Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.865 |
| 225 | Grocery Outlet Holding Corp | Goldman Sachs | 495 | 1.550 | Harsco Corp | Bank of America Merrill Lynch | 518 |
| 55 | Group 1 Automotive Inc | Bank of America Merrill Lynch | (52) | 1.471 | Harsco Corp | Goldman Sachs | 446 |
| 118 | Group 1 Automotive Inc | Goldman Sachs | (112) | 314 | Hartford Financial Services Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 835 |
| (98) | Groupon Inc | Goldman Sachs | (105) | 432 | Hartford Financial Services Group Inc | Goldman Sachs | 1.557 |
| 312 | GrowGeneration Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3 | 1.185 | Hartford Financial Services Group Inc | Morgan Stanley | 3.958 |
| (104) | Guardant Health Inc | Bank of America Merrill Lynch | (412) | (249) | Hasbro Inc | Bank of America Merrill Lynch | 392 |
| (123) | Guardant Health Inc | Goldman Sachs | (584) | (1.703) | Hasbro Inc | Goldman Sachs | 4.274 |
| (419) | Guardant Health Inc | Morgan Stanley | (1.101) | (294) | Hasbro Inc | Morgan Stanley | (943) |
| (60) | Guess? Inc | Bank of America Merrill Lynch | 19 | 416 | Haverty Furniture Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | (116) |
| 308 | Guidewire Software Inc | Bank of America Merrill Lynch | 265 | 987 | Haverty Furniture Cos Inc | Goldman Sachs | (276) |
| 643 | Guidewire Software Inc | Goldman Sachs | 553 | (1.078) | Hawaiian Electric Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (481) |
| 353 | Guidewire Software Inc | Morgan Stanley | 932 | (1.019) | Hawaiian Electric Industries Inc | Goldman Sachs | (515) |
| 13 | Gulfport Energy Corp | Bank of America Merrill Lynch | 127 | 746 | Hawaiian Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.154 |
| 82 | Gulfport Energy Corp | Goldman Sachs | 802 | 1.329 | Hawaiian Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.392 |
| (259) | GXO Logistics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (583) | 95 | Hawkins Inc | Bank of America Merrill Lynch | (119) |
| 7 | GXO Logistics Inc | Goldman Sachs | (1.573) | 166 | Hawkins Inc | Goldman Sachs | (208) |
| (666) | GXO Logistics Inc | Morgan Stanley | (2.211) | (952) | Hayward Holdings Inc | Goldman Sachs | (823) |
| 680 | H&E Equipment Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.040 | (301) | HB Fuller Co | Bank of America Merrill Lynch | (1.785) |
| 574 | H&E Equipment Services Inc | Goldman Sachs | 878 | (739) | HB Fuller Co | Goldman Sachs | (4.382) |
| 54 | Hackett Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (61) | (70) | HCA Healthcare Inc | Bank of America Merrill Lynch | (494) |
| 53 | Hackett Group Inc | Goldman Sachs | (60) | (98) | HCA Healthcare Inc | Goldman Sachs | (186) |
| (169) | Haemonetics Corp | Bank of America Merrill Lynch | (915) | (510) | HCA Healthcare Inc | Morgan Stanley | (4.351) |
| (121) | Haemonetics Corp | Goldman Sachs | (611) | 348 | Health Catalyst Inc | Bank of America Merrill Lynch | (28) |
| 1.076 | Hain Celestial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 474 | | | | |
| 711 | Hain Celestial Group Inc | Goldman Sachs | 294 | | | | |
| (759) | Halliburton Co | Goldman Sachs | (2.795) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|---------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 721 | Health Catalyst Inc | Goldman Sachs | (58) | (488) | Hershey Co | Goldman Sachs | 9.457 |
| 559 | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 131 | (74) | Hershey Co | Morgan Stanley | 74 |
| 412 | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 95 | 742 | Hertz Global Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 574 |
| 324 | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | — | 141 | Heska Corp | Bank of America Merrill Lynch | 849 |
| (375) | Healthcare Services Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 135 | 209 | Heska Corp | Goldman Sachs | 1.258 |
| (638) | Healthcare Services Group Inc | Goldman Sachs | 230 | 25 | Hess Corp | Goldman Sachs | 331 |
| (824) | Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT) | Morgan Stanley | (222) | 194 | Hess Corp | Morgan Stanley | 1.924 |
| 519 | HealthEquity Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.922 | (25) | Hess Midstream LP 'A' | Goldman Sachs | (81) |
| 372 | HealthEquity Inc | Goldman Sachs | 2.094 | 1.586 | Hewlett Packard Enterprise Co | Bank of America Merrill Lynch | (115) |
| 376 | HealthEquity Inc | Morgan Stanley | 1.068 | 1.269 | Hewlett Packard Enterprise Co | Goldman Sachs | 548 |
| 537 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (295) | 1.332 | Hewlett Packard Enterprise Co | Morgan Stanley | 1.406 |
| 243 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (134) | 235 | Hexcel Corp | Goldman Sachs | 1.128 |
| 39 | HealthStream Inc | Goldman Sachs | 48 | 665 | Hexcel Corp | Morgan Stanley | 2.640 |
| 142 | Heartland Express Inc | Bank of America Merrill Lynch | 26 | (316) | HF Sinclair Corp | Goldman Sachs | (1.049) |
| 240 | Heartland Express Inc | Goldman Sachs | 43 | (585) | Hibbett Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.487) |
| 299 | Heartland Financial USA Inc | Bank of America Merrill Lynch | 545 | (1.155) | Hibbett Inc | Goldman Sachs | (6.884) |
| 493 | Heartland Financial USA Inc | Goldman Sachs | 912 | 215 | Highwoods Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 97 |
| 1.063 | Hecla Mining Co | Bank of America Merrill Lynch | 308 | (953) | Hillenbrand Inc | Bank of America Merrill Lynch | 86 |
| 4.778 | Hecla Mining Co | Goldman Sachs | 1.386 | (1.867) | Hillenbrand Inc | Goldman Sachs | 168 |
| 153 | HEICO Corp | Bank of America Merrill Lynch | 973 | (1.748) | Hillman Solutions Corp | Bank of America Merrill Lynch | (690) |
| 205 | HEICO Corp | Goldman Sachs | 1.304 | (346) | Hillman Solutions Corp | Goldman Sachs | (135) |
| 76 | HEICO Corp | Morgan Stanley | 531 | 126 | Hilltop Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 21 |
| 32 | HEICO Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 203 | 122 | Hilltop Holdings Inc | Goldman Sachs | 21 |
| 943 | HEICO Corp 'A' | Goldman Sachs | 5.969 | (244) | Hilton Grand Vacations Inc | Bank of America Merrill Lynch | (858) |
| 633 | HEICO Corp 'A' | Morgan Stanley | 4.247 | (1.241) | Hilton Grand Vacations Inc | Goldman Sachs | (3.065) |
| (20) | Heidrick & Struggles International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (60) | (259) | Hilton Grand Vacations Inc | Morgan Stanley | (1.080) |
| (50) | Heidrick & Struggles International Inc | Goldman Sachs | (151) | (292) | Hims & Hers Health Inc | Bank of America Merrill Lynch | (158) |
| (12) | Helen of Troy Ltd | Morgan Stanley | (14) | (5.245) | Hippo Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.416 |
| (90) | Helios Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (15) | (8.573) | Hippo Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.315 |
| (149) | Helios Technologies Inc | Goldman Sachs | (138) | (2) | HNI Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3) |
| 2.569 | Helix Energy Solutions Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.204 | (921) | HNI Corp | Goldman Sachs | (1.428) |
| 1.926 | Helix Energy Solutions Group Inc | Goldman Sachs | 892 | 617 | Holley Inc | Bank of America Merrill Lynch | 111 |
| 203 | Helmerich & Payne Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.013 | 1.840 | Holley Inc | Goldman Sachs | 331 |
| 257 | Helmerich & Payne Inc | Goldman Sachs | 968 | 158 | Hologic Inc | Bank of America Merrill Lynch | (270) |
| 708 | Helmerich & Payne Inc | Morgan Stanley | 2.439 | 162 | Hologic Inc | Goldman Sachs | (395) |
| (225) | Henry Schein Inc | Morgan Stanley | (41) | 111 | Hologic Inc | Morgan Stanley | (366) |
| 2.010 | Herbalife Nutrition Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.040 | (70) | Home BancShares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (146) |
| 1.353 | Herbalife Nutrition Ltd | Goldman Sachs | 607 | (259) | Home BancShares Inc | Goldman Sachs | (539) |
| 191 | Herc Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.791 | (137) | Home Depot Inc | Goldman Sachs | (2.014) |
| 249 | Herc Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.548 | (53) | Home Depot Inc | Morgan Stanley | 35 |
| 48 | Heritage Commerce Corp | Goldman Sachs | 11 | (165) | Homology Medicines Inc | Bank of America Merrill Lynch | (29) |
| 190 | Heritage-Crystal Clean Inc | Bank of America Merrill Lynch | 156 | (1.042) | Honest Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (135) |
| 225 | Heritage-Crystal Clean Inc | Goldman Sachs | 184 | (253) | Honeywell International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (235) |
| 355 | Heron Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (64) | (394) | Honeywell International Inc | Goldman Sachs | (1.420) |
| 764 | Heron Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (138) | (127) | Honeywell International Inc | Morgan Stanley | (522) |
| (93) | Hershey Co | Bank of America Merrill Lynch | 81 | (170) | Hope Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (44) |
| | | | | 474 | Horizon Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 289 |
| | | | | 647 | Horizon Bancorp Inc | Goldman Sachs | 395 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------------|-----------------|---|---|--------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 243 | Horizon Therapeutics Plc | Bank of America | | (773) | IAA Inc | Goldman Sachs | (1.161) |
| | | Merrill Lynch | 372 | (1.106) | IAA Inc | Morgan Stanley | (439) |
| 218 | Horizon Therapeutics Plc | Goldman Sachs | 403 | (307) | IAC Holdings Inc | Bank of America | |
| 29 | Horizon Therapeutics Plc | Morgan Stanley | 144 | | | Merrill Lynch | (1.431) |
| 1.037 | Hormel Foods Corp | Bank of America | | (642) | IAC Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.992) |
| | | Merrill Lynch | 325 | (997) | IAC Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.954) |
| 1.080 | Hormel Foods Corp | Goldman Sachs | (697) | (22) | ICF International Inc | Bank of America | |
| 825 | Hormel Foods Corp | Morgan Stanley | (355) | | | Merrill Lynch | (112) |
| (1.910) | Host Hotels & Resorts Inc (REIT) | | | (23) | ICF International Inc | Goldman Sachs | (117) |
| | | Morgan Stanley | (2.579) | 36 | ICON Plc | Bank of America | |
| (348) | Hostess Brands Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 506 |
| | | Merrill Lynch | 444 | 7 | ICON Plc | Goldman Sachs | 98 |
| (135) | Hostess Brands Inc | Goldman Sachs | 172 | 70 | ICON Plc | Morgan Stanley | 490 |
| 30 | Houlihan Lokey Inc | Goldman Sachs | (13) | (1.120) | Icosavax Inc | Goldman Sachs | (2.117) |
| 127 | Houlihan Lokey Inc | Morgan Stanley | 70 | (10) | ICU Medical Inc | Goldman Sachs | 27 |
| (59) | Hovnanian Enterprises Inc 'A' | Bank of America | | (39) | ICU Medical Inc | Morgan Stanley | 103 |
| | | Merrill Lynch | (316) | 418 | IDACORP Inc | Morgan Stanley | 761 |
| (209) | Hovnanian Enterprises Inc 'A' | | | (10.055) | Ideanomics Inc | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | (1.120) | | | Merrill Lynch | (311) |
| (132) | Howard Hughes Corp | Bank of America | | (372) | Ideanomics Inc | Goldman Sachs | (11) |
| | | Merrill Lynch | 267 | 219 | Ideaya Biosciences Inc | Bank of America | |
| (418) | Howard Hughes Corp | Goldman Sachs | 844 | | | Merrill Lynch | 72 |
| (74) | Howmet Aerospace Inc | Bank of America | | 297 | Ideaya Biosciences Inc | Goldman Sachs | 98 |
| | | Merrill Lynch | (200) | (30) | IDEX Corp | Bank of America | |
| (679) | Howmet Aerospace Inc | Goldman Sachs | (971) | | | Merrill Lynch | (93) |
| (4.167) | Howmet Aerospace Inc | Morgan Stanley | (5.178) | (149) | IDEX Corp | Goldman Sachs | (463) |
| 156 | HP Inc | Bank of America | | (253) | IDEX Corp | Morgan Stanley | (779) |
| | | Merrill Lynch | 172 | 38 | IDEXX Laboratories Inc | Bank of America | |
| 238 | Hub Group Inc 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.039 |
| | | Merrill Lynch | 148 | 177 | IDEXX Laboratories Inc | Goldman Sachs | 5.560 |
| 163 | Hub Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 101 | 113 | IDEXX Laboratories Inc | Morgan Stanley | 2.809 |
| (452) | Hubbell Inc | Bank of America | | 25 | IDT Corp 'B' | Goldman Sachs | 32 |
| | | Merrill Lynch | 2.513 | (59) | IES Holdings Inc | Bank of America | |
| (67) | Hubbell Inc | Goldman Sachs | 373 | | | Merrill Lynch | (80) |
| 47 | HubSpot Inc | Bank of America | | (31) | IES Holdings Inc | Goldman Sachs | (42) |
| | | Merrill Lynch | 193 | (25) | IGM Biosciences Inc | Bank of America | |
| 143 | HubSpot Inc | Morgan Stanley | 419 | | | Merrill Lynch | (39) |
| (3.068) | Hudson Pacific Properties Inc (REIT) | Bank of America | | (51) | iHeartMedia Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.322 | | | Merrill Lynch | 32 |
| (781) | Hudson Pacific Properties Inc (REIT) | | | (232) | II-VI Inc | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | 406 | | | Merrill Lynch | (1.049) |
| (1.642) | Hudson Pacific Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 441 | (165) | II-VI Inc | Goldman Sachs | (167) |
| 18 | Humana Inc | Bank of America | | (643) | II-VI Inc | Morgan Stanley | (683) |
| | | Merrill Lynch | 534 | 58 | Illinois Tool Works Inc | Bank of America | |
| 11 | Humana Inc | Goldman Sachs | 183 | | | Merrill Lynch | (185) |
| 139 | Humana Inc | Morgan Stanley | 2.250 | 282 | Illinois Tool Works Inc | Morgan Stanley | 392 |
| (239) | Humanigen Inc | Bank of America | | 18 | Illumina Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (135) | | | Merrill Lynch | 174 |
| 678 | Huntington Ingalls Industries Inc | | | 113 | Illumina Inc | Goldman Sachs | 1.095 |
| | | Morgan Stanley | 6.699 | 120 | Illumina Inc | Morgan Stanley | (197) |
| 353 | Huntsman Corp | Bank of America | | (66) | Imago Biosciences Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 237 | | | Merrill Lynch | (63) |
| 815 | Huntsman Corp | Goldman Sachs | 546 | (249) | Imago Biosciences Inc | Goldman Sachs | (239) |
| (21) | Huron Consulting Group Inc | Bank of America | | (820) | IMAX Corp | Goldman Sachs | (1.222) |
| | | Merrill Lynch | (26) | (1.941) | ImmunityBio Inc | Goldman Sachs | 116 |
| 77 | Hyatt Hotels Corp 'A' | Bank of America | | 1.748 | ImmunoGen Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 495 | | | Merrill Lynch | (70) |
| 37 | Hyatt Hotels Corp 'A' | Goldman Sachs | 238 | 1.682 | ImmunoGen Inc | Goldman Sachs | (67) |
| 291 | Hyatt Hotels Corp 'A' | Morgan Stanley | 1.461 | (217) | Immunovant Inc | Bank of America | |
| (67) | Hydrofarm Holdings Group Inc | | | | | Merrill Lynch | (39) |
| | | Goldman Sachs | 28 | 82 | Impinj Inc | Bank of America | |
| (1.944) | Hyllion Holdings Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 72 |
| | | Merrill Lynch | (933) | 92 | Impinj Inc | Goldman Sachs | 81 |
| (4.211) | Hyllion Holdings Corp | Goldman Sachs | (2.021) | (378) | Inari Medical Inc | Morgan Stanley | (1.338) |
| (1.008) | Hyzon Motors Inc | Bank of America | | 55 | Incyte Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.114) | | | Merrill Lynch | 26 |
| (2.588) | Hyzon Motors Inc | Goldman Sachs | (2.860) | 200 | Incyte Corp | Goldman Sachs | 270 |
| 37 | I3 Verticals Inc 'A' | Goldman Sachs | 9 | 355 | Incyte Corp | Morgan Stanley | (479) |
| (553) | IAA Inc | Bank of America | | (1.054) | Independence Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (1.223) |
| | | Merrill Lynch | (735) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (107) | Independent Bank Corp | Bank of America Merrill Lynch | (525) | 49 | Integra LifeSciences Holdings Corp | Morgan Stanley | 50 |
| 993 | Independent Bank Corp | Bank of America Merrill Lynch | 487 | 311 | Intel Corp | Goldman Sachs | 890 |
| 1.057 | Independent Bank Corp | Goldman Sachs | 518 | 115 | Intel Corp | Morgan Stanley | 223 |
| (155) | Independent Bank Corp | Goldman Sachs | (521) | (91) | Intellia Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (35) |
| (122) | indie Semiconductor Inc 'A' | Goldman Sachs | (93) | 27 | Inter Parfums Inc | Bank of America Merrill Lynch | 34 |
| (240) | Industrial Logistics Properties Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (41) | 26 | Inter Parfums Inc | Goldman Sachs | 33 |
| (538) | Industrial Logistics Properties Trust (REIT) | Goldman Sachs | (91) | 38 | Interactive Brokers Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 9 |
| 640 | Infinera Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4 | 162 | Interactive Brokers Group Inc 'A' | Morgan Stanley | 460 |
| (1.293) | Ingersoll Rand Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.209) | 341 | Intercept Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 167 |
| (569) | Ingersoll Rand Inc | Goldman Sachs | (1.328) | 706 | Intercept Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 346 |
| (808) | Ingersoll Rand Inc | Morgan Stanley | (1.543) | 465 | Intercontinental Exchange Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.175 |
| 268 | Ingevity Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.131 | 466 | Intercontinental Exchange Inc | Goldman Sachs | 2.336 |
| 275 | Ingevity Corp | Goldman Sachs | 1.160 | 317 | Intercontinental Exchange Inc | Goldman Sachs | 2.336 |
| (229) | Ingles Markets Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 879 | 39 | InterDigital Inc | Morgan Stanley | 1.271 |
| (369) | Ingles Markets Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.648 | | | Bank of America Merrill Lynch | 142 |
| (204) | Ingredion Inc | Bank of America Merrill Lynch | (520) | (2.205) | Interface Inc | Goldman Sachs | (2.205) |
| (238) | Ingredion Inc | Goldman Sachs | (624) | (27) | International Bancshares Corp | Bank of America Merrill Lynch | (42) |
| (331) | Ingredion Inc | Morgan Stanley | (463) | (15) | International Bancshares Corp | Goldman Sachs | (24) |
| (42) | Inhibrx Inc | Bank of America Merrill Lynch | 18 | (199) | International Business Machines Corp | Bank of America Merrill Lynch | (552) |
| (414) | Inmode Ltd | Goldman Sachs | (1.453) | (408) | International Business Machines Corp | Morgan Stanley | (2.807) |
| (975) | Inmode Ltd | Morgan Stanley | (2.974) | (169) | International Flavors & Fragrances Inc | Bank of America Merrill Lynch | (451) |
| 78 | Innospec Inc | Goldman Sachs | 8 | (72) | International Flavors & Fragrances Inc | Goldman Sachs | (140) |
| (414) | Innovative Industrial Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 193 | (101) | International Flavors & Fragrances Inc | Morgan Stanley | (154) |
| (111) | Innovative Industrial Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (487) | 1.494 | International Game Technology Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.619 |
| 398 | Innoviva Inc | Bank of America Merrill Lynch | (363) | 1.583 | International Game Technology Plc | Goldman Sachs | 2.123 |
| 804 | Innoviva Inc | Goldman Sachs | (724) | 2.118 | International Game Technology Plc | Morgan Stanley | 1.758 |
| 26 | Inogen Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2) | 838 | International Money Express Inc | Bank of America Merrill Lynch | 696 |
| (171) | Inovio Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (10) | 712 | International Money Express Inc | Goldman Sachs | 591 |
| (833) | Inseego Corp | Bank of America Merrill Lynch | 133 | (317) | International Paper Co | Bank of America Merrill Lynch | (587) |
| (378) | Inseego Corp | Goldman Sachs | 60 | (695) | International Paper Co | Goldman Sachs | (450) |
| (32) | Insight Enterprises Inc | Bank of America Merrill Lynch | 38 | (2.449) | International Paper Co | Morgan Stanley | (1.298) |
| (88) | Insight Enterprises Inc | Goldman Sachs | 104 | 284 | International Seaways Inc | Goldman Sachs | 310 |
| (106) | Insmed Inc | Bank of America Merrill Lynch | 21 | (134) | Interpublic Group of Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | (331) |
| (135) | Insmed Inc | Goldman Sachs | 27 | (453) | Interpublic Group of Cos Inc | Goldman Sachs | (212) |
| 16 | Insperty Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2 | (123) | Interpublic Group of Cos Inc | Morgan Stanley | (96) |
| 23 | Insperty Inc | Goldman Sachs | 47 | (481) | Intra-Cellular Therapies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 122 |
| (77) | Inspire Medical Systems Inc | Goldman Sachs | (1.454) | (215) | Intra-Cellular Therapies Inc | Goldman Sachs | (38) |
| (87) | Installed Building Products Inc | Bank of America Merrill Lynch | (467) | (926) | Intra-Cellular Therapies Inc | Morgan Stanley | 732 |
| (22) | Installed Building Products Inc | Goldman Sachs | (92) | 19 | Intuit Inc | Goldman Sachs | 1.167 |
| (12) | Insteel Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4 | 128 | Intuit Inc | Morgan Stanley | 6.353 |
| (195) | Insteel Industries Inc | Goldman Sachs | 72 | (42) | Intuitive Surgical Inc | Bank of America Merrill Lynch | (141) |
| (62) | Intapp Inc | Goldman Sachs | (33) | 339 | Invesco Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 384 |
| 50 | Integer Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 371 | 435 | Invesco Ltd | Goldman Sachs | 254 |
| 51 | Integer Holdings Corp | Goldman Sachs | 379 | 2.353 | Invesco Ltd | Morgan Stanley | 1.261 |
| 816 | Integra LifeSciences Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.640 | | | | |
| 158 | Integra LifeSciences Holdings Corp | Goldman Sachs | 318 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------|-------------------------------|---|---|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 2.150 | Invitation Homes Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 3.741 | 154 | Jacobs Engineering Group Inc | Morgan Stanley | 274 |
| 1.457 | Invitation Homes Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.841 | (584) | Jamf Holding Corp | Goldman Sachs | (2.015) |
| 157 | Invitation Homes Inc (REIT) | Morgan Stanley | 223 | 900 | Janus Henderson Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 396 |
| 635 | Ionis Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 244 | 351 | Janus Henderson Group Plc | Goldman Sachs | 154 |
| 293 | Ionis Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (274) | 384 | Janus Henderson Group Plc | Morgan Stanley | 269 |
| 348 | Ionis Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (773) | (75) | Janus Parent Inc | Bank of America Merrill Lynch | (137) |
| (206) | IPG Photonics Corp | Morgan Stanley | (828) | 154 | Jazz Pharmaceuticals Plc | Bank of America Merrill Lynch | 162 |
| (13) | IQVIA Holdings Inc | Goldman Sachs | (117) | 50 | Jazz Pharmaceuticals Plc | Morgan Stanley | 135 |
| (132) | IQVIA Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.591) | (86) | JB Hunt Transport Services Inc | Morgan Stanley | (501) |
| (159) | iRhythm Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.349) | (652) | JBG SMITH Properties (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (381) |
| (128) | iRhythm Technologies Inc | Goldman Sachs | (1.081) | (389) | JBG SMITH Properties (REIT) | Goldman Sachs | (258) |
| (52) | iRhythm Technologies Inc | Morgan Stanley | (292) | 86 | JELD-WEN Holding Inc | Bank of America Merrill Lynch | 94 |
| 528 | Iridium Communications Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.896 | 535 | JELD-WEN Holding Inc | Goldman Sachs | 367 |
| 332 | Iridium Communications Inc | Goldman Sachs | 1.192 | 901 | JetBlue Airways Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.063 |
| 1.544 | Iridium Communications Inc | Morgan Stanley | 1.420 | 344 | JetBlue Airways Corp | Goldman Sachs | 406 |
| 262 | iRobot Corp | Bank of America Merrill Lynch | 264 | 2.732 | JetBlue Airways Corp | Morgan Stanley | 1.093 |
| 756 | iRobot Corp | Goldman Sachs | 881 | (1.549) | JFrog Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.757) |
| 691 | Iron Mountain Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.588 | 53 | John B Sanfilippo & Son Inc | Bank of America Merrill Lynch | 32 |
| 127 | Iron Mountain Inc (REIT) | Goldman Sachs | 360 | 12 | John B Sanfilippo & Son Inc | Goldman Sachs | 7 |
| 418 | Iron Mountain Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.339 | (19) | John Bean Technologies Corp | Bank of America Merrill Lynch | (93) |
| (1.080) | ironSource Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (184) | (35) | John Bean Technologies Corp | Goldman Sachs | (171) |
| (5.486) | ironSource Ltd 'A' | Goldman Sachs | (933) | (994) | John Wiley & Sons Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.256) |
| (3.584) | ironSource Ltd 'A' | Morgan Stanley | (573) | 254 | Johnson & Johnson | Bank of America Merrill Lynch | (752) |
| 1.495 | Ironwood Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (438) | 452 | Johnson & Johnson | Goldman Sachs | 277 |
| 873 | Ironwood Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (265) | 20 | Johnson & Johnson | Morgan Stanley | (68) |
| (478) | iStar Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (146) | 750 | Johnson Controls International Plc | Goldman Sachs | 1.785 |
| (16) | iTeos Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 18 | 103 | Johnson Controls International Plc | Morgan Stanley | 253 |
| 429 | Itron Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.536 | 45 | Johnson Outdoors Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (23) |
| 754 | Itron Inc | Goldman Sachs | 2.699 | 20 | Johnson Outdoors Inc 'A' | Goldman Sachs | (10) |
| (189) | ITT Inc | Bank of America Merrill Lynch | (735) | 454 | Joint Corp | Goldman Sachs | (143) |
| (142) | ITT Inc | Goldman Sachs | (300) | 32 | Jones Lang LaSalle Inc | Bank of America Merrill Lynch | 453 |
| (112) | ITT Inc | Morgan Stanley | (297) | 31 | Jones Lang LaSalle Inc | Goldman Sachs | 330 |
| (299) | Ituran Location and Control Ltd | Goldman Sachs | (359) | 142 | Jones Lang LaSalle Inc | Morgan Stanley | 1.120 |
| (59) | IVERIC bio Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5 | 424 | JPMorgan Chase & Co | Bank of America Merrill Lynch | 4.375 |
| (1.114) | IVERIC bio Inc | Goldman Sachs | 89 | 67 | JPMorgan Chase & Co | Goldman Sachs | 407 |
| 236 | J & J Snack Foods Corp | Bank of America Merrill Lynch | 177 | 200 | JPMorgan Chase & Co | Morgan Stanley | 1.370 |
| 94 | J & J Snack Foods Corp | Goldman Sachs | 71 | 962 | Juniper Networks Inc | Morgan Stanley | 608 |
| 82 | J M Smucker Co | Bank of America Merrill Lynch | (143) | 6 | Kadant Inc | Goldman Sachs | (2) |
| 113 | J M Smucker Co | Goldman Sachs | 94 | (16) | Kaiser Aluminum Corp | Bank of America Merrill Lynch | (44) |
| 273 | J M Smucker Co | Morgan Stanley | 393 | (48) | Kaman Corp | Bank of America Merrill Lynch | (84) |
| 177 | Jabil Inc | Bank of America Merrill Lynch | 637 | (119) | Kaman Corp | Goldman Sachs | (209) |
| 69 | Jabil Inc | Morgan Stanley | 234 | (338) | KAR Auction Services Inc | Goldman Sachs | (453) |
| (44) | Jack Henry & Associates Inc | Bank of America Merrill Lynch | (251) | (17) | Karuna Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 29 |
| (288) | Jack Henry & Associates Inc | Goldman Sachs | (1.728) | 741 | Karyopharm Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 622 |
| (268) | Jack Henry & Associates Inc | Morgan Stanley | (963) | 316 | Karyopharm Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 265 |
| (88) | Jack in the Box Inc | Goldman Sachs | 942 | 620 | KB Home | Bank of America Merrill Lynch | 860 |
| 204 | Jacobs Engineering Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.057 | | | | |
| 288 | Jacobs Engineering Group Inc | Goldman Sachs | 1.421 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 309 | KB Home | Goldman Sachs | 375 | (236) | KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT) | Bank of America | (205) |
| (1.022) | KBR Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.967) | (785) | KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT) | Merrill Lynch | (683) |
| (658) | KBR Inc | Goldman Sachs | (2.386) | 104 | KLA Corp | Goldman Sachs | 2.047 |
| (478) | KBR Inc | Morgan Stanley | (1.024) | 640 | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Morgan Stanley | 508 |
| 53 | Kearny Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 28 | (312) | KnowBe4 Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (663) |
| (207) | Kellogg Co | Bank of America Merrill Lynch | 377 | (117) | Knowles Corp | Goldman Sachs | (39) |
| (374) | Kellogg Co | Goldman Sachs | 526 | (232) | Kodiak Sciences Inc | Goldman Sachs | (72) |
| 25 | Kelly Services Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 13 | 199 | Kontoor Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | (649) |
| 258 | Kemper Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.166 | 380 | Kontoor Brands Inc | Goldman Sachs | (1.092) |
| 403 | Kemper Corp | Goldman Sachs | 2.040 | 48 | Koppers Holdings Inc | Goldman Sachs | 101 |
| 315 | Kennametal Inc | Bank of America Merrill Lynch | 454 | (236) | Korn Ferry | Bank of America Merrill Lynch | (314) |
| 1.190 | Kennametal Inc | Goldman Sachs | 1.946 | (972) | Korn Ferry | Goldman Sachs | (1.314) |
| (1.125) | Kennedy-Wilson Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (393) | (249) | Kornit Digital Ltd | Morgan Stanley | (401) |
| (350) | Kennedy-Wilson Holdings Inc | Goldman Sachs | (115) | 652 | Kraft Heinz Co | Bank of America Merrill Lynch | (2.524) |
| (17) | Keros Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 169 | 556 | Kraft Heinz Co | Goldman Sachs | (908) |
| 783 | Keurig Dr Pepper Inc | Bank of America Merrill Lynch | (718) | 1.215 | Kraft Heinz Co | Morgan Stanley | (1.780) |
| 162 | Keurig Dr Pepper Inc | Goldman Sachs | (83) | 1.078 | Kratos Defense & Security Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.840 |
| 1.428 | Keurig Dr Pepper Inc | Morgan Stanley | (500) | 833 | Kratos Defense & Security Solutions Inc | Goldman Sachs | 852 |
| 472 | KeyCorp | Bank of America Merrill Lynch | 552 | 86 | Krispy Kreme Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5 |
| 369 | KeyCorp | Goldman Sachs | 432 | 181 | Krispy Kreme Inc | Goldman Sachs | 11 |
| 719 | KeyCorp | Morgan Stanley | 539 | 81 | Kroger Co | Bank of America Merrill Lynch | 136 |
| 9 | Keysight Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 48 | (23) | Kronos Worldwide Inc | Goldman Sachs | (65) |
| 311 | Keysight Technologies Inc | Goldman Sachs | 3.053 | (73) | Krystral Biotech Inc | Bank of America Merrill Lynch | (154) |
| 686 | Keysight Technologies Inc | Morgan Stanley | 3.451 | (43) | Krystral Biotech Inc | Goldman Sachs | (11) |
| 22 | Kforce Inc | Bank of America Merrill Lynch | (170) | (938) | Kulicke & Soffa Industries Inc | Goldman Sachs | (2.214) |
| 43 | Kforce Inc | Goldman Sachs | (332) | (110) | Kura Oncology Inc | Goldman Sachs | (188) |
| 381 | Kilroy Realty Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 759 | (45) | Kymera Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 86 |
| 570 | Kilroy Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | 504 | (1.925) | Kyndryl Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (443) |
| (1.768) | Kimball Electronics Inc | Goldman Sachs | (2.307) | (895) | L Brands Inc | Goldman Sachs | 5.874 |
| 56 | Kimball International Inc 'B' | Goldman Sachs | 5 | (468) | L Brands Inc | Morgan Stanley | (1.505) |
| (117) | Kimberly-Clark Corp | Bank of America Merrill Lynch | (316) | (74) | Laboratory Corp of America Holdings | Bank of America Merrill Lynch | (343) |
| (33) | Kimberly-Clark Corp | Goldman Sachs | (6) | (164) | Laboratory Corp of America Holdings | Goldman Sachs | (668) |
| (572) | Kimberly-Clark Corp | Morgan Stanley | (1.081) | (70) | Laboratory Corp of America Holdings | Morgan Stanley | (45) |
| 442 | Kimco Realty Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 128 | (109) | Ladder Capital Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (13) |
| 428 | Kimco Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | 124 | 816 | Lakeland Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 283 |
| 1.571 | Kinder Morgan Inc | Morgan Stanley | 1.273 | 538 | Lakeland Bancorp Inc | Goldman Sachs | 257 |
| (210) | Kiniksa Pharmaceuticals Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 105 | (28) | Lakeland Financial Corp | Goldman Sachs | (53) |
| (184) | Kiniksa Pharmaceuticals Ltd 'A' | Goldman Sachs | 92 | 66 | Lam Research Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.527 |
| (71) | Kinnate Biopharma Inc | Goldman Sachs | 186 | 30 | Lam Research Corp | Goldman Sachs | 1.049 |
| (176) | Kinsale Capital Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.180) | 16 | Lam Research Corp | Morgan Stanley | 585 |
| (52) | Kinsale Capital Group Inc | Goldman Sachs | (473) | 160 | Lamar Advertising Co 'A' (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (134) |
| (240) | Kinsale Capital Group Inc | Morgan Stanley | (2.031) | 163 | Lamar Advertising Co 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (156) |
| 226 | Kirby Corp | Bank of America Merrill Lynch | 805 | 80 | Lamar Advertising Co 'A' (REIT) | Morgan Stanley | 204 |
| 100 | Kirby Corp | Goldman Sachs | 356 | (215) | Lamb Weston Holdings Inc | Goldman Sachs | (748) |
| 684 | Kite Realty Group Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (404) | (41) | Lancaster Colony Corp | Bank of America Merrill Lynch | 539 |
| 102 | Kite Realty Group Trust (REIT) | Goldman Sachs | (60) | (27) | Lancaster Colony Corp | Goldman Sachs | 355 |
| 152 | Kite Realty Group Trust (REIT) | Morgan Stanley | 179 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|----------------------------------|---|---|---|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 69 | Lands' End Inc | Goldman Sachs | (43) | (541) | Liberty Broadband Corp 'C' | Morgan Stanley | (3.370) |
| (32) | Landstar System Inc | Bank of America Merrill Lynch | 131 | 1.359 | Liberty Global Plc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 2.262 |
| (291) | Landstar System Inc | Goldman Sachs | 297 | 2.932 | Liberty Global Plc 'A' | Goldman Sachs | 5.408 |
| (29) | Landstar System Inc | Morgan Stanley | (56) | 1.792 | Liberty Global Plc 'A' | Morgan Stanley | 3.046 |
| (400) | Lantheus Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.291) | 343 | Liberty Global Plc 'C' | Bank of America Merrill Lynch | 659 |
| (133) | Lantheus Holdings Inc | Goldman Sachs | (572) | 726 | Liberty Global Plc 'C' | Goldman Sachs | 1.394 |
| (34) | Lantheus Holdings Inc | Morgan Stanley | (114) | 512 | Liberty Global Plc 'C' | Morgan Stanley | 942 |
| 142 | Laredo Petroleum Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.747 | 220 | Liberty Latin America Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 169 |
| 123 | Laredo Petroleum Inc | Goldman Sachs | 3.246 | 94 | Liberty Latin America Ltd 'A' | Goldman Sachs | 72 |
| 742 | Las Vegas Sands Corp | Goldman Sachs | 1.759 | 322 | Liberty Latin America Ltd 'C' | Bank of America Merrill Lynch | 212 |
| (296) | Latch Inc | Bank of America Merrill Lynch | 84 | 239 | Liberty Latin America Ltd 'C' | Goldman Sachs | 97 |
| (6.398) | Latch Inc | Goldman Sachs | 1.823 | 111 | Liberty Media Corp-Liberty Braves 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (22) |
| 28 | Latham Group Inc | Goldman Sachs | (28) | 156 | Liberty Media Corp-Liberty Braves 'A' | Goldman Sachs | (31) |
| (276) | Lattice Semiconductor Corp | Bank of America Merrill Lynch | (874) | 306 | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Bank of America Merrill Lynch | 698 |
| (194) | Lattice Semiconductor Corp | Goldman Sachs | (220) | 124 | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Goldman Sachs | 283 |
| (489) | Lattice Semiconductor Corp | Morgan Stanley | (1.380) | 265 | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Morgan Stanley | 344 |
| 110 | Laureate Education Inc | Bank of America Merrill Lynch | 134 | 133 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 107 |
| (62) | La-Z-Boy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 28 | 226 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | Bank of America Merrill Lynch | 499 |
| (66) | La-Z-Boy Inc | Goldman Sachs | (6) | 105 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | Goldman Sachs | 232 |
| (62) | LCI Industries | Bank of America Merrill Lynch | (161) | 224 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | Morgan Stanley | 195 |
| 55 | Lear Corp | Bank of America Merrill Lynch | 592 | 1 | Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | — |
| 364 | Lear Corp | Goldman Sachs | 3.920 | 85 | Life Storage Inc (REIT) | Goldman Sachs | 156 |
| 432 | Lear Corp | Morgan Stanley | 2.674 | 155 | Life Storage Inc (REIT) | Morgan Stanley | 753 |
| 32 | Leggett & Platt Inc | Goldman Sachs | 53 | 53 | Ligand Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 114 |
| 715 | Leggett & Platt Inc | Morgan Stanley | 1.244 | 1.188 | Limelight Networks Inc | Bank of America Merrill Lynch | 416 |
| 141 | Leidos Holdings Inc | Goldman Sachs | 118 | 645 | Limelight Networks Inc | Goldman Sachs | 226 |
| 306 | Leidos Holdings Inc | Morgan Stanley | 670 | 82 | Lincoln Electric Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 77 |
| 204 | LeMaitre Vascular Inc | Bank of America Merrill Lynch | 253 | 132 | Lincoln Electric Holdings Inc | Goldman Sachs | 124 |
| 371 | LeMaitre Vascular Inc | Goldman Sachs | 445 | 129 | Lincoln Electric Holdings Inc | Morgan Stanley | 531 |
| 506 | LendingClub Corp | Bank of America Merrill Lynch | 992 | 460 | Lincoln National Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.871 |
| 232 | LendingTree Inc | Bank of America Merrill Lynch | (432) | 2.028 | Lincoln National Corp | Goldman Sachs | 8.015 |
| 176 | LendingTree Inc | Goldman Sachs | (259) | 1.711 | Lincoln National Corp | Morgan Stanley | 7.064 |
| 478 | Lennar Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 2.429 | 72 | Lindblad Expeditions Holdings Inc | Goldman Sachs | 146 |
| 863 | Lennar Corp 'A' | Goldman Sachs | 4.503 | (18) | Linde Plc | Goldman Sachs | (88) |
| 438 | Lennar Corp 'A' | Morgan Stanley | 2.885 | (176) | Linde Plc | Morgan Stanley | (646) |
| (123) | Lennox International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 161 | (219) | Lindsay Corp | Bank of America Merrill Lynch | 403 |
| (33) | Lennox International Inc | Morgan Stanley | (150) | (126) | Lindsay Corp | Goldman Sachs | 232 |
| (285) | Leslie's Inc | Bank of America Merrill Lynch | (214) | 58 | Lions Gate Entertainment Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (94) |
| (278) | Leslie's Inc | Goldman Sachs | (209) | 1.910 | Lions Gate Entertainment Corp 'A' | Goldman Sachs | (3.094) |
| (852) | Leslie's Inc | Morgan Stanley | (469) | 448 | Lions Gate Entertainment Corp 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (718) |
| 377 | Levi Strauss & Co 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 188 | 278 | Lions Gate Entertainment Corp 'B' | Goldman Sachs | (409) |
| 1.285 | Levi Strauss & Co 'A' | Goldman Sachs | 642 | 14 | Lithia Motors Inc | Bank of America Merrill Lynch | 46 |
| 1.181 | Levi Strauss & Co 'A' | Morgan Stanley | 1.795 | 44 | Lithia Motors Inc | Goldman Sachs | 144 |
| (6.203) | Lexicon Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (186) | 96 | Lithia Motors Inc | Morgan Stanley | 1.829 |
| 87 | LGI Homes Inc | Bank of America Merrill Lynch | (190) | | | | |
| 24 | LGI Homes Inc | Goldman Sachs | (52) | | | | |
| (84) | Liberty Broadband Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (663) | | | | |
| (636) | Liberty Broadband Corp 'A' | Goldman Sachs | (6.280) | | | | |
| (170) | Liberty Broadband Corp 'A' | Morgan Stanley | (1.243) | | | | |
| (324) | Liberty Broadband Corp 'C' | Bank of America Merrill Lynch | (1.894) | | | | |
| (435) | Liberty Broadband Corp 'C' | Goldman Sachs | (2.334) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|---|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (40) | Littelfuse Inc | Bank of America Merrill Lynch | (218) | 377 | M/I Homes Inc | Goldman Sachs | 750 |
| (10) | Littelfuse Inc | Goldman Sachs | (31) | (265) | Macerich Co (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 291 |
| (99) | Littelfuse Inc | Morgan Stanley | (400) | (249) | Macerich Co (REIT) | Goldman Sachs | 274 |
| 362 | LivaNova Plc | Bank of America Merrill Lynch | 551 | 1.238 | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.788 |
| 142 | LivaNova Plc | Goldman Sachs | 29 | 96 | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Goldman Sachs | 294 |
| 100 | LivaNova Plc | Morgan Stanley | 88 | 1.102 | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.579 |
| 160 | Live Nation Entertainment Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.163 | 199 | MacroGenics Inc | Goldman Sachs | (127) |
| 30 | Live Nation Entertainment Inc | Morgan Stanley | 150 | (899) | Macy's Inc | Morgan Stanley | (4.270) |
| 424 | Livent Corp | Goldman Sachs | 2.692 | (18) | Madison Square Garden Sports Corp | Bank of America Merrill Lynch | (191) |
| 38 | Livent Corp | Morgan Stanley | 118 | (82) | Madrigal Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2 |
| 517 | LivePerson Inc | Bank of America Merrill Lynch | 97 | (162) | Madrigal Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 3 |
| 1.384 | LivePerson Inc | Goldman Sachs | 239 | (997) | Magnolia Oil & Gas Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (4.696) |
| 64 | LiveRamp Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 37 | (928) | Magnolia Oil & Gas Corp 'A' | Morgan Stanley | (2.765) |
| 112 | LiveRamp Holdings Inc | Goldman Sachs | 48 | 411 | Malibu Boats Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (325) |
| (196) | LKQ Corp | Goldman Sachs | (110) | 1.132 | Malibu Boats Inc 'A' | Goldman Sachs | (894) |
| (2.171) | LKQ Corp | Morgan Stanley | (4.776) | 130 | Manhattan Associates Inc | Bank of America Merrill Lynch | 346 |
| (441) | LL Flooring Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (498) | 299 | Manhattan Associates Inc | Goldman Sachs | 795 |
| (160) | LL Flooring Holdings Inc | Goldman Sachs | (181) | 80 | Manhattan Associates Inc | Morgan Stanley | 204 |
| (1.174) | Loews Corp | Morgan Stanley | (1.550) | 63 | Manitowoc Co Inc | Goldman Sachs | 81 |
| (3.050) | Lordstown Motors Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 976 | 318 | MannKind Corp | Bank of America Merrill Lynch | 429 |
| (15.043) | Lordstown Motors Corp 'A' | Goldman Sachs | 4.707 | 235 | MannKind Corp | Goldman Sachs | 317 |
| (531) | Louisiana-Pacific Corp | Bank of America Merrill Lynch | (632) | 513 | ManpowerGroup Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.824) |
| (448) | Louisiana-Pacific Corp | Morgan Stanley | (1.935) | 127 | ManpowerGroup Inc | Goldman Sachs | (395) |
| 82 | Lowe's Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | 411 | 555 | ManpowerGroup Inc | Morgan Stanley | (1.992) |
| 12 | Lowe's Cos Inc | Goldman Sachs | 10 | (528) | Marathon Digital Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (645) |
| 267 | Lowe's Cos Inc | Morgan Stanley | 2.491 | (303) | Marathon Digital Holdings Inc | Goldman Sachs | (150) |
| (736) | Loyalty Ventures Inc | Bank of America Merrill Lynch | 309 | (1.380) | Marathon Oil Corp | Goldman Sachs | (6.166) |
| (1.120) | Loyalty Ventures Inc | Goldman Sachs | 462 | (128) | Marathon Oil Corp | Morgan Stanley | (592) |
| 4 | LPL Financial Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 117 | (178) | Marathon Petroleum Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.203) |
| 103 | LPL Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.017 | (639) | Marathon Petroleum Corp | Goldman Sachs | (5.059) |
| 84 | LPL Financial Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.363 | (748) | Marathon Petroleum Corp | Morgan Stanley | (5.484) |
| (1.510) | LTC Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (2.567) | (417) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 25 |
| 95 | Lululemon Athletica Inc | Bank of America Merrill Lynch | (478) | (209) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 13 |
| 391 | Lululemon Athletica Inc | Goldman Sachs | 6.771 | (784) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.713 |
| 318 | Lululemon Athletica Inc | Morgan Stanley | 8.104 | 79 | Marcus & Millichap Inc | Bank of America Merrill Lynch | 8 |
| 1.260 | Lumen Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 907 | 196 | Marcus & Millichap Inc | Goldman Sachs | 48 |
| 2.257 | Lumen Technologies Inc | Goldman Sachs | 1.625 | 1.999 | Marcus Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.956 |
| 2.025 | Lumen Technologies Inc | Morgan Stanley | 1.903 | 2.218 | Marcus Corp | Goldman Sachs | 2.127 |
| (256) | Lumentum Holdings Inc | Morgan Stanley | (652) | 261 | MarineMax Inc | Goldman Sachs | (282) |
| 297 | Luminar Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 34 | (10) | Markel Corp | Bank of America Merrill Lynch | (410) |
| 1.439 | Luminar Technologies Inc | Goldman Sachs | 667 | (7) | Markel Corp | Goldman Sachs | (354) |
| 985 | Luther Burbank Corp | Bank of America Merrill Lynch | 443 | (35) | Markel Corp | Morgan Stanley | (907) |
| 1.318 | Luther Burbank Corp | Goldman Sachs | 593 | 96 | MarketAxess Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.774 |
| 35 | Luxfer Holdings Plc | Bank of America Merrill Lynch | 36 | 33 | MarketAxess Holdings Inc | Goldman Sachs | 610 |
| 176 | Luxfer Holdings Plc | Goldman Sachs | 176 | 127 | MarketAxess Holdings Inc | Morgan Stanley | (822) |
| 365 | Lyft Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (590) | (3.383) | Markforged Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | 643 |
| (399) | LyondellBasell Industries NV 'A' | Morgan Stanley | (3.794) | | | | |
| 15 | M&T Bank Corp | Bank of America Merrill Lynch | (29) | | | | |
| 77 | M&T Bank Corp | Goldman Sachs | 1.132 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------------|----------------------------------|---|---|--|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (1.356) | Markforged Holding Corp | Goldman Sachs | 258 | (2.468) | MDU Resources Group Inc | Morgan Stanley | (899) |
| (1.112) | Marqeta Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.339) | 1.512 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 680 |
| (2.219) | Marqeta Inc 'A' | Goldman Sachs | (4.571) | 48 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 22 |
| (3.691) | Marqeta Inc 'A' | Morgan Stanley | (3.839) | 406 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 171 |
| (132) | Marriott International Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.049) | 4 | Medifast Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5) |
| (60) | Marriott Vacations Worldwide Corp | Bank of America Merrill Lynch | 64 | 8 | Medifast Inc | Goldman Sachs | 107 |
| (118) | Marriott Vacations Worldwide Corp | Morgan Stanley | (652) | 196 | MEDNAX Inc | Bank of America Merrill Lynch | 144 |
| 123 | Marsh & McLennan Cos Inc | Morgan Stanley | 817 | 353 | MEDNAX Inc | Goldman Sachs | 338 |
| 373 | Marten Transport Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (93) | (18) | Medpace Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (201) |
| 223 | Marten Transport Ltd | Goldman Sachs | (56) | (211) | Medpace Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.158) |
| 98 | Martin Marietta Materials Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.434 | (74) | Medpace Holdings Inc | Morgan Stanley | (657) |
| 174 | Martin Marietta Materials Inc | Goldman Sachs | 2.554 | 658 | Medtronic Plc | Goldman Sachs | (2.632) |
| 75 | Martin Marietta Materials Inc | Morgan Stanley | 513 | 144 | Medtronic Plc | Morgan Stanley | (641) |
| 638 | Marvell Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.639 | (45) | MeiraGTx Holdings Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1) |
| 287 | Marvell Technology Inc | Goldman Sachs | 1.105 | 2.055 | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | Bank of America Merrill Lynch | 534 |
| 523 | Marvell Technology Inc | Morgan Stanley | 2.207 | 1.155 | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | Goldman Sachs | 300 |
| (649) | Masco Corp | Morgan Stanley | (1.071) | 1.086 | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | Morgan Stanley | 174 |
| 394 | Masimo Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.357 | 26 | MercadoLibre Inc | Bank of America Merrill Lynch | (276) |
| 25 | Masimo Corp | Goldman Sachs | 213 | 10 | MercadoLibre Inc | Goldman Sachs | (106) |
| 653 | Masimo Corp | Morgan Stanley | 744 | 7 | MercadoLibre Inc | Morgan Stanley | 20 |
| 10 | Masonite International Corp | Bank of America Merrill Lynch | 73 | 55 | Mercantile Bank Corp | Bank of America Merrill Lynch | 49 |
| 57 | Masonite International Corp | Goldman Sachs | 321 | 61 | Mercantile Bank Corp | Goldman Sachs | 54 |
| 247 | MasTec Inc | Morgan Stanley | 1.139 | (1.553) | Mercer International Inc | Goldman Sachs | 264 |
| (13) | Mastercard Inc 'A' | Morgan Stanley | (15) | 485 | Merchants Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | 776 |
| (396) | Matador Resources Co | Morgan Stanley | (4.479) | 194 | Merchants Bancorp | Goldman Sachs | 310 |
| (287) | Match Group Inc | Morgan Stanley | (1.105) | 380 | Merck & Co Inc | Goldman Sachs | (486) |
| (45) | Materion Corp | Bank of America Merrill Lynch | (115) | 334 | Merck & Co Inc | Morgan Stanley | (950) |
| (6) | Materion Corp | Goldman Sachs | (5) | 32 | Mercury General Corp | Bank of America Merrill Lynch | 7 |
| (30) | Matson Inc | Bank of America Merrill Lynch | (157) | 91 | Mercury General Corp | Goldman Sachs | 82 |
| (163) | Matson Inc | Morgan Stanley | (575) | (482) | Meridian Bioscience Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.345) |
| (816) | Mattel Inc | Morgan Stanley | (1.248) | (796) | Meridian Bioscience Inc | Goldman Sachs | (2.221) |
| (78) | Matthews International Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (108) | (243) | MeridianLink Inc | Goldman Sachs | (78) |
| (577) | Matthews International Corp 'A' | Goldman Sachs | (796) | 299 | Merit Medical Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | 393 |
| (1.350) | MaxCyte Inc | Bank of America Merrill Lynch | (243) | 195 | Merit Medical Systems Inc | Goldman Sachs | 152 |
| (322) | Maximus Inc | Bank of America Merrill Lynch | (84) | (54) | Meritage Homes Corp | Bank of America Merrill Lynch | (225) |
| (480) | Maximus Inc | Goldman Sachs | (125) | (61) | Meritage Homes Corp | Goldman Sachs | (193) |
| (775) | MAXIMUS Inc | Morgan Stanley | (248) | (175) | Meritage Homes Corp | Morgan Stanley | (926) |
| 291 | MaxLinear Inc | Bank of America Merrill Lynch | (550) | 66 | Merus NV | Bank of America Merrill Lynch | 166 |
| 297 | MaxLinear Inc | Goldman Sachs | (561) | (10) | Mesa Laboratories Inc | Bank of America Merrill Lynch | (74) |
| 76 | MaxLinear Inc | Morgan Stanley | 97 | (10) | Mesa Laboratories Inc | Goldman Sachs | (79) |
| 47 | MBIA Inc | Goldman Sachs | 104 | 298 | Meta Platforms Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 113 |
| 385 | McCormick & Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (249) | 141 | Meta Platforms Inc 'A' | Morgan Stanley | (341) |
| 599 | McCormick & Co Inc | Goldman Sachs | (159) | (347) | Methode Electronics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (42) |
| 900 | McCormick & Co Inc | Morgan Stanley | (1.303) | (1.829) | Methode Electronics Inc | Goldman Sachs | (219) |
| 17 | McGrath RentCorp | Bank of America Merrill Lynch | 5 | 497 | MetLife Inc | Goldman Sachs | 1.757 |
| 63 | McGrath RentCorp | Goldman Sachs | 19 | 1.685 | MetLife Inc | Morgan Stanley | 5.443 |
| (7) | McKesson Corp | Goldman Sachs | 66 | (49) | Metropolitan Bank Holding Corp | Goldman Sachs | 94 |
| (92) | McKesson Corp | Morgan Stanley | (40) | | | | |
| 188 | MDC Holdings Inc | Goldman Sachs | 173 | | | | |
| (3.081) | MDU Resources Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.964) | | | | |
| (1.327) | MDU Resources Group Inc | Goldman Sachs | (876) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 16 | Mettler-Toledo International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.146 | (156) | Mohawk Industries Inc | Morgan Stanley | (261) |
| 20 | Mettler-Toledo International Inc | Goldman Sachs | 1.530 | (8) | Molina Healthcare Inc | Bank of America Merrill Lynch | 35 |
| 35 | Mettler-Toledo International Inc | Morgan Stanley | 2.079 | (16) | Molina Healthcare Inc | Goldman Sachs | 69 |
| 1.566 | MFA Financial Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 23 | (19) | Molina Healthcare Inc | Morgan Stanley | 239 |
| 1.507 | MFA Financial Inc (REIT) | Goldman Sachs | 11 | 996 | Molson Coors Beverage Co 'B' | Morgan Stanley | 2.530 |
| 20 | MGE Energy Inc | Goldman Sachs | (24) | 266 | Momentive Global Inc | Bank of America Merrill Lynch | 35 |
| 1.041 | MGIC Investment Corp | Bank of America Merrill Lynch | 760 | 171 | Momentive Global Inc | Goldman Sachs | 22 |
| 2.020 | MGIC Investment Corp | Goldman Sachs | 1.475 | (13) | Monarch Casino & Resort Inc | Bank of America Merrill Lynch | 37 |
| 1.356 | MGIC Investment Corp | Morgan Stanley | 570 | (28) | Monarch Casino & Resort Inc | Goldman Sachs | 80 |
| (148) | MGM Resorts International | Goldman Sachs | (311) | (1.159) | Mondelez International Inc 'A' | Morgan Stanley | (950) |
| (399) | MGM Resorts International | Morgan Stanley | (876) | (94) | MongoDB Inc | Bank of America Merrill Lynch | 113 |
| 71 | MGP Ingredients Inc | Bank of America Merrill Lynch | (163) | (10) | MongoDB Inc | Morgan Stanley | 42 |
| 384 | MGP Ingredients Inc | Goldman Sachs | (883) | 404 | Monro Inc | Goldman Sachs | 279 |
| (131) | Microchip Technology Inc | Morgan Stanley | (39) | (264) | Monster Beverage Corp | Goldman Sachs | (230) |
| 306 | Micron Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.450 | (1.604) | Monster Beverage Corp | Morgan Stanley | (2.142) |
| 54 | Micron Technology Inc | Goldman Sachs | 272 | (34) | Monte Rosa Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (15) |
| 606 | Microsoft Corp | Morgan Stanley | 6.181 | 127 | Montrose Environmental Group Inc | Goldman Sachs | 151 |
| 13 | MicroStrategy Inc 'A' | Goldman Sachs | 474 | 35 | Moody's Corp | Bank of America Merrill Lynch | 496 |
| 7 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 34 | 86 | Moody's Corp | Goldman Sachs | 1.167 |
| 671 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | Goldman Sachs | 3.241 | 493 | Moody's Corp | Morgan Stanley | 3.668 |
| 206 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | Morgan Stanley | 767 | 48 | Moog Inc 'A' | Goldman Sachs | 227 |
| 50 | Middleby Corp | Morgan Stanley | 485 | (748) | Morgan Stanley | Bank of America Merrill Lynch | (4.606) |
| 1.075 | Midland States Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 914 | (2.736) | Morgan Stanley | Goldman Sachs | (16.667) |
| 2.215 | Midland States Bancorp Inc | Goldman Sachs | 1.883 | 24 | Morningstar Inc | Goldman Sachs | 483 |
| 525 | MidWestOne Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 845 | 265 | Morningstar Inc | Morgan Stanley | 2.912 |
| 493 | MidWestOne Financial Group Inc | Goldman Sachs | 794 | 52 | Morphic Holding Inc | Goldman Sachs | (56) |
| 49 | MillerKnoll Inc | Goldman Sachs | 29 | (38) | Mosaic Co | Goldman Sachs | (13) |
| 259 | MiMedx Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3) | (254) | Mosaic Co | Morgan Stanley | (323) |
| 242 | MiMedx Group Inc | Goldman Sachs | (2) | (121) | Motorola Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (275) |
| (21) | Minerals Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (8) | (31) | Motorola Solutions Inc | Goldman Sachs | (164) |
| (36) | Minerals Technologies Inc | Goldman Sachs | (44) | (117) | Motorola Solutions Inc | Morgan Stanley | (707) |
| (45) | Mirati Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 868 | (268) | Movado Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (265) |
| (45) | Mirati Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 944 | (149) | Movado Group Inc | Goldman Sachs | (148) |
| (183) | Mirati Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 4.593 | 411 | MP Materials Corp | Goldman Sachs | (57) |
| (461) | Mission Produce Inc | Bank of America Merrill Lynch | 87 | (455) | Mr Cooper Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (396) |
| (372) | Mission Produce Inc | Goldman Sachs | (2) | (624) | Mr Cooper Group Inc | Goldman Sachs | (543) |
| (481) | Mister Car Wash Inc | Bank of America Merrill Lynch | (303) | 224 | MRC Global Inc | Bank of America Merrill Lynch | 291 |
| (395) | Mister Car Wash Inc | Goldman Sachs | (249) | 4.058 | MRC Global Inc | Goldman Sachs | 5.275 |
| 144 | MKS Instruments Inc | Goldman Sachs | 746 | 130 | MSA Safety Inc | Bank of America Merrill Lynch | 945 |
| 1.068 | Model N Inc | Goldman Sachs | 951 | 250 | MSA Safety Inc | Goldman Sachs | 1.792 |
| (151) | Moderna Inc | Goldman Sachs | (1.949) | (101) | MSC Industrial Direct Co Inc 'A' | Goldman Sachs | (254) |
| (191) | Moderna Inc | Morgan Stanley | (1.936) | (552) | MSC Industrial Direct Co Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.529) |
| 574 | Modine Manufacturing Co | Bank of America Merrill Lynch | 1.716 | 25 | MSCI Inc | Bank of America Merrill Lynch | 821 |
| 2.319 | Modine Manufacturing Co | Goldman Sachs | 6.934 | 16 | MSCI Inc | Goldman Sachs | 687 |
| 58 | ModivCare Inc | Bank of America Merrill Lynch | (118) | 28 | MSCI Inc | Morgan Stanley | 594 |
| 52 | ModivCare Inc | Goldman Sachs | (106) | 26 | MSG Entertainment Spinco Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 137 |
| 291 | Moelis & Co 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.096 | (123) | Mueller Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (165) |
| 526 | Moelis & Co 'A' | Goldman Sachs | 2.051 | (281) | Mueller Industries Inc | Goldman Sachs | (377) |
| (774) | Mohawk Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.951) | (3.677) | Mueller Water Products Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.011) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (961) | Mueller Water Products Inc 'A' | Goldman Sachs | (264) | (1.484) | Navient Corp | Goldman Sachs | (468) |
| (235) | Multiplan Corp | Goldman Sachs | (89) | (15) | NBT Bancorp Inc | Goldman Sachs | (25) |
| 849 | Murphy Oil Corp | Bank of America | | (511) | nCino Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 6.955 | | | Merrill Lynch | (715) |
| 310 | Murphy Oil Corp | Goldman Sachs | 1.808 | (850) | nCino Inc | Goldman Sachs | (3.425) |
| 106 | Murphy Oil Corp | Morgan Stanley | 410 | (966) | nCino Inc | Morgan Stanley | (1.758) |
| 81 | Murphy USA Inc | Bank of America | | (121) | NCR Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 144 | | | Merrill Lynch | (121) |
| 383 | Murphy USA Inc | Goldman Sachs | 4.070 | (29) | NCR Corp | Goldman Sachs | (29) |
| 165 | Murphy USA Inc | Morgan Stanley | 1.790 | (965) | NCR Corp | Morgan Stanley | (1.322) |
| 83 | Myers Industries Inc | Bank of America | | (543) | Nelnet Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (37) | | | Merrill Lynch | (654) |
| 77 | Myers Industries Inc | Goldman Sachs | (35) | (599) | Nelnet Inc 'A' | Goldman Sachs | (862) |
| (50) | MYR Group Inc | Bank of America | | (443) | NEOGAMES SA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (81) | | | Merrill Lynch | (596) |
| (99) | MYR Group Inc | Goldman Sachs | (532) | (539) | NEOGAMES SA | Goldman Sachs | (725) |
| (52) | Myriad Genetics Inc | Bank of America | | 606 | Neogen Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 21 | | | Merrill Lynch | 219 |
| (59) | N-able Inc | Bank of America | | 594 | Neogen Corp | Goldman Sachs | 224 |
| | | Merrill Lynch | (59) | 1.165 | NeoGenomics Inc | Bank of America | |
| 65 | Nabors Industries Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (606) |
| | | Merrill Lynch | 2.108 | 1.441 | NeoGenomics Inc | Goldman Sachs | (749) |
| 129 | Nabors Industries Ltd | Goldman Sachs | 4.700 | 228 | NetApp Inc | Bank of America | |
| (5.723) | Nano Dimension Ltd ADR | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 399 |
| | | Merrill Lynch | (2.318) | 231 | NetApp Inc | Goldman Sachs | 99 |
| (1.246) | Nano Dimension Ltd ADR | Goldman Sachs | (505) | 1.377 | NetApp Inc | Morgan Stanley | 4.785 |
| (153) | NanoString Technologies Inc | Bank of America | | 91 | Netflix Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (190) | | | Merrill Lynch | 607 |
| (226) | NanoString Technologies Inc | Goldman Sachs | (281) | 186 | Netflix Inc | Goldman Sachs | 893 |
| 171 | Napco Security Technologies Inc | Bank of America | | 213 | Netflix Inc | Morgan Stanley | 1.223 |
| | | Merrill Lynch | 407 | 508 | NETGEAR Inc | Bank of America | |
| 28 | Napco Security Technologies Inc | Goldman Sachs | 67 | | | Merrill Lynch | (229) |
| (79) | Nasdaq Inc | Bank of America | | 344 | NETGEAR Inc | Goldman Sachs | (216) |
| | | Merrill Lynch | (655) | (951) | NetScout Systems Inc | Bank of America | |
| (49) | Nasdaq Inc | Goldman Sachs | (487) | | | Merrill Lynch | 981 |
| (380) | Nasdaq Inc | Morgan Stanley | (3.019) | (1.357) | NetScout Systems Inc | Goldman Sachs | 953 |
| (140) | Natera Inc | Bank of America | | (129) | NETSTREIT Corp (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (473) | | | Merrill Lynch | (8) |
| (223) | Natera Inc | Morgan Stanley | 156 | (233) | NETSTREIT Corp (REIT) | Goldman Sachs | (14) |
| 197 | National Beverage Corp | Bank of America | | 93 | Neurocrine Biosciences Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 599 | | | Merrill Lynch | 567 |
| 102 | National Beverage Corp | Goldman Sachs | 202 | 207 | Neurocrine Biosciences Inc | Goldman Sachs | 1.525 |
| (102) | National Fuel Gas Co | Goldman Sachs | (691) | 223 | Neurocrine Biosciences Inc | Morgan Stanley | 1.248 |
| (934) | National Fuel Gas Co | Morgan Stanley | (3.745) | 973 | Nevro Corp | Bank of America | |
| (333) | National Health Investors Inc (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (2.514) |
| | | Merrill Lynch | (1.016) | (881) | New Fortress Energy Inc | Bank of America | |
| (725) | National Health Investors Inc (REIT) | Goldman Sachs | (2.211) | | | Merrill Lynch | (2.916) |
| (35) | National HealthCare Corp | Bank of America | | (620) | New Fortress Energy Inc | Goldman Sachs | (2.052) |
| | | Merrill Lynch | 30 | (249) | New Fortress Energy Inc | Morgan Stanley | (862) |
| (30) | National HealthCare Corp | Goldman Sachs | 26 | (587) | New Jersey Resources Corp | Bank of America | |
| 215 | National Instruments Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (492) |
| | | Merrill Lynch | 226 | (572) | New Jersey Resources Corp | Goldman Sachs | (519) |
| 386 | National Instruments Corp | Goldman Sachs | 405 | 49 | New Relic Inc | Bank of America | |
| (51) | National Presto Industries Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 192 |
| | | Merrill Lynch | 166 | 380 | New Relic Inc | Goldman Sachs | 753 |
| (110) | National Presto Industries Inc | Goldman Sachs | 359 | 198 | New Relic Inc | Morgan Stanley | (26) |
| 13 | National Research Corp | Bank of America | | (291) | New Residential Investment Corp (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 22 | | | Merrill Lynch | (133) |
| (50) | National Retail Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (65) | (667) | New Residential Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (335) |
| (850) | National Retail Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (876) | (11.583) | New Residential Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (5.212) |
| 116 | National Vision Holdings Inc | Goldman Sachs | 204 | 3.154 | New York Community Bancorp Inc | Bank of America | |
| (661) | Navient Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 2.098 |
| | | Merrill Lynch | (197) | 3.451 | New York Community Bancorp Inc | Goldman Sachs | 2.445 |
| | | | | 2.084 | New York Community Bancorp Inc | Morgan Stanley | 761 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-------------------------------|---|---|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (295) | New York Times Co 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (439) | 176 | Northfield Bancorp Inc | Goldman Sachs | 37 |
| 719 | Newell Brands Inc | Morgan Stanley | 1.323 | (1.692) | Northwest Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (698) |
| (3.096) | Newmark Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 650 | (2.079) | Northwest Bancshares Inc | Goldman Sachs | (1.009) |
| (2.087) | Newmark Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 472 | 335 | Northwest Natural Holding Co | Bank of America Merrill Lynch | 988 |
| (39) | NewMarket Corp | Bank of America Merrill Lynch | (9) | 595 | Northwest Natural Holding Co | Goldman Sachs | 1.755 |
| (91) | NewMarket Corp | Goldman Sachs | (20) | 300 | NorthWestern Corp | Bank of America Merrill Lynch | 123 |
| 361 | Newmont Corp | Goldman Sachs | 104 | 390 | NorthWestern Corp | Goldman Sachs | 160 |
| 38 | Newmont Corp | Morgan Stanley | (6) | 351 | NortonLifeLock Inc | Bank of America Merrill Lynch | 263 |
| (1.784) | News Corp 'A' | Goldman Sachs | 517 | 106 | NortonLifeLock Inc | Goldman Sachs | 80 |
| (456) | News Corp 'A' | Morgan Stanley | 36 | 1.142 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 556 |
| 154 | NexPoint Residential Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 76 | 2.180 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | Goldman Sachs | 1.015 |
| 1.334 | NexPoint Residential Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 351 | 3.416 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | Morgan Stanley | 3.484 |
| 120 | Nexstar Media Group Inc 'A' | Morgan Stanley | 61 | 178 | NOV Inc | Goldman Sachs | 336 |
| (84) | NextEra Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (366) | 1.135 | NOV Inc | Morgan Stanley | 1.623 |
| (550) | NextEra Energy Inc | Goldman Sachs | (3.386) | 193 | Nova Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.254 |
| (520) | NextEra Energy Inc | Morgan Stanley | (1.968) | 245 | Nova Ltd | Goldman Sachs | 1.592 |
| 147 | NextEra Energy Partners LP | Bank of America Merrill Lynch | 1.076 | 120 | Nova Ltd | Morgan Stanley | 421 |
| (87) | NextGen Healthcare Inc | Goldman Sachs | 144 | (8) | Novanta Inc | Bank of America Merrill Lynch | 24 |
| (169) | NexTier Oilfield Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (191) | (8) | Novanta Inc | Goldman Sachs | 24 |
| (290) | NexTier Oilfield Solutions Inc | Goldman Sachs | (328) | (408) | Novavax Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.696) |
| 845 | NGM Biopharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 414 | (427) | Novavax Inc | Morgan Stanley | (2.958) |
| 1.166 | NGM Biopharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 571 | (91) | Novocure Ltd | Morgan Stanley | (389) |
| (9) | Nicolet Bankshares Inc | Goldman Sachs | (31) | (4.658) | Novume Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.124) |
| 311 | NIKE Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 1.634 | 147 | NOW Inc | Goldman Sachs | 75 |
| 174 | NIKE Inc 'B' | Goldman Sachs | 1.520 | 203 | NRG Energy Inc | Goldman Sachs | 410 |
| 596 | NIKE Inc 'B' | Morgan Stanley | 4.506 | (310) | Nu Skin Enterprises Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (208) |
| (676) | NiSource Inc | Bank of America Merrill Lynch | (277) | (740) | Nu Skin Enterprises Inc 'A' | Goldman Sachs | (496) |
| (1.027) | NiSource Inc | Goldman Sachs | (768) | (992) | Nucor Corp | Goldman Sachs | (13.650) |
| (1.418) | NiSource Inc | Morgan Stanley | (872) | (686) | Nucor Corp | Morgan Stanley | (5.845) |
| (289) | Nkarta Inc | Bank of America Merrill Lynch | 92 | 281 | Nurix Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 81 |
| (612) | Nkarta Inc [†] | Goldman Sachs | — | 1.233 | Nutanix Inc 'A' | Morgan Stanley | (6.177) |
| 65 | nLight Inc | Bank of America Merrill Lynch | 51 | 207 | NuVasive Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.047 |
| 1.425 | NMI Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 912 | (476) | Nuvation Bio Inc | Goldman Sachs | 262 |
| 1.946 | NMI Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.245 | 94 | NV5 Global Inc | Goldman Sachs | 874 |
| 229 | Noble Corp | Bank of America Merrill Lynch | 444 | (1.024) | nVent Electric Plc | Bank of America Merrill Lynch | (369) |
| 137 | Noble Corp | Goldman Sachs | 266 | (1.363) | nVent Electric Plc | Goldman Sachs | (1.560) |
| 1.661 | Nomad Foods Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 664 | (1.717) | nVent Electric Plc | Morgan Stanley | (1.272) |
| 3.056 | Nomad Foods Ltd | Goldman Sachs | 1.222 | 300 | NVIDIA Corp | Bank of America Merrill Lynch | 5.040 |
| 5.361 | Nomad Foods Ltd | Morgan Stanley | 2.091 | 264 | NVIDIA Corp | Goldman Sachs | 6.240 |
| 109 | Nordson Corp | Morgan Stanley | 1.077 | 3 | NVR Inc | Bank of America Merrill Lynch | 452 |
| 2.503 | Nordstrom Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.442 | 5 | NVR Inc | Goldman Sachs | 754 |
| 2.963 | Nordstrom Inc | Morgan Stanley | 13.096 | 2 | NVR Inc | Morgan Stanley | 342 |
| 40 | Norfolk Southern Corp | Bank of America Merrill Lynch | 138 | (83) | NXP Semiconductors NV | Bank of America Merrill Lynch | (946) |
| 112 | Norfolk Southern Corp | Goldman Sachs | (762) | (34) | NXP Semiconductors NV | Goldman Sachs | (477) |
| 212 | Norfolk Southern Corp | Morgan Stanley | 1.614 | (879) | NXP Semiconductors NV | Morgan Stanley | (9.030) |
| (162) | Northern Trust Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.475) | (498) | Oak Street Health Inc | Bank of America Merrill Lynch | (916) |
| (253) | Northern Trust Corp | Goldman Sachs | (1.708) | (1.377) | Oak Street Health Inc | Goldman Sachs | (2.462) |
| (101) | Northern Trust Corp | Morgan Stanley | (538) | (458) | Oak Street Health Inc | Morgan Stanley | (444) |
| 515 | Northfield Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 108 | 9 | Oasis Petroleum Inc | Bank of America Merrill Lynch | 197 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|----------------------------------|---|---|-----------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 34 | Oasis Petroleum Inc | Goldman Sachs | 744 | (703) | OneMain Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.265) |
| (249) | Occidental Petroleum Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.938) | (494) | OneSpan Inc | Bank of America Merrill Lynch | (711) |
| (44) | Occidental Petroleum Corp | Goldman Sachs | (362) | (929) | OneSpan Inc | Goldman Sachs | (1.338) |
| 425 | Oceaneering International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 787 | 481 | OneSpaWorld Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 96 |
| 367 | Oceaneering International Inc | Goldman Sachs | 694 | 1.521 | OneSpaWorld Holdings Ltd | Goldman Sachs | 304 |
| 3.344 | OceanFirst Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.287 | (44) | Onto Innovation Inc | Bank of America Merrill Lynch | (412) |
| (937) | Ocular Therapeutix Inc | Bank of America Merrill Lynch | 220 | (113) | Onto Innovation Inc | Goldman Sachs | (805) |
| (4.698) | Ocular Therapeutix Inc | Goldman Sachs | 1.104 | (595) | Onto Innovation Inc | Morgan Stanley | (3.347) |
| (198) | ODP Corp | Bank of America Merrill Lynch | 622 | (1.008) | Open Lending Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (575) |
| (1.306) | ODP Corp | Goldman Sachs | 4.101 | (378) | Open Lending Corp 'A' | Goldman Sachs | (215) |
| 554 | Office Properties Income Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 429 | (1.633) | Opendoor Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (147) |
| 522 | Office Properties Income Trust (REIT) | Goldman Sachs | 273 | (5.647) | Opendoor Technologies Inc | Morgan Stanley | (2.711) |
| 235 | OGE Energy Corp | Morgan Stanley | 219 | (6.447) | OPKO Health Inc | Bank of America Merrill Lynch | (709) |
| (901) | O-I Glass Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.991) | (796) | OPKO Health Inc | Goldman Sachs | (88) |
| (799) | O-I Glass Inc | Goldman Sachs | (1.928) | 595 | Oportun Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (137) |
| 150 | Okta Inc | Bank of America Merrill Lynch | (678) | 313 | Oportun Financial Corp | Goldman Sachs | (72) |
| 224 | Okta Inc | Morgan Stanley | 300 | (19) | OptimizeRx Corp | Goldman Sachs | (23) |
| (2.052) | Olaplex Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.315) | (374) | Option Care Health Inc | Morgan Stanley | (748) |
| (2.381) | Olaplex Holdings Inc | Goldman Sachs | (6.167) | (75) | Oracle Corp | Goldman Sachs | 31 |
| (1.851) | Olaplex Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.758) | (524) | Oramed Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 37 |
| (225) | Old Dominion Freight Line Inc | Goldman Sachs | 1.541 | 77 | OraSure Technologies Inc | Goldman Sachs | (66) |
| 3.003 | Old National Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | 1.291 | (16) | O'Reilly Automotive Inc | Bank of America Merrill Lynch | (994) |
| 839 | Old National Bancorp | Goldman Sachs | 361 | (10) | O'Reilly Automotive Inc | Goldman Sachs | (410) |
| 651 | Old National Bancorp | Morgan Stanley | 117 | (26) | O'Reilly Automotive Inc | Morgan Stanley | (915) |
| (1.466) | Old Republic International Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.223) | 127 | Organogenesis Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4 |
| (3.559) | Old Republic International Corp | Goldman Sachs | (2.708) | (770) | Organon & Co | Morgan Stanley | (285) |
| (923) | Old Republic International Corp | Morgan Stanley | (673) | (61) | ORIC Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 1 |
| 1.204 | Olema Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 819 | 127 | Origin Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 182 |
| 1.647 | Olema Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 1.120 | 1.473 | Origin Bancorp Inc | Goldman Sachs | 2.106 |
| (354) | Olin Corp | Goldman Sachs | (1.384) | 778 | Origin Materials Inc | Bank of America Merrill Lynch | 848 |
| (322) | Olin Corp | Morgan Stanley | (992) | 68 | Origin Materials Inc | Goldman Sachs | 74 |
| 349 | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 149 | 62 | Orion Engineered Carbons SA | Goldman Sachs | 105 |
| 353 | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Goldman Sachs | 158 | (393) | Orion Office Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (173) |
| 884 | Olo Inc 'A' | Goldman Sachs | 318 | (99) | Orion Office Inc (REIT) | Goldman Sachs | (44) |
| (1.175) | Omega Healthcare Investors Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (517) | 763 | Ormat Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.662 |
| (87) | Omnicell Inc | Goldman Sachs | (187) | 327 | Ormat Technologies Inc | Goldman Sachs | 3.561 |
| (256) | Omnicell Inc | Bank of America Merrill Lynch | (234) | 537 | Ormat Technologies Inc | Morgan Stanley | 2.411 |
| (175) | Omnicom Group Inc | Goldman Sachs | 464 | 302 | Orthofix Medical Inc | Bank of America Merrill Lynch | (97) |
| (286) | Omnicom Group Inc | Morgan Stanley | 432 | (541) | Oscar Health Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 536 |
| (1.079) | ON Semiconductor Corp | Bank of America Merrill Lynch | (5.233) | 23 | Oshkosh Corp | Goldman Sachs | 109 |
| (397) | ON Semiconductor Corp | Morgan Stanley | (1.632) | 269 | Oshkosh Corp | Morgan Stanley | 490 |
| (2.090) | ON24 Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.515) | (20) | OSI Systems Inc | Goldman Sachs | (62) |
| (145) | ONE Gas Inc | Bank of America Merrill Lynch | (98) | 392 | Otis Worldwide Corp | Bank of America Merrill Lynch | (81) |
| (23) | ONE Gas Inc | Goldman Sachs | 6 | 560 | Otis Worldwide Corp | Goldman Sachs | 765 |
| (81) | ONE Gas Inc | Morgan Stanley | (11) | 621 | Otis Worldwide Corp | Morgan Stanley | (166) |
| | | | | 70 | Otter Tail Corp | Goldman Sachs | 149 |
| | | | | 2.055 | Outfront Media Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 2.517 |
| | | | | 1.330 | Outfront Media Inc (REIT) | Goldman Sachs | 26 |
| | | | | 1.063 | Outfront Media Inc (REIT) | Morgan Stanley | 405 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (234) | Outset Medical Inc | Bank of America Merrill Lynch | 852 | 211 | Paylocity Holding Corp | Morgan Stanley | 1.325 |
| (796) | Outset Medical Inc | Goldman Sachs | 2.863 | 47 | Paymentus Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 67 |
| 148 | Overstock.com Inc | Bank of America Merrill Lynch | 497 | (291) | Payoneer Global Inc | Goldman Sachs | (115) |
| 686 | Overstock.com Inc | Goldman Sachs | 2.189 | (51) | PayPal Holdings Inc | Goldman Sachs | 26 |
| 324 | Ovintiv Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.318 | (152) | PayPal Holdings Inc | Morgan Stanley | (873) |
| 111 | Ovintiv Inc | Goldman Sachs | 1.043 | 115 | PBF Energy Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 376 |
| (223) | Owens & Minor Inc | Goldman Sachs | 78 | 204 | PBF Energy Inc 'A' | Goldman Sachs | 667 |
| (174) | Owens Corning | Morgan Stanley | (414) | 17 | PC Connection Inc | Goldman Sachs | (37) |
| (320) | PACCAR Inc | Morgan Stanley | (1.032) | (265) | PDC Energy Inc | Morgan Stanley | (2.584) |
| 95 | Pacira BioSciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | 300 | (13) | PDF Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4 |
| (384) | Packaging Corp of America | Morgan Stanley | (1.548) | (48) | PDF Solutions Inc | Goldman Sachs | 14 |
| 1.382 | PacWest Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | 1.755 | 54 | Peapack-Gladstone Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 110 |
| 1.454 | PacWest Bancorp | Morgan Stanley | 1.439 | 35 | Peapack-Gladstone Financial Corp | Goldman Sachs | 71 |
| (1.268) | Palantir Technologies Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (907) | 154 | Pebblebrook Hotel Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 20 |
| (8.012) | Palantir Technologies Inc 'A' | Goldman Sachs | (6.798) | 909 | Pebblebrook Hotel Trust (REIT) | Goldman Sachs | (70) |
| (3.056) | Palantir Technologies Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.277) | 167 | Pegasystems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (115) |
| 18 | Palo Alto Networks Inc | Goldman Sachs | 633 | 32 | Pegasystems Inc | Goldman Sachs | 12 |
| 55 | Palomar Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 247 | (480) | Peloton Interactive Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 614 |
| 46 | Palomar Holdings Inc | Goldman Sachs | 207 | (1.539) | Peloton Interactive Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.450 |
| 233 | Papa John's International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.415 | (1.083) | Penn National Gaming Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.333) |
| 125 | Papa John's International Inc | Goldman Sachs | 699 | (338) | Penn National Gaming Inc | Goldman Sachs | (767) |
| 113 | Papa John's International Inc | Morgan Stanley | 1.066 | (283) | Penn National Gaming Inc | Morgan Stanley | (447) |
| 1.558 | Par Pacific Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.103 | (31) | Pennant Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (34) |
| 419 | Par Pacific Holdings Inc | Goldman Sachs | 566 | (165) | PennyMac Financial Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | (714) |
| 20 | PAR Technology Corp | Bank of America Merrill Lynch | 90 | (738) | PennyMac Financial Services Inc | Goldman Sachs | (3.177) |
| 311 | PAR Technology Corp | Goldman Sachs | 1.403 | 21 | Penske Automotive Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 139 |
| 1.270 | Paramount Group Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 343 | 646 | Penske Automotive Group Inc | Morgan Stanley | 3.947 |
| 556 | Paramount Group Inc (REIT) | Goldman Sachs | 150 | 299 | Pentair Plc | Bank of America Merrill Lynch | (24) |
| 1.566 | Park Hotels & Resorts Inc (REIT) | Goldman Sachs | (438) | 419 | Pentair Plc | Goldman Sachs | (34) |
| 18 | Park Hotels & Resorts Inc (REIT) | Morgan Stanley | 26 | 386 | Pentair Plc | Morgan Stanley | 166 |
| (38) | Park National Corp | Goldman Sachs | (190) | 155 | Penumbra Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.153 |
| (158) | Parker-Hannifin Corp | Morgan Stanley | (1.384) | 196 | Penumbra Inc | Goldman Sachs | 1.481 |
| (531) | Parsons Corp | Bank of America Merrill Lynch | (547) | 108 | Penumbra Inc | Morgan Stanley | 641 |
| (925) | Parsons Corp | Goldman Sachs | (953) | 18 | Peoples Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 10 |
| 687 | Party City Holdco Inc | Bank of America Merrill Lynch | (14) | 656 | Peoples Bancorp Inc | Goldman Sachs | 626 |
| 722 | Party City Holdco Inc | Goldman Sachs | (14) | 598 | PepsiCo Inc | Goldman Sachs | (2.442) |
| 2.582 | Passage Bio Inc | Goldman Sachs | 297 | 704 | PepsiCo Inc | Morgan Stanley | (75) |
| 13 | Patrick Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (86) | (4.762) | Perdoceo Education Corp | Goldman Sachs | (3.810) |
| 107 | Patrick Industries Inc | Goldman Sachs | (704) | (299) | Perella Weinberg Partners | Goldman Sachs | (116) |
| (104) | Patterson Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | 11 | 47 | Perficient Inc | Bank of America Merrill Lynch | 59 |
| (517) | Patterson Cos Inc | Goldman Sachs | 57 | 19 | Perficient Inc | Goldman Sachs | 24 |
| (540) | Patterson-UTI Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.036) | 413 | Performance Food Group Co | Bank of America Merrill Lynch | (209) |
| (272) | Patterson-UTI Energy Inc | Goldman Sachs | (1.025) | (224) | PerkinElmer Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.379) |
| 34 | Paychex Inc | Bank of America Merrill Lynch | 87 | (139) | PerkinElmer Inc | Goldman Sachs | (884) |
| 227 | Paychex Inc | Goldman Sachs | 919 | (283) | PerkinElmer Inc | Morgan Stanley | (1.327) |
| 101 | Paychex Inc | Morgan Stanley | 444 | 383 | Perrigo Co Plc | Bank of America Merrill Lynch | 804 |
| 147 | Paycom Software Inc | Goldman Sachs | 982 | 618 | Perrigo Co Plc | Goldman Sachs | 1.169 |
| 174 | Paycom Software Inc | Morgan Stanley | 2.107 | 373 | Perrigo Co Plc | Morgan Stanley | 296 |
| 86 | Paylocity Holding Corp | Goldman Sachs | 992 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|--------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 972 | Personalis Inc | Goldman Sachs | (399) | 316 | PJT Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.179 |
| 1.412 | PET Acquisition LLC 'A' | Morgan Stanley | 522 | 924 | Plains GP Holdings LP 'A' | Bank of America | |
| 387 | PetIQ Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 721 |
| | | Merrill Lynch | 166 | 702 | Plains GP Holdings LP 'A' | Goldman Sachs | 548 |
| 333 | PetIQ Inc | Goldman Sachs | 143 | 410 | Planet Fitness Inc 'A' | Goldman Sachs | (738) |
| (54) | PetMed Express Inc | Goldman Sachs | (50) | 703 | Planet Fitness Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.418 |
| (412) | Pfizer Inc | Bank of America | | 263 | Playa Hotels & Resorts NV | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (474) | | | Merrill Lynch | (24) |
| (382) | Pfizer Inc | Goldman Sachs | 488 | 222 | Playa Hotels & Resorts NV | Goldman Sachs | (24) |
| (307) | Pfizer Inc | Morgan Stanley | 407 | (1.160) | PLBY Group Inc | Bank of America | |
| (663) | PG&E Corp | Goldman Sachs | (284) | | | Merrill Lynch | (371) |
| (1.374) | PG&E Corp | Morgan Stanley | (194) | (483) | PLBY Group Inc | Goldman Sachs | (56) |
| 28 | PGT Innovations Inc | Goldman Sachs | 42 | (461) | Plexus Corp | Goldman Sachs | (830) |
| (55) | Phathom | Bank of America | | (809) | Plug Power Inc | Bank of America | |
| | Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | 47 | | | Merrill Lynch | (2.720) |
| (63) | Phathom | | | (126) | Plug Power Inc | Goldman Sachs | (207) |
| | Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 54 | (531) | Plug Power Inc | Morgan Stanley | (969) |
| 279 | Phibro Animal Health Corp 'A' | Bank of America | | 872 | Plymouth Industrial Inc (REIT) | | |
| | | Merrill Lynch | 271 | | | Goldman Sachs | (1.151) |
| 366 | Phibro Animal Health Corp 'A' | Goldman Sachs | 355 | (109) | PMV Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| 1.484 | Philip Morris International Inc | | | | | Merrill Lynch | 97 |
| (59) | Phillips 66 | Morgan Stanley | 3.613 | (331) | PMV Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 38 |
| | | Bank of America | | 241 | Polaris Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (94) | | | Merrill Lynch | (1.077) |
| (119) | Phillips 66 | Goldman Sachs | (969) | 130 | Polaris Inc | Goldman Sachs | 718 |
| (290) | Phillips 66 | Morgan Stanley | (2.155) | 98 | Polaris Inc | Morgan Stanley | 387 |
| (1.170) | Phillips Edison & Co Inc (REIT) | Morgan Stanley | (1.907) | (84) | Pool Corp | Bank of America | |
| 67 | Photronics Inc | Goldman Sachs | 389 | | | Merrill Lynch | 248 |
| (61) | Phreesia Inc | Bank of America | | (162) | Pool Corp | Goldman Sachs | (261) |
| | | Merrill Lynch | (162) | (85) | Pool Corp | Morgan Stanley | 463 |
| 23 | Piedmont Lithium Inc | Bank of America | | 395 | Popular Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 339 | | | Merrill Lynch | 1.248 |
| 165 | Piedmont Lithium Inc | Goldman Sachs | 2.429 | 142 | Popular Inc | Morgan Stanley | 274 |
| 77 | Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Bank of America | | (2.409) | Porch Group Inc | Bank of America | |
| (50) | Pilgrim's Pride Corp | Merrill Lynch | (23) | | | Merrill Lynch | (144) |
| | | Bank of America | (169) | (1.278) | Porch Group Inc | Goldman Sachs | (89) |
| (390) | Pilgrim's Pride Corp | Goldman Sachs | (1.314) | 114 | Portland General Electric Co | Goldman Sachs | 76 |
| (142) | Ping Identity Holding Corp | Bank of America | | 294 | Portland General Electric Co | Morgan Stanley | 50 |
| | | Merrill Lynch | 7 | 47 | Poshmark Inc 'A' | Bank of America | |
| (288) | Ping Identity Holding Corp | Goldman Sachs | 14 | | | Merrill Lynch | (12) |
| (101) | Pinnacle Financial Partners Inc | Bank of America | | 535 | Poshmark Inc 'A' | Goldman Sachs | (139) |
| | | Merrill Lynch | (309) | (518) | Post Holdings Inc | Bank of America | |
| (34) | Pinnacle Financial Partners Inc [†] | Goldman Sachs | — | | | Merrill Lynch | (676) |
| (363) | Pinnacle Financial Partners Inc | | | (392) | Post Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.267) |
| (404) | Pinnacle West Capital Corp | Morgan Stanley | (1.154) | (179) | PotlatchDeltic Corp (REIT) | Bank of America | |
| (450) | Pinterest Inc 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (172) |
| | | Merrill Lynch | 1.224 | (219) | PotlatchDeltic Corp (REIT) | Goldman Sachs | (210) |
| (1.806) | Pinterest Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.805 | 338 | Power Integrations Inc | Bank of America | |
| (987) | Pinterest Inc 'A' | Morgan Stanley | 589 | | | Merrill Lynch | 389 |
| (123) | Pioneer Natural Resources Co | Bank of America | | 459 | Power Integrations Inc | Morgan Stanley | 725 |
| (349) | Pioneer Natural Resources Co | Merrill Lynch | (2.399) | 38 | PowerSchool Holdings Inc 'A' | Bank of America | |
| (561) | Pioneer Natural Resources Co | Goldman Sachs | (5.420) | | | Merrill Lynch | (8) |
| | | | | (282) | PPG Industries Inc | Bank of America | |
| 33 | Piper Sandler Cos | Morgan Stanley | (6.846) | | | Merrill Lynch | (1.098) |
| | | Bank of America | | (1.545) | PPL Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 62 | | | Merrill Lynch | (1.672) |
| 31 | Piper Sandler Cos | Goldman Sachs | 72 | (1.014) | PPL Corp | Goldman Sachs | (747) |
| (756) | Pitney Bowes Inc | Bank of America | | (1.042) | PPL Corp | Morgan Stanley | (565) |
| | | Merrill Lynch | (15) | (84) | PRA Group Inc | Bank of America | |
| (791) | Pitney Bowes Inc | Goldman Sachs | (16) | | | Merrill Lynch | 65 |
| 190 | PJT Partners Inc 'A' | Bank of America | | (39) | PRA Group Inc | Goldman Sachs | 17 |
| | | Merrill Lynch | 709 | (396) | Praxis Precision Medicines Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 495 |
| | | | | (33) | Praxis Precision Medicines Inc | | |
| | | | | (121) | Precision BioSciences Inc | Goldman Sachs | 8 |
| | | | | (106) | Prelude Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (16) |
| | | | | 717 | Premier Financial Corp | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 480 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|---|---|---|--|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.347 (893) | Premier Financial Corp Premier Inc 'A' | Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch | 902 (272) | (1.205) | Public Service Enterprise Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (890) |
| (472) | Premier Inc 'A' | Goldman Sachs | (186) | (1.103) | Public Service Enterprise Group Inc | Morgan Stanley | (12) |
| 230 | Prestige Consumer Healthcare Inc | Bank of America Merrill Lynch | (361) | 286 | Public Storage (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 5.418 |
| 827 | Prestige Consumer Healthcare Inc | Goldman Sachs | (1.298) | 131 | Public Storage (REIT) | Goldman Sachs | 1.559 |
| 10 | PriceSmart Inc | Goldman Sachs | (6) | 132 | Public Storage (REIT) | Morgan Stanley | 1.675 |
| 511 | Primoris Services Corp | Bank of America Merrill Lynch | 588 | (474) | Pulmonx Corp | Bank of America Merrill Lynch | (152) |
| 557 | Primoris Services Corp | Goldman Sachs | 641 | (517) | Pulmonx Corp | Goldman Sachs | (165) |
| (32) | Principal Financial Group Inc | Morgan Stanley | (1) | (796) | Pulse Evolution Group Inc | Goldman Sachs | (47) |
| (390) | Privia Health Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (554) | 43 | PulteGroup Inc | Bank of America Merrill Lynch | 90 |
| (538) | Procore Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.821) | 135 | PulteGroup Inc | Goldman Sachs | 282 |
| (353) | Procore Technologies Inc | Goldman Sachs | (1.017) | 59 | PulteGroup Inc | Morgan Stanley | 141 |
| (1.386) | Procore Technologies Inc | Morgan Stanley | (5.655) | (345) | Pure Storage Inc 'A' | Morgan Stanley | (176) |
| (533) | Procter & Gamble Co | Bank of America Merrill Lynch | (2.958) | (141) | Purple Innovation Inc | Bank of America Merrill Lynch | (114) |
| (52) | Procter & Gamble Co | Goldman Sachs | (63) | (3.452) | Purple Innovation Inc | Goldman Sachs | (2.796) |
| (1.035) | Procter & Gamble Co | Morgan Stanley | (1.449) | 753 | PVH Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.781 |
| 481 | PROG Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.000 | 826 | PVH Corp | Goldman Sachs | 2.674 |
| 288 | PROG Holdings Inc | Goldman Sachs | 665 | 433 | PVH Corp | Morgan Stanley | 2.451 |
| (422) | Progress Software Corp | Bank of America Merrill Lynch | (387) | 160 | Q2 Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.538 |
| (596) | Progress Software Corp | Goldman Sachs | (533) | 323 | Q2 Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.055 |
| (572) | Progressive Corp | Morgan Stanley | (3.300) | (86) | QCR Holdings Inc | Goldman Sachs | (262) |
| (546) | Progyny Inc | Goldman Sachs | 1.147 | 461 | Qorvo Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.825 |
| (431) | Progyny Inc | Morgan Stanley | 237 | 130 | Qorvo Inc | Goldman Sachs | 1.068 |
| 428 | Prologis Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 2.930 | 374 | Qorvo Inc | Morgan Stanley | 1.709 |
| 175 | Prologis Inc (REIT) | Goldman Sachs | 638 | 20 | Quaker Chemical Corp | Bank of America Merrill Lynch | 180 |
| 84 | Prologis Inc (REIT) | Morgan Stanley | 492 | 248 | Quaker Chemical Corp | Goldman Sachs | 2.658 |
| (193) | Prometheus Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | 533 | (191) | QUALCOMM Inc | Goldman Sachs | (639) |
| (41) | Prometheus Biosciences Inc | Goldman Sachs | 113 | (537) | Qualtrics International Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 83 |
| 493 | ProPetro Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | 329 | (925) | Qualtrics International Inc 'A' | Goldman Sachs | 488 |
| 177 | ProPetro Holding Corp | Goldman Sachs | 124 | (777) | Qualtrics International Inc 'A' | Morgan Stanley | 412 |
| 68 | PROS Holdings Inc | Goldman Sachs | 101 | 344 | Qualys Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.714 |
| (1.112) | Prosperity Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.969) | 116 | Qualys Inc | Goldman Sachs | 1.927 |
| (1.013) | Prosperity Bancshares Inc | Goldman Sachs | (3.634) | 112 | Qualys Inc | Morgan Stanley | 1.219 |
| (870) | Prosperity Bancshares Inc | Morgan Stanley | (1.394) | 91 | Quanex Building Products Corp | Bank of America Merrill Lynch | 68 |
| (16) | Protagonist Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2) | 124 | Quanex Building Products Corp | Goldman Sachs | 92 |
| (12) | Proterra Inc | Bank of America Merrill Lynch | (12) | 139 | Quanta Services Inc | Goldman Sachs | 1.294 |
| (6.581) | Proterra Inc | Goldman Sachs | (6.811) | (214) | Quanterix Corp | Bank of America Merrill Lynch | 32 |
| 73 | Prothena Corp Plc | Bank of America Merrill Lynch | 126 | (153) | Quanterix Corp | Goldman Sachs | 72 |
| 57 | Prothena Corp Plc | Goldman Sachs | 98 | (1.546) | QuantumScape Corp | Morgan Stanley | (1.994) |
| 119 | Proto Labs Inc | Bank of America Merrill Lynch | 519 | (433) | Quantum-Si Inc | Goldman Sachs | (342) |
| 158 | Proto Labs Inc | Goldman Sachs | 763 | (128) | Quest Diagnostics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (224) |
| (3.932) | Provention Bio Inc | Goldman Sachs | 668 | (80) | Quest Diagnostics Inc | Goldman Sachs | (386) |
| (90) | Provident Financial Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | (67) | (288) | Quest Diagnostics Inc | Morgan Stanley | (196) |
| 53 | Prudential Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | 91 | 67 | QuidelOrtho Corp | Morgan Stanley | 72 |
| 142 | Prudential Financial Inc | Goldman Sachs | 835 | 1.878 | QuinStreet Inc | Goldman Sachs | 1.671 |
| 22 | Prudential Financial Inc | Morgan Stanley | 122 | (3.337) | Quotient Technology Inc | Goldman Sachs | (501) |
| (30) | PTC Inc | Bank of America Merrill Lynch | (252) | 3.130 | Qurate Retail Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (203) |
| 55 | PTC Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (47) | 2.634 | Qurate Retail Inc 'A' | Goldman Sachs | (171) |
| | | | | (2.741) | R1 RCM Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.070 |
| | | | | (1.046) | R1 RCM Inc | Goldman Sachs | 1.172 |
| | | | | (2.692) | R1 RCM Inc | Morgan Stanley | 1.454 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (237) | Rackspace Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | 28 | (120) | REGENXBIO Inc | Bank of America Merrill Lynch | (109) |
| (748) | Rackspace Technology Inc | Goldman Sachs | 90 | (674) | REGENXBIO Inc | Goldman Sachs | (613) |
| 1.059 | Radian Group Inc | Goldman Sachs | 74 | (343) | Regions Financial Corp | Morgan Stanley | (367) |
| 80 | Radian Group Inc | Morgan Stanley | 46 | 247 | Reinsurance Group of America Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.603 |
| (239) | Radius Health Inc | Bank of America Merrill Lynch | (148) | 272 | Reinsurance Group of America Inc | Goldman Sachs | 1.765 |
| (61) | Radius Health Inc | Goldman Sachs | (38) | 728 | Reinsurance Group of America Inc | Morgan Stanley | 2.781 |
| 258 | Radware Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 152 | (448) | Relay Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 139 |
| 185 | Radware Ltd | Goldman Sachs | 109 | (263) | Relay Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 124 |
| 131 | Ralph Lauren Corp | Bank of America Merrill Lynch | 317 | 193 | Reliance Steel & Aluminum Co | Bank of America Merrill Lynch | 2.002 |
| 479 | Ralph Lauren Corp | Goldman Sachs | 625 | 51 | Reliance Steel & Aluminum Co | Goldman Sachs | 818 |
| 814 | Ralph Lauren Corp | Morgan Stanley | 6.097 | 353 | Reliance Steel & Aluminum Co | Morgan Stanley | 7.413 |
| (16) | Rambus Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4) | (164) | Relmada Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 212 |
| (236) | Rambus Inc | Goldman Sachs | (64) | (50) | Relmada Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 65 |
| 64 | Range Resources Corp | Goldman Sachs | (27) | 257 | RenaissanceRe Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.242 |
| 536 | Range Resources Corp | Morgan Stanley | 3.568 | 203 | RenaissanceRe Holdings Ltd | Goldman Sachs | 999 |
| 1.037 | Ranpak Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.078 | 128 | RenaissanceRe Holdings Ltd | Morgan Stanley | 426 |
| 794 | Ranpak Holdings Corp | Goldman Sachs | 826 | (525) | Rent-A-Center Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.013 |
| (192) | Rapid7 Inc | Morgan Stanley | 77 | (774) | Rent-A-Center Inc | Goldman Sachs | 1.494 |
| 43 | RAPT Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 25 | 299 | Repay Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 182 |
| (76) | Raymond James Financial Inc | Morgan Stanley | (386) | 269 | Repay Holdings Corp | Goldman Sachs | 164 |
| (185) | Rayonier Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (744) | 13 | Repligen Corp | Bank of America Merrill Lynch | (44) |
| (482) | Rayonier Inc (REIT) | Goldman Sachs | (1.938) | 163 | Repligen Corp | Goldman Sachs | 2.564 |
| (1.052) | Rayonier Inc (REIT) | Morgan Stanley | (2.293) | 91 | Repligen Corp | Morgan Stanley | 1.058 |
| (17) | RBC Bearings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (349) | 330 | Replimune Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 59 |
| (11) | RBC Bearings Inc | Goldman Sachs | (261) | 65 | Replimune Group Inc | Goldman Sachs | 12 |
| 46 | RE/MAX Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 23 | 14 | Republic Bancorp Inc 'A' | Goldman Sachs | 27 |
| (253) | Ready Capital Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 11 | 253 | Republic Services Inc | Morgan Stanley | 770 |
| (384) | Ready Capital Corp (REIT) | Goldman Sachs | (47) | (83) | Resideo Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (92) |
| (3.036) | Realogy Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3.947) | (644) | Resideo Technologies Inc | Goldman Sachs | (691) |
| (263) | RealReal Inc | Bank of America Merrill Lynch | 147 | 173 | ResMed Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.380 |
| (170) | RealReal Inc | Goldman Sachs | 95 | 196 | ResMed Inc | Goldman Sachs | 1.401 |
| (470) | Realty Income Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 220 | 64 | ResMed Inc | Morgan Stanley | 338 |
| (256) | Realty Income Corp (REIT) | Goldman Sachs | 5 | (82) | Resources Connection Inc | Goldman Sachs | (84) |
| (1.394) | Realty Income Corp (REIT) | Morgan Stanley | 169 | (873) | Retail Opportunity Investments Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (170) |
| 177 | Reata Pharmaceuticals Inc 'A' | Goldman Sachs | 600 | (642) | Retail Opportunity Investments Corp (REIT) | Goldman Sachs | (125) |
| (368) | Recursion Pharmaceuticals Inc 'A' | Goldman Sachs | (147) | (989) | REV Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (267) |
| (145) | Red Rock Resorts Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (29) | (2.057) | REV Group Inc | Goldman Sachs | (555) |
| (416) | Red Rock Resorts Inc 'A' | Goldman Sachs | (83) | (129) | Revance Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 106 |
| (297) | Red Rock Resorts Inc 'A' | Morgan Stanley | (544) | (166) | Revance Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 136 |
| (307) | Redfin Corp | Bank of America Merrill Lynch | 49 | 150 | REVOLUTION Medicines Inc | Goldman Sachs | 173 |
| 1.878 | Redwood Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 695 | 45 | Revolve Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 83 |
| (454) | Regal Rexnord Corp | Goldman Sachs | (513) | 16 | Revolve Group Inc | Goldman Sachs | (24) |
| (192) | Regal Rexnord Corp | Morgan Stanley | (501) | 76 | REX American Resources Corp | Bank of America Merrill Lynch | (309) |
| 127 | Regency Centers Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 91 | 20 | REX American Resources Corp | Goldman Sachs | (81) |
| 629 | Regency Centers Corp (REIT) | Goldman Sachs | 453 | | | | |
| 581 | Regency Centers Corp (REIT) | Morgan Stanley | 2.826 | | | | |
| 30 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 151 | | | | |
| 29 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (73) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------------|-------------------------------|---|---|---|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 145 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 266 | (43) | Royal Gold Inc | Bank of America Merrill Lynch | 35 |
| 362 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | Goldman Sachs | (783) | (121) | Royal Gold Inc | Morgan Stanley | (231) |
| 452 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | Morgan Stanley | 516 | (222) | RPC Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4) |
| (437) | Reynolds Consumer Products Inc | Bank of America Merrill Lynch | 495 | (23) | RPM International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (107) |
| (1.435) | Reynolds Consumer Products Inc | Goldman Sachs | 1.658 | (46) | RPM International Inc | Goldman Sachs | (130) |
| (72) | RH | Morgan Stanley | (2.324) | (384) | RPM International Inc | Morgan Stanley | (1.402) |
| (380) | Rhythm Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (87) | 393 | RPT Realty (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (102) |
| (115) | Rhythm Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (26) | 818 | RPT Realty (REIT) | Goldman Sachs | (213) |
| 337 | Rigel Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (64) | (376) | Rubius Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 26 |
| (2.962) | Rimini Street Inc | Goldman Sachs | (1.570) | 457 | Rush Enterprises Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (313) |
| 156 | RingCentral Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 622 | 400 | Rush Enterprises Inc 'A' | Goldman Sachs | (274) |
| 833 | RingCentral Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.460 | 304 | Rush Enterprises Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 116 |
| 44 | RingCentral Inc 'A' | Morgan Stanley | 100 | 463 | Rush Enterprises Inc 'B' | Goldman Sachs | 176 |
| (1.949) | Riskified Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.208) | (761) | Rush Street Interactive Inc | Bank of America Merrill Lynch | (145) |
| (1.512) | Riskified Ltd 'A' | Goldman Sachs | (937) | (389) | Rush Street Interactive Inc | Goldman Sachs | (74) |
| (530) | Rivian Automotive Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.714) | (165) | Ruth's Hospitality Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3 |
| 46 | RLI Corp | Bank of America Merrill Lynch | (6) | (630) | Ruth's Hospitality Group Inc | Goldman Sachs | 13 |
| 75 | RLI Corp | Goldman Sachs | (9) | 256 | Ryan Specialty Group Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (284) |
| 1.684 | RLJ Lodging Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 53 | 1.148 | Ryan Specialty Group Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.274) |
| 2.773 | RLJ Lodging Trust (REIT) | Goldman Sachs | 83 | 88 | Ryerson Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | 299 |
| 86 | RMR Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 101 | 89 | Ryerson Holding Corp | Goldman Sachs | 303 |
| 46 | RMR Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 54 | (52) | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (8) |
| (152) | Robert Half International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 155 | (27) | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (4) |
| (65) | Robert Half International Inc | Goldman Sachs | (116) | (276) | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (1.609) |
| (197) | Robert Half International Inc | Morgan Stanley | (21) | 441 | Sabra Health Care Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 370 |
| (2.028) | Robinhood Markets Inc 'A' | Morgan Stanley | (507) | 1.794 | Sabra Health Care Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.495 |
| (320) | ROBLOX Corp 'A' | Goldman Sachs | (467) | 1.307 | Sabre Corp | Bank of America Merrill Lynch | 671 |
| (1.610) | ROBLOX Corp 'A' | Morgan Stanley | (1.642) | 1.088 | Sabre Corp | Goldman Sachs | 616 |
| (3.201) | Rocket Lab USA Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.294 | (514) | Safety Insurance Group Inc | Goldman Sachs | (4.400) |
| (863) | Rocket Lab USA Inc | Goldman Sachs | 123 | 24 | Sage Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (21) |
| 1.060 | Rocket Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.734 | 113 | Sage Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (98) |
| 2.549 | Rocket Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 6.814 | (40) | Saia Inc | Morgan Stanley | (167) |
| (121) | Rockwell Automation Inc | Bank of America Merrill Lynch | (736) | 422 | salesforce.com Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.062) |
| (131) | Rockwell Automation Inc | Morgan Stanley | (761) | 142 | salesforce.com Inc | Goldman Sachs | 380 |
| (420) | Rollins Inc | Goldman Sachs | (416) | 95 | salesforce.com Inc | Morgan Stanley | 125 |
| (1.259) | Rollins Inc | Morgan Stanley | (743) | (669) | Sally Beauty Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (140) |
| (8.409) | Romeo Power Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.424 | (712) | Sally Beauty Holdings Inc | Goldman Sachs | (150) |
| (22.841) | Romeo Power Inc | Goldman Sachs | 3.483 | 1.176 | Sana Biotechnology Inc | Bank of America Merrill Lynch | 188 |
| (2.702) | Root Inc 'A' | Goldman Sachs | (365) | 1.173 | Sana Biotechnology Inc | Goldman Sachs | 188 |
| (101) | Roper Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.021) | (13) | Sandy Spring Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (47) |
| (205) | Ross Stores Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.525) | (75) | Sandy Spring Bancorp Inc | Goldman Sachs | (273) |
| (238) | Ross Stores Inc | Morgan Stanley | (1.495) | 897 | Sangamo Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (215) |
| (4.288) | Roth CH Acquisition I Co Parent Corp | Goldman Sachs | (3.087) | 218 | Sangamo Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (52) |
| (2.597) | Rover Group Inc | Goldman Sachs | (2.389) | 117 | Sanmina Corp | Bank of America Merrill Lynch | 331 |
| 1.069 | Royal Caribbean Cruises Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (482) | | | | |
| 1.407 | Royal Caribbean Cruises Ltd | Goldman Sachs | 880 | | | | |
| 1.186 | Royal Caribbean Cruises Ltd | Morgan Stanley | 6.435 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-----------------|---|---|-----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 55 | Sanmina Corp | Goldman Sachs | 156 | (2.289) | Selectquote Inc | Bank of America | |
| 85 | Sarepta Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 344 | | | Merrill Lynch | (435) |
| 16 | Saul Centers Inc (REIT) | Bank of America | | (3.614) | Selectquote Inc | Goldman Sachs | (547) |
| | | Merrill Lynch | 23 | (674) | Sema4 Holdings Corp | Bank of America | |
| 32 | SBA Communications Corp (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (163) |
| | | Merrill Lynch | (257) | (685) | Sema4 Holdings Corp | Goldman Sachs | (119) |
| 207 | SBA Communications Corp (REIT) | Goldman Sachs | 2.587 | (233) | Sempra Energy | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (215) |
| 299 | SBA Communications Corp (REIT) | Morgan Stanley | 433 | (283) | Sempra Energy | Goldman Sachs | (492) |
| | | | | (737) | Sempra Energy | Morgan Stanley | (766) |
| 163 | ScanSource Inc | Bank of America | | 34 | Semtech Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (23) | | | Merrill Lynch | 127 |
| 60 | ScanSource Inc | Goldman Sachs | (15) | 215 | Semtech Corp | Goldman Sachs | 851 |
| 326 | Schlumberger NV | Bank of America | | 1.371 | Semtech Corp | Morgan Stanley | 4.086 |
| | | Merrill Lynch | 1.778 | (1.201) | Sensata Technologies Holding Plc | Goldman Sachs | (1.839) |
| 1.651 | Schlumberger NV | Goldman Sachs | 9.435 | | | | |
| 1.302 | Schlumberger NV | Morgan Stanley | 5.208 | 258 | Sensient Technologies Corp | Goldman Sachs | 810 |
| (652) | Schneider National Inc 'B' | Bank of America | | (599) | SentinelOne Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (189) | | | Merrill Lynch | (1.911) |
| (1.023) | Schneider National Inc 'B' | Goldman Sachs | (324) | (2.083) | SentinelOne Inc 'A' | Goldman Sachs | (5.996) |
| (135) | Schnitzer Steel Industries Inc 'A' | Bank of America | | (778) | SentinelOne Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.221) |
| | | Merrill Lynch | (454) | 285 | Seres Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (117) |
| (144) | Schnitzer Steel Industries Inc 'A' | Goldman Sachs | (484) | 454 | Service Corp International | Goldman Sachs | 375 |
| | | | | 540 | Service Corp International | Morgan Stanley | (38) |
| (44) | Scholastic Corp | Bank of America | | 47 | ServiceNow Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (44) | | | Merrill Lynch | 1.943 |
| (22) | Scholastic Corp | Goldman Sachs | (22) | 64 | ServiceNow Inc | Goldman Sachs | 2.394 |
| (440) | Schrodinger Inc | Bank of America | | 129 | ServiceNow Inc | Morgan Stanley | 5.205 |
| | | Merrill Lynch | (599) | (68) | ServisFirst Bancshares Inc | Bank of America | |
| (471) | Schrodinger Inc | Goldman Sachs | (943) | | | Merrill Lynch | (148) |
| (252) | Schweitzer-Mauduit International Inc | Bank of America | | 650 | Shake Shack Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (10) | | | Merrill Lynch | 2.686 |
| (1.285) | Schweitzer-Mauduit International Inc | Goldman Sachs | (51) | 1.177 | Shake Shack Inc 'A' | Goldman Sachs | 4.471 |
| | | | | (133) | Shenandoah Telecommunications Co | Goldman Sachs | (279) |
| 282 | Science Applications International Corp | Goldman Sachs | 651 | (141) | Sherwin-Williams Co | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (407) |
| 513 | Science Applications International Corp | Morgan Stanley | 1.790 | (29) | Sherwin-Williams Co | Goldman Sachs | (110) |
| | | Bank of America | | (453) | Sherwin-Williams Co | Morgan Stanley | (3.330) |
| (613) | Scientific Games Corp | Merrill Lynch | (1.955) | (485) | Shift4 Payments Inc 'A' | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (1.115) |
| 186 | Scotts Miracle-Gro Co | Bank of America | | (161) | Shift4 Payments Inc 'A' | Goldman Sachs | (356) |
| | | Merrill Lynch | 266 | (1.155) | Shift4 Payments Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.647) |
| (16) | Seaboard Corp | Goldman Sachs | (5.264) | (43) | Shoals Technologies Group Inc 'A' | Bank of America | |
| (12) | Seagate Technology Holdings Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (40) |
| | | Merrill Lynch | 6 | (472) | Shoals Technologies Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.170) |
| (286) | Seagate Technology Holdings Plc | Goldman Sachs | 152 | 99 | Shockwave Medical Inc | Goldman Sachs | 1.597 |
| | | | | (268) | Shoe Carnival Inc | Bank of America | |
| (534) | Seagate Technology Holdings Plc | Morgan Stanley | (198) | | | Merrill Lynch | 678 |
| 94 | Seagen Inc | Goldman Sachs | (340) | (364) | Shoe Carnival Inc | Goldman Sachs | 921 |
| 222 | Seagen Inc | Morgan Stanley | (93) | 19 | ShotSpotter Inc | Bank of America | |
| | | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 66 |
| (42) | Sealed Air Corp | Merrill Lynch | (79) | 93 | Shutterstock Inc | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | (2) | | | Merrill Lynch | (267) |
| (146) | Sealed Air Corp | Morgan Stanley | 9 | 20 | Shutterstock Inc | Goldman Sachs | (3) |
| (33) | Sealed Air Corp | Bank of America | | 288 | Shyft Group Inc | Bank of America | |
| (704) | SeaWorld Entertainment Inc | Merrill Lynch | 806 | | | Merrill Lynch | 27 |
| | | | (91) | 103 | Shyft Group Inc | Goldman Sachs | 104 |
| (1.768) | SeaWorld Entertainment Inc | Goldman Sachs | (91) | (383) | SI-BONE Inc | Bank of America | |
| (130) | Seer Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (452) |
| | | Merrill Lynch | (172) | (46) | SI-BONE Inc | Goldman Sachs | (79) |
| (1.931) | Seer Inc | Goldman Sachs | (173) | (2.277) | Sight Sciences Inc | Goldman Sachs | (1.230) |
| 233 | SEI Investments Co | Morgan Stanley | 578 | (203) | Signature Bank | Bank of America | |
| 178 | Select Medical Holdings Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (4.632) |
| | | Merrill Lynch | 39 | (69) | Signature Bank | Goldman Sachs | (1.575) |
| 844 | Select Medical Holdings Corp | Goldman Sachs | 186 | (99) | Signature Bank | Morgan Stanley | (1.189) |
| | | | | (59) | Signet Jewelers Ltd | Goldman Sachs | 152 |
| (56) | Selective Insurance Group Inc | Bank of America | (68) | (280) | Signify Health Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | | | | Merrill Lynch | (280) |
| (50) | Selective Insurance Group Inc | Goldman Sachs | (61) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|-----------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (735) | Signify Health Inc 'A' | Goldman Sachs | (735) | 23 | SL Green Realty Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (34) |
| (813) | Silgan Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 98 | 576 | SL Green Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | (858) |
| (1.977) | Silgan Holdings Inc | Goldman Sachs | 237 | 633 | SL Green Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | 696 |
| 298 | Silicon Laboratories Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.989 | 31 | Sleep Number Corp | Goldman Sachs | 100 |
| 177 | Silicon Laboratories Inc | Goldman Sachs | 1.775 | (1.018) | SLM Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.586) |
| 16 | Silicon Laboratories Inc | Morgan Stanley | 168 | (425) | SLM Corp | Goldman Sachs | (1.080) |
| (81) | Silk Road Medical Inc | Bank of America Merrill Lynch | (246) | (1.487) | SLM Corp | Morgan Stanley | (2.141) |
| (87) | Silk Road Medical Inc | Goldman Sachs | (264) | 45 | SM Energy Co | Goldman Sachs | 147 |
| (16) | Silvergate Capital Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (72) | 1.112 | SM Energy Co | Morgan Stanley | 13.155 |
| (148) | Silvergate Capital Corp 'A' | Goldman Sachs | (1.755) | 363 | SMART Global Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 679 |
| (68) | Simmons First National Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (37) | 502 | SMART Global Holdings Inc | Goldman Sachs | 939 |
| (45) | Simmons First National Corp 'A' | Goldman Sachs | (63) | 166 | Snap Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.313) |
| (263) | Simon Property Group Inc (REIT) | Morgan Stanley | (2.057) | 2.484 | Snap Inc 'A' | Goldman Sachs | (15.328) |
| 489 | Simply Good Foods Co | Bank of America Merrill Lynch | 688 | 4.267 | Snap Inc 'A' | Morgan Stanley | (13.800) |
| 376 | Simply Good Foods Co | Goldman Sachs | 546 | 168 | Snap-on Inc | Goldman Sachs | 627 |
| 70 | Simulations Plus Inc | Bank of America Merrill Lynch | 222 | 143 | Snap-on Inc | Morgan Stanley | 1.180 |
| 114 | Simulations Plus Inc | Goldman Sachs | 361 | (191) | Snowflake Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 2.076 |
| 474 | Sinclair Broadcast Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (307) | (116) | Snowflake Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.373 |
| 806 | Sinclair Broadcast Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (567) | (353) | Snowflake Inc 'A' | Morgan Stanley | 3.869 |
| 16.870 | Sirius XM Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.193 | (412) | SoFi Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (260) |
| 504 | SiriusPoint Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (181) | (835) | SoFi Technologies Inc | Goldman Sachs | (526) |
| 246 | SiriusPoint Ltd | Goldman Sachs | (89) | (2.217) | SoFi Technologies Inc | Morgan Stanley | (599) |
| 235 | SITE Centers Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 219 | (13) | SolarEdge Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (718) |
| 360 | SiteOne Landscape Supply Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.012 | (13) | SolarEdge Technologies Inc | Goldman Sachs | (284) |
| 179 | SiteOne Landscape Supply Inc | Goldman Sachs | 503 | (33) | SolarEdge Technologies Inc | Morgan Stanley | (738) |
| 233 | SiteOne Landscape Supply Inc | Morgan Stanley | 1.743 | 252 | SolarWinds Corp | Bank of America Merrill Lynch | 159 |
| (39) | SiTime Corp | Bank of America Merrill Lynch | (716) | 95 | SolarWinds Corp | Goldman Sachs | 60 |
| (49) | SiTime Corp | Goldman Sachs | (668) | 75 | Sonic Automotive Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 2 |
| (218) | SiTime Corp | Morgan Stanley | (1.877) | 77 | Sonic Automotive Inc 'A' | Goldman Sachs | 2 |
| (192) | Six Flags Entertainment Corp | Bank of America Merrill Lynch | (120) | (639) | Sonoco Products Co | Bank of America Merrill Lynch | (313) |
| 103 | SJW Group | Bank of America Merrill Lynch | 2 | (577) | Sonoco Products Co | Goldman Sachs | (283) |
| 147 | SJW Group | Goldman Sachs | (12) | 402 | Sonos Inc | Goldman Sachs | — |
| (807) | Skechers USA Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.535) | 2.250 | Sorrento Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 416 |
| (1.588) | Skechers USA Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.947) | 6.192 | Sorrento Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.146 |
| (1.023) | Skechers USA Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.363) | (806) | Sotera Health Co | Bank of America Merrill Lynch | (959) |
| (120) | Skillsoft Corp | Goldman Sachs | (108) | (845) | Sotera Health Co | Goldman Sachs | (1.006) |
| (333) | Skillz Inc | Goldman Sachs | (52) | (67) | South State Corp | Bank of America Merrill Lynch | (290) |
| (155) | Skyline Champion Corp | Bank of America Merrill Lynch | 116 | (165) | South State Corp | Morgan Stanley | (606) |
| (223) | Skyline Champion Corp | Goldman Sachs | 167 | (91) | Southern Co | Bank of America Merrill Lynch | (102) |
| (570) | SkyWater Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (433) | (151) | Southern Co | Morgan Stanley | (207) |
| (484) | SkyWater Technology Inc | Goldman Sachs | (368) | (491) | Southside Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (730) |
| 1.524 | SkyWest Inc | Goldman Sachs | 716 | (147) | Southside Bancshares Inc | Goldman Sachs | (213) |
| 124 | Skyworks Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 786 | (469) | Southwest Airlines Co | Bank of America Merrill Lynch | (881) |
| 130 | Skyworks Solutions Inc | Goldman Sachs | 765 | (882) | Southwest Airlines Co | Goldman Sachs | (2.025) |
| 258 | Skyworks Solutions Inc | Morgan Stanley | 1.476 | (1.625) | Southwest Airlines Co | Morgan Stanley | (3.715) |
| | | | | (108) | Southwest Gas Holdings Inc | Morgan Stanley | 2 |
| | | | | (3.451) | Southwestern Energy Co | Bank of America Merrill Lynch | (8.766) |
| | | | | (5.106) | Southwestern Energy Co | Goldman Sachs | (12.969) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|----------------------------------|---|---|---------------------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (2.134) | Southwestern Energy Co | Morgan Stanley | (3.414) | (72) | Starbucks Corp | Morgan Stanley | (355) |
| 72 | SP Plus Corp | Bank of America Merrill Lynch | 122 | (1.252) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.163) |
| 21 | SP Plus Corp | Goldman Sachs | 35 | (1.039) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (391) |
| (55) | SpartanNash Co | Goldman Sachs | (2) | (4.833) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (3.042) |
| (372) | Spectrum Brands Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (126) | 151 | State Street Corp | Goldman Sachs | 563 |
| (577) | Spectrum Brands Holdings Inc | Goldman Sachs | (283) | 249 | State Street Corp | Morgan Stanley | 575 |
| (724) | Spire Global Inc | Bank of America Merrill Lynch | (123) | (95) | Steel Dynamics Inc | Goldman Sachs | (965) |
| (518) | Spire Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.254) | (1.191) | Steel Dynamics Inc | Morgan Stanley | (8.504) |
| (267) | Spire Inc | Goldman Sachs | (646) | (164) | Steelcase Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (86) |
| 727 | Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.083 | (501) | Steelcase Inc 'A' | Goldman Sachs | (263) |
| 310 | Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 462 | (3.872) | Stem Inc | Goldman Sachs | (6.079) |
| 336 | Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 504 | 34 | Stepan Co | Bank of America Merrill Lynch | 150 |
| (532) | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (868) | 73 | Stepan Co | Goldman Sachs | 323 |
| (1.483) | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | Morgan Stanley | (2.441) | (17) | StepStone Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (52) |
| 40 | Splunk Inc | Bank of America Merrill Lynch | 342 | (54) | StepStone Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (165) |
| 183 | Splunk Inc | Goldman Sachs | 1.512 | (353) | Stericycle Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.101) |
| 404 | Splunk Inc | Morgan Stanley | 3.465 | (38) | Stericycle Inc | Goldman Sachs | (119) |
| 70 | Sportsman's Warehouse Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6 | (51) | STERIS Plc | Goldman Sachs | 232 |
| (455) | Sprinklr Inc 'A' | Goldman Sachs | (752) | (118) | STERIS Plc | Morgan Stanley | (117) |
| (143) | Sprout Social Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.398) | (225) | Steven Madden Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 124 |
| (22) | Sprout Social Inc 'A' | Goldman Sachs | (122) | (419) | Steven Madden Ltd | Goldman Sachs | 230 |
| 732 | Sprouts Farmers Market Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.376 | 386 | Stifel Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 822 |
| 228 | Sprouts Farmers Market Inc | Goldman Sachs | 656 | 189 | Stifel Financial Corp | Goldman Sachs | 403 |
| 30 | SPS Commerce Inc | Bank of America Merrill Lynch | 73 | 407 | Stifel Financial Corp | Morgan Stanley | 716 |
| 215 | SPS Commerce Inc | Goldman Sachs | 525 | 2.185 | Stitch Fix Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.420 |
| 216 | SPX Corp | Bank of America Merrill Lynch | 829 | (11) | Stock Yards Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (69) |
| 71 | SPX Corp | Goldman Sachs | 273 | (29) | Stock Yards Bancorp Inc | Goldman Sachs | (181) |
| (170) | SS&C Technologies Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (649) | 537 | Stoke Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (2.024) |
| (32) | SS&C Technologies Holdings Inc | Goldman Sachs | (82) | (37) | Stoneridge Inc | Goldman Sachs | (114) |
| (436) | SS&C Technologies Holdings Inc | Morgan Stanley | (880) | 152 | StoneX Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 532 |
| (61) | St Joe Co | Bank of America Merrill Lynch | (109) | 73 | StoneX Group Inc | Goldman Sachs | 255 |
| (301) | St Joe Co | Goldman Sachs | (539) | 248 | STORE Capital Corp (REIT) | Morgan Stanley | 260 |
| 45 | STAAR Surgical Co | Bank of America Merrill Lynch | 468 | (35) | Stride Inc | Bank of America Merrill Lynch | (79) |
| 374 | STAAR Surgical Co | Goldman Sachs | 4.039 | (33) | Stride Inc | Goldman Sachs | (78) |
| 447 | STAG Industrial Inc (REIT) | Morgan Stanley | 210 | (158) | Stryker Corp | Bank of America Merrill Lynch | 98 |
| 125 | Stagwell Inc | Bank of America Merrill Lynch | 71 | (85) | Stryker Corp | Morgan Stanley | 11 |
| (161) | Standard BioTools Inc | Bank of America Merrill Lynch | 21 | 576 | Summit Hotel Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (17) |
| (153) | Standard BioTools Inc | Goldman Sachs | 20 | 158 | Summit Hotel Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (5) |
| 18 | Standard Motor Products Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4 | 873 | Summit Materials Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.388 |
| 11 | Standard Motor Products Inc | Goldman Sachs | (19) | 1.160 | Summit Materials Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.844 |
| 116 | Stanley Black & Decker Inc | Bank of America Merrill Lynch | 31 | 13 | Sun Communities Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 48 |
| (902) | Starbucks Corp | Bank of America Merrill Lynch | (4.109) | 35 | Sun Communities Inc (REIT) | Goldman Sachs | 238 |
| (643) | Starbucks Corp | Goldman Sachs | (2.970) | 236 | Sun Communities Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.297 |
| | | | | (351) | Sun Country Airlines Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 276 |
| | | | | (120) | Sun Country Airlines Holdings Inc | Goldman Sachs | 85 |
| | | | | 98 | SunCoke Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 47 |
| | | | | 163 | Sunnova Energy International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 748 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.214 | Sunnova Energy International Inc | Goldman Sachs | 5.572 | (128) | Tango Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (168) |
| 1.477 | SunPower Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4.195 | 354 | Tapestry Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6 |
| 945 | SunPower Corp | Goldman Sachs | 2.633 | 799 | Tapestry Inc | Goldman Sachs | 2.464 |
| (1.216) | Sunrun Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.264) | 754 | Tapestry Inc | Morgan Stanley | 2.089 |
| (742) | Sunrun Inc | Goldman Sachs | (4.207) | 78 | Targa Resources Corp | Bank of America Merrill Lynch | 41 |
| (2.104) | Sunrun Inc | Morgan Stanley | (6.270) | 483 | Targa Resources Corp | Goldman Sachs | 256 |
| 128 | Super Micro Computer Inc | Bank of America Merrill Lynch | (403) | (84) | Target Corp | Goldman Sachs | 152 |
| 92 | Super Micro Computer Inc | Goldman Sachs | (54) | (87) | Target Corp | Morgan Stanley | (845) |
| 638 | Supernus Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 490 | 19 | Taro Pharmaceutical Industries Ltd | Goldman Sachs | (28) |
| 391 | Supernus Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 235 | (153) | TaskUS Inc 'A' | Goldman Sachs | (352) |
| 181 | Surgery Partners Inc | Bank of America Merrill Lynch | 80 | 474 | Taylor Morrison Home Corp | Bank of America Merrill Lynch | 716 |
| (28) | Surmodics Inc | Goldman Sachs | (92) | 75 | Taylor Morrison Home Corp | Goldman Sachs | 113 |
| 71 | Sutro Biopharma Inc | Bank of America Merrill Lynch | (20) | (68) | Taysha Gene Therapies Inc | Goldman Sachs | 46 |
| (23) | SVB Financial Group | Goldman Sachs | (1.216) | (140) | TD SYNEX Corp | Bank of America Merrill Lynch | (484) |
| (83) | SVB Financial Group | Morgan Stanley | (3.071) | (473) | TD SYNEX Corp | Morgan Stanley | (1.769) |
| 284 | Sylvamo Corp | Goldman Sachs | 812 | (288) | TE Connectivity Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.723) |
| (103) | Synaptics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (416) | (148) | TE Connectivity Ltd | Goldman Sachs | (293) |
| (100) | Synaptics Inc | Goldman Sachs | (404) | (138) | TE Connectivity Ltd | Morgan Stanley | (705) |
| (39) | Synaptics Inc | Morgan Stanley | (330) | 828 | TechnipFMC Plc | Bank of America Merrill Lynch | 770 |
| 1.546 | Synchrony Financial | Goldman Sachs | 4.932 | 424 | TechnipFMC Plc | Goldman Sachs | 394 |
| 294 | Synchrony Financial | Morgan Stanley | 661 | 78 | TechTarget Inc | Goldman Sachs | 276 |
| 438 | Syndax Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.025 | (181) | Tejon Ranch Co | Bank of America Merrill Lynch | 16 |
| 233 | Syndax Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 545 | (538) | Tejon Ranch Co | Goldman Sachs | 48 |
| 286 | Syneos Health Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.236 | (74) | Teledyne Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (199) |
| 444 | Syneos Health Inc | Goldman Sachs | 1.918 | (63) | Teledyne Technologies Inc | Goldman Sachs | 18 |
| 489 | Syneos Health Inc | Morgan Stanley | 1.374 | 65 | Teleflex Inc | Morgan Stanley | (52) |
| (60) | Synopsys Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.659) | 243 | Teleflex Inc | Bank of America Merrill Lynch | 298 |
| (19) | Synopsys Inc | Goldman Sachs | (842) | (332) | Telephone and Data Systems Inc | Morgan Stanley | (833) |
| (125) | Synopsys Inc | Morgan Stanley | (1.383) | (279) | Telephone and Data Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (93) |
| (266) | Synovus Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (681) | (109) | Tellurian Inc | Goldman Sachs | (78) |
| (872) | Synovus Financial Corp | Goldman Sachs | (2.232) | (1.002) | Telos Corp | Bank of America Merrill Lynch | (40) |
| (901) | Synovus Financial Corp | Morgan Stanley | (982) | (680) | Telos Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.375) |
| (175) | Sysco Corp | Morgan Stanley | (793) | (597) | Tempur Sealy International Inc | Goldman Sachs | (1.612) |
| (199) | T Rowe Price Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.081) | (2.344) | Tempur Sealy International Inc | Goldman Sachs | (60) |
| (295) | T Rowe Price Group Inc | Goldman Sachs | (2.031) | 185 | Tenable Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 844 |
| (236) | T Rowe Price Group Inc | Morgan Stanley | (1.303) | 197 | Tenable Holdings Inc | Goldman Sachs | 898 |
| 1.582 | Taboola.com Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 633 | (7.444) | Tenaris SA | Bank of America Merrill Lynch | (3.947) |
| 1.185 | Taboola.com Ltd | Goldman Sachs | 474 | (4.425) | Tenaris SA | Goldman Sachs | (2.346) |
| 700 | Tactile Systems Technology Inc | Goldman Sachs | (105) | (1.305) | Tenaris SA | Morgan Stanley | (727) |
| 121 | Take-Two Interactive Software Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.724 | (65) | Tenet Healthcare Corp | Bank of America Merrill Lynch | (122) |
| 53 | Take-Two Interactive Software Inc | Goldman Sachs | 620 | (279) | Tenet Healthcare Corp | Goldman Sachs | 1.599 |
| 149 | Take-Two Interactive Software Inc | Morgan Stanley | 334 | (594) | Tenet Healthcare Corp | Morgan Stanley | (392) |
| 25 | Talos Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 95 | (277) | Tennant Co | Goldman Sachs | (590) |
| 323 | Talos Energy Inc | Goldman Sachs | 1.231 | 196 | Teradata Corp | Bank of America Merrill Lynch | 302 |
| 334 | Tandem Diabetes Care Inc | Goldman Sachs | 514 | 126 | Teradyne Inc | Goldman Sachs | 532 |
| (229) | Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (297) | 367 | Teradyne Inc | Morgan Stanley | 1.782 |
| | | | | (674) | Terreno Realty Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (15) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|---------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (238) | Terreno Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | 30 | 28 | Torchmark Corp | Bank of America | |
| (684) | Terreno Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | (418) | | | Merrill Lynch | 21 |
| (256) | Tesla Inc | Morgan Stanley | (19.989) | 216 | Torchmark Corp | Goldman Sachs | 251 |
| 221 | Tetra Tech Inc | Morgan Stanley | 2.016 | 53 | Torchmark Corp | Morgan Stanley | 39 |
| 2.440 | Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR | Bank of America | | (143) | Toro Co | Bank of America | |
| 4.301 | Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR | Merrill Lynch | 2.464 | | | Merrill Lynch | (486) |
| 4.287 | Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR | Goldman Sachs | 4.344 | (191) | Toro Co | Goldman Sachs | (649) |
| 768 | Texas Capital Bancshares Inc | Morgan Stanley | 2.015 | (443) | Toro Co | Morgan Stanley | (2.569) |
| 1.021 | Texas Capital Bancshares Inc | Bank of America | 2.952 | 366 | Towne Bank | Bank of America | |
| 249 | Texas Instruments Inc | Merrill Lynch | 3.931 | 746 | Towne Bank | Merrill Lynch | 553 |
| (7) | Texas Pacific Land Corp | Goldman Sachs | 1.108 | 462 | TPG RE Finance Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.126 |
| 115 | Texas Roadhouse Inc | Morgan Stanley | (1.277) | (254) | TPI Composites Inc | Bank of America | 92 |
| (982) | TFS Financial Corp | Goldman Sachs | 428 | (109) | Tractor Supply Co | Merrill Lynch | (682) |
| (2.497) | TFS Financial Corp | Bank of America | (2.272) | (178) | Trade Desk Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.343) |
| 327 | TG Therapeutics Inc | Merrill Lynch | (894) | (266) | Trade Desk Inc 'A' | Bank of America | (62) |
| 68 | TG Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (117) | (147) | Trade Desk Inc 'A' | Merrill Lynch | (93) |
| (368) | Theravance Biopharma Inc | Bank of America | 55 | (260) | Tradeweb Markets Inc 'A' | Morgan Stanley | 173 |
| (410) | Theravance Biopharma Inc | Merrill Lynch | 62 | (296) | Tradeweb Markets Inc 'A' | Bank of America | (525) |
| (47) | Thermo Fisher Scientific Inc | Goldman Sachs | (1.088) | (559) | Tradeweb Markets Inc 'A' | Merrill Lynch | (575) |
| (39) | Thermo Fisher Scientific Inc | Bank of America | (1.086) | (232) | Traeger Inc | Morgan Stanley | (1.111) |
| (6) | Thermo Fisher Scientific Inc | Merrill Lynch | (97) | 191 | Trane Technologies Plc | Goldman Sachs | 218 |
| (83) | Thermon Group Holdings Inc | Goldman Sachs | (53) | 127 | Trane Technologies Plc | Bank of America | 369 |
| (274) | Thermon Group Holdings Inc | Morgan Stanley | (175) | 35 | Trane Technologies Plc | Goldman Sachs | 245 |
| 226 | Thor Industries Inc | Bank of America | 922 | (252) | TransMedics Group Inc | Merrill Lynch | 204 |
| (1.484) | ThredUp Inc 'A' | Merrill Lynch | 795 | (156) | TransMedics Group Inc | Bank of America | (436) |
| (1.561) | ThredUp Inc 'A' | Goldman Sachs | 914 | 5.367 | Transocean Ltd | Goldman Sachs | (270) |
| (369) | Thryv Holdings Inc | Bank of America | (813) | 5.217 | Transocean Ltd | Merrill Lynch | 1.825 |
| (242) | Thryv Holdings Inc | Merrill Lynch | (583) | (508) | TransUnion | Goldman Sachs | 1.774 |
| 773 | Timken Co | Bank of America | 1.977 | (363) | TransUnion | Bank of America | (2.229) |
| 61 | Timken Co | Merrill Lynch | 82 | (89) | TransUnion | Merrill Lynch | (1.727) |
| 451 | Timken Co | Goldman Sachs | 757 | 1.893 | Travel + Leisure Co | Goldman Sachs | (370) |
| (1.512) | TJX Cos Inc | Morgan Stanley | (8.411) | 995 | Travel + Leisure Co | Merrill Lynch | 2.613 |
| (1.100) | TJX Cos Inc | Bank of America | (3.463) | 3.808 | Travel + Leisure Co | Goldman Sachs | 1.184 |
| (445) | TJX Cos Inc | Merrill Lynch | (907) | (20) | Travelers Cos Inc | Morgan Stanley | 10.176 |
| 242 | T-Mobile US Inc | Bank of America | 1.468 | (26) | Travelers Cos Inc | Bank of America | (146) |
| 66 | T-Mobile US Inc | Merrill Lynch | 214 | (73) | Travelers Cos Inc | Goldman Sachs | (235) |
| (808) | Toast Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.262) | 58 | Traverse Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (326) |
| (1.555) | Toast Inc 'A' | Morgan Stanley | (4.354) | (27) | Treace Medical Concepts Inc | Bank of America | 11 |
| (2.260) | Toast Inc 'A' | Bank of America | (3.119) | (5.008) | Tredegar Corp | Merrill Lynch | (46) |
| 691 | Toll Brothers Inc | Merrill Lynch | 2.258 | (85) | TreeHouse Foods Inc | Goldman Sachs | (5.809) |
| 58 | Toll Brothers Inc | Bank of America | 99 | (978) | TreeHouse Foods Inc | Bank of America | (265) |
| 436 | Toll Brothers Inc | Merrill Lynch | 844 | (131) | Trex Co Inc | Merrill Lynch | (3.051) |
| 35 | Tompkins Financial Corp | Goldman Sachs | 106 | 664 | Tri Pointe Homes Inc | Goldman Sachs | 362 |
| (253) | Tootsie Roll Industries Inc | Morgan Stanley | 415 | 269 | TriCo Bancshares | Goldman Sachs | 398 |
| (441) | Tootsie Roll Industries Inc | Bank of America | 723 | (28) | TriMas Corp | Goldman Sachs | 1.054 |
| (26) | TopBuild Corp | Merrill Lynch | 36 | (406) | Trimble Inc | Goldman Sachs | (1) |
| (174) | TopBuild Corp | Goldman Sachs | (45) | (517) | Trimble Inc | Goldman Sachs | (1.121) |
| | | | | (85) | TriNet Group Inc | Morgan Stanley | (548) |
| | | | | (28) | TriNet Group Inc | Bank of America | 208 |
| | | | | 559 | Trinity Industries Inc | Goldman Sachs | 69 |
| | | | | 183 | Trinity Industries Inc | Bank of America | 90 |
| | | | | (69) | Trinseo Plc | Merrill Lynch | 30 |
| | | | | (73) | Trinseo Plc | Bank of America | (202) |
| | | | | 564 | TripAdvisor Inc | Goldman Sachs | (175) |
| | | | | | | Morgan Stanley | 756 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-------------------------------|---|---|-------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (281) | Triton International Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (905) | (44) | Ulta Beauty Inc | Goldman Sachs | (3.500) |
| (362) | Triton International Ltd | Goldman Sachs | (1.166) | (30) | Ulta Beauty Inc | Morgan Stanley | (2.103) |
| (143) | Triton International Ltd | Morgan Stanley | (347) | 141 | Ultra Clean Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 303 |
| 143 | Triumph Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 369 | 57 | Ultra Clean Holdings Inc | Goldman Sachs | (25) |
| 71 | Triumph Bancorp Inc | Goldman Sachs | 158 | 500 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.014) |
| 128 | Triumph Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (654) | 272 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs | (2.075) |
| 76 | Triumph Group Inc | Goldman Sachs | (388) | 202 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Morgan Stanley | (63) |
| 36 | TrueBlue Inc | Bank of America Merrill Lynch | (52) | 128 | UMB Financial Corp | Goldman Sachs | 288 |
| 246 | TrueCar Inc | Goldman Sachs | 62 | 258 | UMH Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 126 |
| 268 | Truist Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 748 | 2.125 | UMH Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.041 |
| 206 | Truist Financial Corp | Morgan Stanley | 338 | (1.311) | Umpqua Holdings Corp | Goldman Sachs | (1.311) |
| 60 | TTEC Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 213 | 487 | Under Armour Inc 'A' | Morgan Stanley | 307 |
| 56 | TTEC Holdings Inc | Goldman Sachs | 199 | (137) | UniFirst Corp | Bank of America Merrill Lynch | 175 |
| (895) | TTM Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (194) | (254) | UniFirst Corp | Goldman Sachs | 325 |
| (343) | TTM Technologies Inc | Goldman Sachs | (86) | (442) | Union Pacific Corp | Goldman Sachs | (241) |
| 34 | Tucows Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 49 | (321) | Union Pacific Corp | Morgan Stanley | (1.304) |
| 37 | Tucows Inc 'A' | Goldman Sachs | 53 | (772) | Unisys Corp | Goldman Sachs | (31) |
| (462) | Tupperware Brands Corp | Bank of America Merrill Lynch | 92 | 930 | United Airlines Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.019 |
| (253) | Tupperware Brands Corp | Goldman Sachs | 51 | 292 | United Airlines Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.214 |
| 949 | Turning Point Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | (418) | 356 | United Airlines Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.542 |
| 1.360 | Turning Point Brands Inc | Goldman Sachs | (598) | (600) | United Bankshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.464) |
| (174) | Turning Point Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (170) | (1.797) | United Bankshares Inc | Goldman Sachs | (4.385) |
| (174) | Turning Point Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (260) | (1.689) | United Community Banks Inc | Goldman Sachs | (3.158) |
| (2.070) | TuSimple Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 607 | 166 | United Fire Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 232 |
| (2.207) | TuSimple Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 839 | 1.173 | United Fire Group Inc | Goldman Sachs | 1.642 |
| 1.576 | Tutor Perini Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.056 | (126) | United Natural Foods Inc | Bank of America Merrill Lynch | (296) |
| 1.541 | Tutor Perini Corp | Goldman Sachs | 1.032 | (238) | United Natural Foods Inc | Goldman Sachs | (392) |
| (186) | Twilio Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.066) | (186) | United Parcel Service Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 18 |
| (402) | Twist Bioscience Corp | Bank of America Merrill Lynch | (952) | (48) | United Parcel Service Inc 'B' | Morgan Stanley | (249) |
| (231) | Twist Bioscience Corp | Goldman Sachs | (566) | 114 | United Rentals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.007 |
| (1.439) | Two Harbors Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (302) | 39 | United Rentals Inc | Goldman Sachs | 684 |
| (99) | Two Harbors Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (21) | 181 | United Rentals Inc | Morgan Stanley | 3.717 |
| (14) | Tyler Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (137) | 56 | United States Cellular Corp | Bank of America Merrill Lynch | 100 |
| (421) | Tyson Foods Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.436) | 1.101 | United States Cellular Corp | Goldman Sachs | 1.971 |
| (1.194) | Tyson Foods Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.342) | 185 | United States Steel Corp | Bank of America Merrill Lynch | 205 |
| (1.344) | Uber Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (477) | 58 | United States Steel Corp | Goldman Sachs | 64 |
| (1.848) | Uber Technologies Inc | Morgan Stanley | 125 | 224 | United States Steel Corp | Morgan Stanley | 78 |
| (23) | Ubiquiti Inc | Goldman Sachs | (599) | 91 | United Therapeutics Corp | Goldman Sachs | 4.211 |
| 893 | UDR Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 141 | 115 | United Therapeutics Corp | Morgan Stanley | 2.446 |
| 2.343 | UDR Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.613 | 13 | UnitedHealth Group Inc | Goldman Sachs | 170 |
| 2.629 | UDR Inc (REIT) | Morgan Stanley | 424 | 16 | UnitedHealth Group Inc | Morgan Stanley | 163 |
| (29) | UFP Industries Inc | Morgan Stanley | (50) | (166) | Unifi Group Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (126) |
| (160) | UGI Corp | Goldman Sachs | (416) | (2.800) | Unifi Group Inc (REIT) | Goldman Sachs | (2.128) |
| (257) | UGI Corp | Morgan Stanley | (342) | 268 | Unitil Corp | Bank of America Merrill Lynch | 563 |
| (460) | UiPath Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (332) | 384 | Unitil Corp | Goldman Sachs | 806 |
| (868) | UiPath Inc 'A' | Goldman Sachs | (727) | (421) | Unity Software Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.262) |
| (611) | UiPath Inc 'A' | Morgan Stanley | (578) | (245) | Unity Software Inc | Goldman Sachs | (1.012) |
| (44) | Ulta Beauty Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.818) | (1.414) | Unity Software Inc | Morgan Stanley | 138 |
| | | | | (1.356) | Univar Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.634) |
| | | | | (1.665) | Univar Solutions Inc | Morgan Stanley | (3.230) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (4) | Universal Corp | Bank of America Merrill Lynch | (4) | 171 | Vanda Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 50 |
| (641) | Universal Corp | Goldman Sachs | (692) | (158) | Vapotherm Inc | Bank of America Merrill Lynch | 25 |
| (171) | Universal Health Realty Income Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (370) | (37) | Vapotherm Inc | Goldman Sachs | 6 |
| (175) | Universal Health Realty Income Trust (REIT) | Goldman Sachs | (429) | 373 | Varex Imaging Corp | Bank of America Merrill Lynch | 231 |
| (303) | Universal Health Services Inc 'B' | Goldman Sachs | (126) | 352 | Varex Imaging Corp | Goldman Sachs | 139 |
| (197) | Universal Health Services Inc 'B' | Morgan Stanley | (422) | 341 | Varonis Systems Inc | Morgan Stanley | (327) |
| 55 | Universal Insurance Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 11 | (4.237) | Vaxart Inc | Goldman Sachs | (2.330) |
| 160 | Univest Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 147 | (346) | Vaxcyte Inc | Bank of America Merrill Lynch | (346) |
| 367 | Univest Financial Corp | Goldman Sachs | 338 | (607) | Vaxcyte Inc | Goldman Sachs | (607) |
| 500 | Unum Group | Morgan Stanley | 550 | (276) | VBI Vaccines Inc | Goldman Sachs | 35 |
| 872 | Upland Software Inc | Bank of America Merrill Lynch | 96 | 47 | Vector Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (8) |
| 722 | Upland Software Inc | Goldman Sachs | 79 | 868 | Vector Group Ltd | Goldman Sachs | (160) |
| 104 | Upstart Holdings Inc | Goldman Sachs | 53 | 208 | Vectrus Inc | Bank of America Merrill Lynch | (73) |
| 326 | Upstart Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.624 | 434 | Vectrus Inc | Goldman Sachs | (152) |
| (416) | Upwork Inc | Bank of America Merrill Lynch | (815) | 704 | Veeco Instruments Inc | Bank of America Merrill Lynch | (359) |
| (28) | Upwork Inc | Goldman Sachs | (9) | 419 | Veeco Instruments Inc | Goldman Sachs | (214) |
| (6.142) | Uranium Energy Corp | Goldman Sachs | (2.702) | 48 | Veeva Systems Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 279 |
| 118 | Urban Edge Properties (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (25) | 121 | Veeva Systems Inc 'A' | Goldman Sachs | 721 |
| 1.475 | Urban Outfitters Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.196) | 492 | Veeva Systems Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.672 |
| 1.855 | Urban Outfitters Inc | Goldman Sachs | (2.740) | (8.323) | Velodyne Lidar Inc | Goldman Sachs | 440 |
| (104) | UroGen Pharma Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 14 | (463) | Ventas Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (159) |
| 88 | US Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | 357 | (1.194) | Ventas Inc (REIT) | Goldman Sachs | (1.475) |
| 523 | US Bancorp | Goldman Sachs | 1.224 | (311) | Ventas Inc (REIT) | Morgan Stanley | 125 |
| 199 | US Bancorp | Morgan Stanley | 314 | 19 | Vericel Corp | Bank of America Merrill Lynch | (4) |
| 290 | US Foods Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | (234) | 70 | Vericel Corp | Goldman Sachs | (14) |
| 73 | US Physical Therapy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 791 | (218) | Verint Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | 146 |
| 90 | US Physical Therapy Inc | Goldman Sachs | 975 | (325) | Verint Systems Inc | Goldman Sachs | 220 |
| (652) | US Silica Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.337) | 1.036 | Veris Residential Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.119 |
| (954) | US Silica Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.956) | 364 | Veris Residential Inc (REIT) | Goldman Sachs | 393 |
| 19 | USANA Health Sciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | 28 | 34 | VeriSign Inc | Goldman Sachs | 250 |
| (469) | Utz Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | (70) | 72 | VeriSign Inc | Morgan Stanley | 489 |
| (855) | Utz Brands Inc | Goldman Sachs | (128) | 127 | Verisk Analytics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 306 |
| (2.746) | UWM Holdings Corp | Goldman Sachs | (398) | 67 | Verisk Analytics Inc | Goldman Sachs | 313 |
| (103) | Vail Resorts Inc | Goldman Sachs | (1.664) | 86 | Verisk Analytics Inc | Morgan Stanley | 435 |
| (95) | Vail Resorts Inc | Morgan Stanley | (956) | 1.137 | Veritex Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.331 |
| 22 | Valaris Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 42 | 487 | Veritex Holdings Inc | Goldman Sachs | 998 |
| 489 | Valaris Ltd | Goldman Sachs | 2.813 | 3 | Veritiv Corp | Bank of America Merrill Lynch | (9) |
| 1.057 | Valaris Ltd | Morgan Stanley | 3.195 | 39 | Veritiv Corp | Goldman Sachs | (123) |
| (156) | Valero Energy Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.746) | (466) | Veritone Inc | Goldman Sachs | (14) |
| (1.300) | Valley National Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (1.242) | (103) | Verizon Communications Inc | Bank of America Merrill Lynch | 8 |
| (2.109) | Valley National Bancorp | Goldman Sachs | (1.656) | (181) | Verizon Communications Inc | Goldman Sachs | (221) |
| (2.923) | Valley National Bancorp | Morgan Stanley | (892) | (1.088) | Verizon Communications Inc | Morgan Stanley | (1.529) |
| (49) | Valmont Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (698) | 742 | Verra Mobility Corp | Goldman Sachs | 727 |
| (36) | Valmont Industries Inc | Goldman Sachs | (545) | 208 | Vertex Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (12) |
| (183) | Valmont Industries Inc | Morgan Stanley | (1.603) | 802 | Vertex Inc 'A' | Goldman Sachs | (48) |
| (158) | Valvoline Inc | Bank of America Merrill Lynch | (569) | 174 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.192 |
| (81) | Valvoline Inc | Goldman Sachs | (294) | (284) | Vertiv Holdings Co | Bank of America Merrill Lynch | (128) |
| (507) | Valvoline Inc | Morgan Stanley | (1.507) | (348) | Vertiv Holdings Co | Goldman Sachs | (157) |
| | | | | (3.306) | Vertiv Holdings Co | Morgan Stanley | (1.488) |
| | | | | (795) | Verve Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.308) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.150 | VF Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.864 | 135 | Voya Financial Inc | Goldman Sachs | 805 |
| 734 | VF Corp | Morgan Stanley | 2.833 | 1.227 | Voya Financial Inc | Morgan Stanley | 4.098 |
| 1.141 | ViacomCBS Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 4.783 | (9.398) | Vroom Inc | Bank of America Merrill Lynch | 244 |
| 949 | ViacomCBS Inc 'B' | Goldman Sachs | 3.407 | (6.081) | Vroom Inc | Goldman Sachs | 158 |
| 1.094 | ViacomCBS Inc 'B' | Morgan Stanley | 1.300 | (1.255) | Vuzix Corp | Goldman Sachs | (1.813) |
| 67 | Viad Corp | Bank of America Merrill Lynch | 9 | (362) | W R Berkley Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.010) |
| 74 | Viad Corp | Goldman Sachs | (3) | (178) | W R Berkley Corp | Goldman Sachs | (497) |
| 188 | Viasat Inc | Bank of America Merrill Lynch | 534 | (264) | W R Berkley Corp | Morgan Stanley | (681) |
| 3.558 | Viatis Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.909 | (300) | Wabash National Corp | Goldman Sachs | (219) |
| 5.475 | Viatis Inc | Goldman Sachs | 4.887 | 470 | Walgreens Boots Alliance Inc | Bank of America Merrill Lynch | 134 |
| 3.042 | Viatis Inc | Morgan Stanley | 1.387 | 36 | Walker & Dunlop Inc | Bank of America Merrill Lynch | 208 |
| (65) | Viavi Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (32) | 172 | Walker & Dunlop Inc | Goldman Sachs | 994 |
| (2.343) | VICI Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (3.913) | 71 | Walmart Inc | Goldman Sachs | 305 |
| (173) | Vicor Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.868) | 171 | Walmart Inc | Morgan Stanley | 939 |
| (91) | Vicor Corp | Goldman Sachs | (983) | 1.016 | Walt Disney Co | Bank of America Merrill Lynch | 6.080 |
| (792) | Victoria's Secret & Co | Morgan Stanley | 1.299 | 536 | Walt Disney Co | Goldman Sachs | 2.002 |
| 195 | Victory Capital Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 331 | 899 | Walt Disney Co | Morgan Stanley | 2.616 |
| 2.494 | Victory Capital Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 4.227 | (140) | Warner Music Group Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 140 |
| (1.633) | View Inc | Goldman Sachs | (1.035) | (877) | Warner Music Group Corp 'A' | Goldman Sachs | (500) |
| 737 | ViewRay Inc | Bank of America Merrill Lynch | (52) | (713) | Warner Music Group Corp 'A' | Morgan Stanley | (29) |
| 972 | ViewRay Inc | Goldman Sachs | (68) | 257 | Warrior Met Coal Inc | Bank of America Merrill Lynch | 398 |
| (1.027) | Vimeo Inc | Goldman Sachs | 195 | 130 | Warrior Met Coal Inc | Goldman Sachs | 201 |
| (553) | Vir Biotechnology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.218) | (142) | Washington (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (179) |
| (628) | Vir Biotechnology Inc | Goldman Sachs | (2.518) | 519 | Washington Federal Inc | Bank of America Merrill Lynch | 913 |
| (2.962) | Virgin Galactic Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.458) | 82 | Waste Connections Inc | Goldman Sachs | 211 |
| (112) | Virtu Financial Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (5) | (200) | Waste Management Inc | Morgan Stanley | (506) |
| (703) | Virtu Financial Inc 'A' | Morgan Stanley | 183 | 10 | Waters Corp | Bank of America Merrill Lynch | 74 |
| 3 | Virtus Investment Partners Inc | Bank of America Merrill Lynch | 64 | 80 | Waters Corp | Morgan Stanley | 570 |
| 10 | Virtus Investment Partners Inc | Goldman Sachs | 213 | (124) | Waterstone Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | (114) |
| 319 | Visa Inc 'A' | Goldman Sachs | 4.587 | (53) | Waterstone Financial Inc | Goldman Sachs | (49) |
| 681 | Visa Inc 'A' | Morgan Stanley | 3.196 | 91 | Watsco Inc | Morgan Stanley | 418 |
| 957 | Vishay Intertechnology Inc | Bank of America Merrill Lynch | 785 | 113 | Watts Water Technologies Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 84 |
| 717 | Vishay Intertechnology Inc | Goldman Sachs | 588 | 46 | Watts Water Technologies Inc 'A' | Goldman Sachs | 34 |
| 31 | Vista Outdoor Inc | Bank of America Merrill Lynch | (15) | (225) | Wayfair Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.638) |
| 83 | Vista Outdoor Inc | Goldman Sachs | (41) | (871) | Wayfair Inc 'A' | Goldman Sachs | (5.620) |
| (19) | Visteon Corp | Bank of America Merrill Lynch | (118) | 11 | WD-40 Co | Bank of America Merrill Lynch | 20 |
| (45) | Visteon Corp | Goldman Sachs | (279) | 140 | WD-40 Co | Goldman Sachs | 259 |
| 1.802 | Vistra Corp | Morgan Stanley | 775 | (714) | Webster Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.478) |
| 84 | Vital Farms Inc | Goldman Sachs | 49 | (707) | Webster Financial Corp | Goldman Sachs | (1.463) |
| (78) | Vivint Smart Home Inc | Bank of America Merrill Lynch | (38) | (356) | Webster Financial Corp | Morgan Stanley | (566) |
| (2.231) | Volta Inc | Bank of America Merrill Lynch | (379) | (86) | WEC Energy Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (198) |
| (1.408) | Volta Inc | Goldman Sachs | (239) | (180) | WEC Energy Group Inc | Goldman Sachs | (329) |
| (393) | Vontier Corp | Bank of America Merrill Lynch | (67) | (84) | WEC Energy Group Inc | Morgan Stanley | 5 |
| (1.163) | Vontier Corp | Goldman Sachs | (198) | 15 | Weis Markets Inc | Goldman Sachs | (14) |
| (563) | Vontier Corp | Morgan Stanley | 529 | 545 | Wells Fargo & Co | Bank of America Merrill Lynch | 1.801 |
| (312) | Vornado Realty Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (112) | 303 | Wells Fargo & Co | Goldman Sachs | 1.088 |
| (763) | Vornado Realty Trust (REIT) | Goldman Sachs | (275) | 815 | Wells Fargo & Co | Morgan Stanley | 1.234 |
| 145 | Voya Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | 864 | (203) | Welltower Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (284) |
| | | | | (126) | Welltower Inc (REIT) | Goldman Sachs | (50) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|---------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (625) | Welltower Inc (REIT) | Morgan Stanley | (1.043) | 54 | Wingstop Inc | Bank of America | |
| (1.441) | Wendy's Co | Morgan Stanley | (2.695) | | | Merrill Lynch | 78 |
| (101) | Werner Enterprises Inc | Bank of America | | 187 | Wingstop Inc | Goldman Sachs | (289) |
| | | Merrill Lynch | (54) | 2 | Winmark Corp | Goldman Sachs | (19) |
| (163) | Werner Enterprises Inc | Goldman Sachs | (140) | (130) | Winnebago Industries Inc | Bank of America | |
| (15) | WesBanco Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 265 |
| | | Merrill Lynch | (34) | 518 | Wintrust Financial Corp | Bank of America | |
| (98) | WESCO International Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.953 |
| | | Merrill Lynch | (674) | 92 | Wintrust Financial Corp | Goldman Sachs | 347 |
| (288) | WESCO International Inc | Goldman Sachs | (1.616) | 230 | Wintrust Financial Corp | Morgan Stanley | 655 |
| (332) | WESCO International Inc | Morgan Stanley | (2.014) | 729 | WisdomTree Investments Inc | Bank of America | |
| 277 | West Pharmaceutical Services Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 397 |
| | | Merrill Lynch | 4.362 | 269 | Wix.com Ltd | Bank of America | |
| 104 | West Pharmaceutical Services Inc | Morgan Stanley | 1.175 | | | Merrill Lynch | 212 |
| (147) | Westamerica BanCorp | Bank of America | | 148 | Wix.com Ltd | Goldman Sachs | (475) |
| | | Merrill Lynch | (390) | 116 | Wix.com Ltd | Morgan Stanley | (301) |
| (270) | Westamerica BanCorp | Goldman Sachs | (716) | (71) | Wolfspeed Inc | Bank of America | |
| (40) | Western Alliance Bancorp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 7 |
| | | Merrill Lynch | (125) | (240) | Wolfspeed Inc | Morgan Stanley | (1.474) |
| (269) | Western Alliance Bancorp | Goldman Sachs | (1.644) | (77) | Wolverine World Wide Inc | Bank of America | |
| (61) | Western Digital Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (24) |
| | | Merrill Lynch | (210) | (39) | Wolverine World Wide Inc | Goldman Sachs | (7) |
| (480) | Western Digital Corp | Goldman Sachs | (984) | (119) | Woodward Inc | Bank of America | |
| 1.310 | Western Union Co | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (562) |
| | | Merrill Lynch | 1.048 | (384) | Woodward Inc | Morgan Stanley | (1.145) |
| 307 | Western Union Co | Goldman Sachs | 246 | 287 | Workday Inc 'A' | Bank of America | |
| 2.066 | Western Union Co | Morgan Stanley | 971 | | | Merrill Lynch | (5.194) |
| (165) | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Bank of America | | 415 | Workday Inc 'A' | Goldman Sachs | (7.164) |
| | | Merrill Lynch | (1.404) | 212 | Workday Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.239) |
| (206) | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Goldman Sachs | (1.753) | (6.991) | Workhorse Group Inc | Goldman Sachs | (1.398) |
| (308) | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Morgan Stanley | (2.202) | (344) | Workiva Inc | Goldman Sachs | (1.205) |
| (39) | Westlake Corp | Bank of America | | (90) | Workiva Inc | Morgan Stanley | (127) |
| | | Merrill Lynch | (348) | 91 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Bank of America | |
| 232 | Westrock Co | Goldman Sachs | 499 | | | Merrill Lynch | 744 |
| 45 | Westrock Co | Morgan Stanley | 126 | 666 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Goldman Sachs | 5.448 |
| (3.360) | WeWork Inc 'A' | Bank of America | | 349 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.584 |
| | | Merrill Lynch | (1.882) | (232) | Worthington Industries Inc | Bank of America | |
| 71 | WEX Inc | Goldman Sachs | 1.076 | | | Merrill Lynch | (455) |
| 85 | WEX Inc | Morgan Stanley | 693 | (250) | Worthington Industries Inc | Goldman Sachs | (490) |
| (364) | Weyerhaeuser Co (REIT) | Bank of America | | (782) | WP Carey Inc (REIT) | Morgan Stanley | (2.260) |
| | | Merrill Lynch | (550) | (83) | WSFS Financial Corp | Bank of America | |
| (2.700) | Weyerhaeuser Co (REIT) | Goldman Sachs | (4.077) | | | Merrill Lynch | (233) |
| (1.968) | Weyerhaeuser Co (REIT) | Morgan Stanley | (3.016) | (118) | WSFS Financial Corp | Goldman Sachs | (392) |
| (465) | Wheels Up Experience Inc | Bank of America | | 18 | WW Grainger Inc | Goldman Sachs | 172 |
| | | Merrill Lynch | (14) | 67 | WW Grainger Inc | Morgan Stanley | 1.098 |
| (6.752) | Wheels Up Experience Inc | Goldman Sachs | (203) | (305) | WW International Inc | Bank of America | |
| 140 | Whirlpool Corp | Goldman Sachs | 429 | | | Merrill Lynch | 107 |
| 175 | Whirlpool Corp | Morgan Stanley | 1.239 | (593) | WW International Inc | Goldman Sachs | 208 |
| (11) | White Mountains Insurance Group Ltd | Bank of America | | (174) | Wyndham Hotels & Resorts Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (987) | | | Merrill Lynch | (701) |
| (39) | White Mountains Insurance Group Ltd | Morgan Stanley | (2.202) | (296) | Wyndham Hotels & Resorts Inc | Morgan Stanley | (1.548) |
| | | Goldman Sachs | (3.500) | (243) | Wynn Resorts Ltd | Goldman Sachs | (1.573) |
| (243) | Whiting Petroleum Corp | Bank of America | | (768) | Xcel Energy Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (3.608) | | | Merrill Lynch | (95) |
| (304) | Whiting Petroleum Corp | Goldman Sachs | (4.557) | (1.235) | Xcel Energy Inc | Morgan Stanley | (244) |
| (222) | WideOpenWest Inc | Bank of America | | 51 | Xencor Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (122) | | | Merrill Lynch | (22) |
| (441) | WideOpenWest Inc | Goldman Sachs | (243) | 263 | Xencor Inc | Goldman Sachs | (362) |
| 1.104 | Williams Cos Inc | Bank of America | | (865) | Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.522 | | | Merrill Lynch | 259 |
| 282 | Williams Cos Inc | Morgan Stanley | 112 | (637) | Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT) | Goldman Sachs | 191 |
| (138) | Williams-Sonoma Inc | Goldman Sachs | (384) | (75) | Xenon Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| (159) | Williams-Sonoma Inc | Morgan Stanley | (2.949) | | | Merrill Lynch | 194 |
| (51) | Willis Towers Watson Plc | Morgan Stanley | (420) | (51) | Xenon Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 132 |
| (190) | WillScot Mobile Mini Holdings Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 285 |
| | | Merrill Lynch | (331) | (9.485) | XL Fleet Corp | Bank of America | |
| (2.578) | WillScot Mobile Mini Holdings Corp | Goldman Sachs | (4.486) | | | Merrill Lynch | 285 |
| | | | | (8.417) | XL Fleet Corp | Goldman Sachs | 253 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|--------------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (615) | Xometry Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.454) | 267 | Zoetis Inc | Goldman Sachs | 2.049 |
| (19) | XPEL Inc | Bank of America | | 393 | Zoetis Inc | Morgan Stanley | 2.743 |
| | | Merrill Lynch | (66) | (2.334) | Zomedica Corp | Bank of America | |
| (104) | XPEL Inc | Goldman Sachs | (361) | | | Merrill Lynch | (34) |
| 245 | XPO Logistics Inc | Bank of America | | (18.100) | Zomedica Corp | Goldman Sachs | (264) |
| | | Merrill Lynch | 372 | (117) | Zoom Video | Bank of America | |
| 516 | XPO Logistics Inc | Goldman Sachs | 784 | | Communications Inc 'A' | Merrill Lynch | (925) |
| 94 | XPO Logistics Inc | Morgan Stanley | 284 | (76) | Zoom Video | | |
| (965) | XRAY-TWOLF HoldCo Corp | Bank of America | | | Communications Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.274) |
| | | Merrill Lynch | (232) | (35) | Zoom Video | | |
| (4.142) | XRAY-TWOLF HoldCo Corp | Goldman Sachs | (994) | | Communications Inc 'A' | Morgan Stanley | (517) |
| (25) | Xylem Inc | Bank of America | | (449) | ZoomInfo Technologies Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (60) | | | Merrill Lynch | 255 |
| (192) | Xylem Inc | Goldman Sachs | (467) | (425) | ZoomInfo Technologies Inc | Goldman Sachs | (1.186) |
| (76) | Xylem Inc | Morgan Stanley | (223) | (1.615) | ZoomInfo Technologies Inc | Morgan Stanley | (3.477) |
| 284 | Yelp Inc | Bank of America | | 197 | Zscaler Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 114 | | | Merrill Lynch | 3.900 |
| 400 | Yelp Inc | Goldman Sachs | 192 | 162 | Zscaler Inc | Goldman Sachs | 3.055 |
| (101) | YETI Holdings Inc | Bank of America | | 123 | Zscaler Inc | Morgan Stanley | 2.680 |
| | | Merrill Lynch | (485) | 22 | Zumiez Inc | Bank of America | |
| (364) | YETI Holdings Inc | Goldman Sachs | 354 | | | Merrill Lynch | 16 |
| (170) | YETI Holdings Inc | Morgan Stanley | (407) | 1.946 | Zuora Inc 'A' | Goldman Sachs | 58 |
| 332 | Yext Inc | Bank of America | | 168 | Zurn Water Solutions Corp | Goldman Sachs | 303 |
| | | Merrill Lynch | (7) | 134 | Zymeworks Inc | Goldman Sachs | 181 |
| 1.616 | Yext Inc | Goldman Sachs | (32) | (113) | Zynex Inc | Goldman Sachs | (47) |
| 353 | Y-mAbs Therapeutics Inc | Bank of America | | | | | (25.123) |
| | | Merrill Lynch | 840 | | | | |
| 590 | Y-mAbs Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.404 | | | | |
| 42 | York Water Co | Goldman Sachs | 16 | | | | |
| 23 | Yum! Brands Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 42 | | | | |
| 182 | Yum! Brands Inc | Goldman Sachs | 1.003 | | | | |
| 44 | Yum! Brands Inc | Morgan Stanley | 203 | | | | |
| 73 | Zebra Technologies Corp 'A' | Goldman Sachs | 111 | | | | |
| 55 | Zendesk Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (95) | | | | |
| 136 | Zendesk Inc | Goldman Sachs | (68) | | | | |
| 71 | Zendesk Inc | Morgan Stanley | 281 | | | | |
| (52) | Zentalis Pharmaceuticals LLC | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (126) | | | | |
| (183) | Zentalis Pharmaceuticals LLC | Goldman Sachs | (266) | | | | |
| 128 | Ziff Davis Inc | Morgan Stanley | (191) | | | | |
| (480) | Zillow Group Inc 'A' | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (593) | | | | |
| (1.052) | Zillow Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.685) | | | | |
| (856) | Zillow Group Inc 'A' | Morgan Stanley | 124 | | | | |
| (269) | Zillow Group Inc 'C' | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (479) | | | | |
| (753) | Zillow Group Inc 'C' | Goldman Sachs | (120) | | | | |
| (727) | Zillow Group Inc 'C' | Morgan Stanley | 545 | | | | |
| (139) | ZIM Integrated Shipping Services Ltd | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 19 | | | | |
| (141) | ZIM Integrated Shipping Services Ltd | Goldman Sachs | 20 | | | | |
| (123) | ZIM Integrated Shipping Services Ltd | Morgan Stanley | 459 | | | | |
| (56) | Zimmer Biomet Holdings Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (139) | | | | |
| 43 | Zimvie Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (62) | | | | |
| 199 | Zimvie Inc | Goldman Sachs | (287) | | | | |
| 8 | Zions Bancorp NA | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 26 | | | | |
| 354 | Zions Bancorp NA | Goldman Sachs | 1.158 | | | | |
| 837 | Zions Bancorp NA | Morgan Stanley | 1.590 | | | | |
| 198 | ZipRecruiter Inc 'A' | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (116) | | | | |
| 1.083 | ZipRecruiter Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.282) | | | | |
| 347 | Zoetis Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 2.112 | | | | |
| | | | | Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 192.857.189) | | | |
| | | | | (165.546) | | | |
| * Wertpapier unter Vorbehalt einer Anpassung an die beizulegenden Zeitwerte gemäß Anmerkung 2 (a). | | | | | | | |
| ** Beträge mit einem Wert unter EUR 0,5 wurden auf null abgerundet. | | | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|---|---------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| 16 | USD | E-Mini Dow Jones Industrial Average Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 2.626.720 | 32.519 |
| (10) | USD | NASDAQ 100 E-Mini Stock Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 2.510.400 | (8.681) |
| Gesamt | | | | | 23.838 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 41.715.107 | USD | 44.228.562 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 485.741 |
| USD | 2.201.212 | EUR | 2.083.754 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (32.360) |
| | | | | | | 453.381 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 378.068 | USD | 467.782 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 8.169 |
| USD | 89.720 | GBP | 71.682 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (520) |
| | | | | | | 7.649 |
| Auf SEK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| SEK | 745.847 | USD | 75.427 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 543 |
| USD | 5.371 | SEK | 53.414 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (70) |
| | | | | | | 473 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 47.595.474) | | | | | | 461.503 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Staatsanleihen | 93,88 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 0,48 |
| Diversifiziert | 0,46 |
| Energie | 0,01 |
| Finanzen | 0,00 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 94,83 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 5,17 |
| | 100,00 |

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in GBP | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in GBP | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|---------------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| | | | | GBP 2.000.000 | Bank Of America NA 3/8/2022 (Zero Coupon) | 1.995.745 | 0,93 |
| | | | | | | 1.995.745 | 0,93 |
| | | | | Gesamt Einlagezertifikate | | 60.969.389 | 28,50 |
| STAMMAKTIE | | | | KURZFRISTIGE TITEL | | | |
| | Bermuda | | | Australien | | | |
| 51.586 | Hiscox Ltd | 476.552 | 0,22 | GBP 4.000.000 | ING Bank NV 6/6/2022 (Zero Coupon) | 3.999.863 | 1,87 |
| 58.129 | Lancashire Holdings Ltd | 230.307 | 0,11 | | | 3.999.863 | 1,87 |
| | | 706.859 | 0,33 | Belgien | | | |
| | Großbritannien | | | GBP 7.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp 10/8/2022 (Zero Coupon) | 6.982.713 | 3,26 |
| 62.538 | Grainger Plc | 191.742 | 0,09 | | | 6.982.713 | 3,26 |
| 41.341 | J D Wetherspoon Plc | 309.851 | 0,15 | Dänemark | | | |
| 120.485 | JET2 Plc | 1.396.421 | 0,65 | GBP 4.000.000 | Jyske Bank A/S 8/6/2022 (Zero Coupon) | 3.999.310 | 1,87 |
| 135.973 | Moonpig Group Plc | 350.266 | 0,16 | GBP 5.000.000 | Jyske Bank A/S 16/6/2022 (Zero Coupon) | 4.998.080 | 2,33 |
| 178.157 | Taylor Wimpey Plc | 230.891 | 0,11 | | | 8.997.390 | 4,20 |
| | | 2.479.171 | 1,16 | Finnland | | | |
| Gesamt Stammaktien | | 3.186.030 | 1,49 | GBP 9.000.000 | Kuntarahoitus Oyj 11/7/2022 (Zero Coupon) | 8.990.056 | 4,20 |
| | | | | | | 8.990.056 | 4,20 |
| EINLAGENZERTIFIKATE | | | | Frankreich | | | |
| | Belgien | | | GBP 9.000.000 | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 9/6/2022 (Zero Coupon) | 8.998.184 | 4,21 |
| GBP 7.000.000 | Belfius Banque SA 9/6/2022 (Zero Coupon) | 6.998.395 | 3,27 | GBP 6.000.000 | Antalis SA 1/6/2022 (Zero Coupon) | 6.000.000 | 2,80 |
| GBP 7.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp 5/7/2022 (Zero Coupon) | 6.992.134 | 3,27 | GBP 6.000.000 | Antalis SA 1/6/2022 (Zero Coupon) | 5.998.884 | 2,80 |
| | | 13.990.529 | 6,54 | GBP 2.000.000 | Dexia Credit Local SA 6/7/2022 (Zero Coupon) | 1.998.066 | 0,93 |
| | Japan | | | GBP 8.000.000 | LMA SA 7/6/2022 (Zero Coupon) | 7.998.738 | 3,74 |
| GBP 5.000.000 | Mizuho Bank Ltd FRN 17/6/2022 | 5.000.000 | 2,34 | GBP 9.000.000 | Managed and Enhanced Tap Magenta Funding 6/7/2022 (Zero Coupon) | 8.990.763 | 4,20 |
| GBP 3.000.000 | Mizuho Bank Ltd FRN 1/7/2022 | 3.000.000 | 1,40 | GBP 9.000.000 | Managed and Enhanced Tap Magenta Funding ST SA 6/6/2022 (Zero Coupon) | 8.998.707 | 4,21 |
| GBP 4.000.000 | Norinchukin Bank 6/6/2022 (Zero Coupon) | 3.999.203 | 1,87 | | | 48.983.342 | 22,89 |
| GBP 2.000.000 | Norinchukin Bank 9/6/2022 (Zero Coupon) | 1.999.431 | 0,94 | Deutschland | | | |
| GBP 2.000.000 | Norinchukin Bank 24/6/2022 (Zero Coupon) | 1.998.578 | 0,93 | GBP 3.000.000 | Erste Abwicklungsanstalt 5/7/2022 (Zero Coupon) | 2.997.211 | 1,40 |
| GBP 6.000.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 10/8/2022 (Zero Coupon) | 5.985.183 | 2,80 | | | 2.997.211 | 1,40 |
| | | 21.982.395 | 10,28 | Irland | | | |
| | Niederlande | | | GBP 3.000.000 | Matchpoint Finance Plc 9/6/2022 (Zero Coupon) | 2.999.330 | 1,40 |
| GBP 4.000.000 | ABN Amro Bank NV FRN 9/8/2022 | 4.000.436 | 1,87 | GBP 1.000.000 | Matchpoint Finance Plc 13/6/2022 (Zero Coupon) | 999.668 | 0,47 |
| GBP 3.000.000 | ABN Amro Bank NV FRN 10/8/2022 | 3.000.284 | 1,40 | GBP 4.000.000 | Matchpoint Finance Plc 6/7/2022 (Zero Coupon) | 3.996.223 | 1,87 |
| | | 7.000.720 | 3,27 | GBP 4.000.000 | Matchpoint Finance Plc RegS 6/6/2022 (Zero Coupon) | 3.999.458 | 1,87 |
| | Singapur | | | | | 11.994.679 | 5,61 |
| GBP 2.000.000 | Oversea Chinese Banking Corporation FRN 1/7/2022 | 2.000.000 | 0,94 | | | | |
| | | 2.000.000 | 0,94 | | | | |
| | Großbritannien | | | | | | |
| GBP 1.000.000 | Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp FRN 14/6/2022 | 1.000.000 | 0,47 | | | | |
| GBP 3.000.000 | National Australia Bank Ltd FRN 6/6/2022 | 3.000.000 | 1,40 | | | | |
| GBP 7.000.000 | Nationwide Building Society FRN 6/6/2022 | 7.000.000 | 3,27 | | | | |
| GBP 2.000.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd FRN 8/7/2022 | 2.000.000 | 0,93 | | | | |
| GBP 1.000.000 | Svenska Handelsbanken AB FRN 10/6/2022 | 1.000.000 | 0,47 | | | | |
| | | 14.000.000 | 6,54 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in GBP | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|
| Luxemburg | | | |
| GBP 4.000.000 | Albion Capital Corp SA 20/6/2022 (Zero Coupon) | 3.997.857 | 1,87 |
| GBP 4.000.000 | Sunderland Receivables SA 13/6/2022 (Zero Coupon) | 3.998.660 | 1,87 |
| | | 7.996.517 | 3,74 |
| Niederlande | | | |
| GBP 4.000.000 | ING Bank NV 6/6/2022 (Zero Coupon) | 3.991.122 | 1,87 |
| GBP 6.000.000 | PACCAR Financial Europe BV 8/6/2022 (Zero Coupon) | 5.998.850 | 2,80 |
| GBP 3.000.000 | Toyota Motor Finance 25/7/2022 (Zero Coupon) | 2.994.933 | 1,40 |
| GBP 5.000.000 | Toyota Motor Finance 3/8/2022 (Zero Coupon) | 4.989.754 | 2,33 |
| | | 17.974.659 | 8,40 |
| Schweden | | | |
| GBP 4.000.000 | Svenska Handelsbanken AB 9/9/2022 (Zero Coupon) | 3.985.761 | 1,86 |
| | | 3.985.761 | 1,86 |
| Großbritannien | | | |
| GBP 4.000.000 | Svenska Handelsbanken AB 9/9/2022 (Zero Coupon) | 3.995.551 | 1,87 |
| | | 3.995.551 | 1,87 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| GBP 9.000.000 | Nieuw Amsterdam Receivables Corp 10/6/2022 (Zero Coupon) | 8.997.826 | 4,21 |
| GBP 3.000.000 | Sheffield Receivables Co LLC 16/6/2022 (Zero Coupon) | 2.998.744 | 1,40 |
| | | 11.996.570 | 5,61 |
| Gesamt kurzfristige Titel | | 138.894.312 | 64,91 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 203.049.731 | 94,90 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| ANLEIHEN | | | |
| Japan | | | |
| GBP 5.000.000 | Norinchukin Bank 6/7/2022 (Zero Coupon) | 4.995.360 | 2,33 |
| | | 4.995.360 | 2,33 |
| Gesamt Anleihen | | 4.995.360 | 2,33 |
| Gesamt sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | 4.995.360 | 2,33 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Irland | | | |
| 207.945 | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund (Dist) ⁻ | 20.790.954 | 9,72 |
| | | 20.790.954 | 9,72 |
| Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 20.790.954 | 9,72 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 228.836.045 | 106,95 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | | (14.864.667) | (6,95) |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (GBP) | | 213.971.378 | 100,00 |
| - Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 9. | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP |
|-------------------------------------|--|-------------|---|--|--------------------------------|-------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | | | | |
| Belgien | | | | | | | |
| (51.650) | Umicore SA | HSBC | (107.255) | 66.957 | Rio Tinto Plc | JP Morgan | 416.473 |
| | | | (107.255) | (151.993) | Royal Mail Plc | HSBC | 14.018 |
| Frankreich | | | | 5.060.710 | Serco Group Plc | JP Morgan | 1.416.999 |
| (22.389) | Danone SA | HSBC | 19.219 | 474.900 | Shell Plc | JP Morgan | 871.442 |
| | | | 19.219 | 68.767 | Smiths Group Plc | HSBC | 80.114 |
| Schweden | | | | 122.400 | Spectris Plc | HSBC | 215.424 |
| (65.596) | Hennes & Mauritz AB 'B' | HSBC | (46.473) | 1.038.032 | Standard Chartered Plc | JP Morgan | 832.502 |
| | | | (46.473) | 230.342 | Tate & Lyle Plc | HSBC | (41.065) |
| Großbritannien | | | | 2.521.843 | Taylor Wimpey Plc | HSBC | 235.792 |
| 604.966 | 3i Group Plc | JP Morgan | 297.414 | 2.879.898 | Tesco Plc | JP Morgan | (465.626) |
| 99.032 | Anglo American Plc | HSBC | 579.832 | (819) | Thungela Resources Ltd | JP Morgan | (762) |
| 18.199 | Associated British Foods Plc | JP Morgan | 32.030 | (437.748) | TUI AG | BNP Paribas | 200.051 |
| 118.290 | AstraZeneca Plc | JP Morgan | 293.359 | (885.425) | TUI AG | JP Morgan | 194.794 |
| 1.202.100 | Auto Trader Group Plc | HSBC | 312.789 | | | | 9.943.638 |
| 60.000 | AVEVA Group Plc | HSBC | 124.200 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| (224.615) | B&M European Value Retail SA | HSBC | 151.840 | (49.825) | Conagra Brands Inc | HSBC | 153.228 |
| (406.031) | BAE Systems Plc | HSBC | (44.663) | (9.000) | Marriott International Inc 'A' | HSBC | (38.145) |
| 884.194 | Barclays Plc | BNP Paribas | 165.167 | (16.417) | Royal Caribbean Cruises Ltd | HSBC | 40.557 |
| 1.236.878 | Barclays Plc | HSBC | 301.798 | (6.799) | WW Grainger Inc | JP Morgan | (36.023) |
| 261.915 | Better Capital PCC Ltd* | JP Morgan | (22.525) | | | | 119.617 |
| 288.378 | Bodycote Plc | HSBC | 164.375 | Gesamtsumme (zugrunde liegendes | | | |
| 126.160 | BP Plc | BNP Paribas | 25.610 | Brutto-Exposure - GBP 216.911.724) | | | |
| 361.965 | BP Plc | HSBC | 122.525 | 9.928.746 | | | |
| 233.545 | British American Tobacco Plc | JP Morgan | 495.115 | * Wertpapier unter Vorbehalt einer Anpassung an die beizulegenden Zeitwerte gemäß Anmerkung 2 (a). | | | |
| (141.808) | Britvic Plc | JP Morgan | (23.826) | | | | |
| (142.330) | Bunzl Plc | JP Morgan | 267.580 | | | | |
| 84.215 | Burberry Group Plc | HSBC | 161.355 | | | | |
| 132.008 | Capital & Counties Properties Plc (REIT) | JP Morgan | 10.561 | | | | |
| (68.193) | Coca-Cola HBC AG | HSBC | (97.913) | | | | |
| 523.754 | Compass Group Plc | HSBC | 945.851 | | | | |
| (826.523) | ConvaTec Group Plc | HSBC | (63.202) | | | | |
| 138.651 | CRH Plc | JP Morgan | 242.323 | | | | |
| (19.131) | Croda International Plc | JP Morgan | (30.339) | | | | |
| (33.271) | DCC Plc | HSBC | 157.026 | | | | |
| (72.424) | Diageo Plc | JP Morgan | 44.662 | | | | |
| (390.898) | DS Smith Plc | HSBC | 11.336 | | | | |
| (100.255) | Experian Plc | HSBC | (46.653) | | | | |
| (187.150) | GlaxoSmithKline Plc | JP Morgan | 25.577 | | | | |
| 574.773 | Glencore Plc | HSBC | 406.652 | | | | |
| 329.083 | Grainger Plc | HSBC | 96.112 | | | | |
| 3.554.013 | Hays Plc | HSBC | 369.617 | | | | |
| 105.094 | Hiscox Ltd | HSBC | (19.127) | | | | |
| (647.301) | HSBC Holdings Plc | JP Morgan | (248.899) | | | | |
| 61.026 | InterContinental Hotels Group Plc | HSBC | 111.014 | | | | |
| (1.021.217) | International Consolidated Airlines Group SA | HSBC | (3.507) | | | | |
| (2.495) | ITM Power Plc | HSBC | 358 | | | | |
| 58.130 | J D Wetherspoon Plc | HSBC | 25.868 | | | | |
| (2.511.812) | J Sainsbury Plc | JP Morgan | 127.239 | | | | |
| 61.899 | JET2 Plc | HSBC | 53.457 | | | | |
| (172.021) | John Wood Group Plc | HSBC | 15.223 | | | | |
| 123.376 | Lancashire Holdings Ltd | HSBC | (1.481) | | | | |
| (140.127) | Mondi Plc | HSBC | 28.726 | | | | |
| 109.102 | Moonpig Group Plc | HSBC | 58.479 | | | | |
| 34.648 | Next Plc | JP Morgan | 189.871 | | | | |
| 827.777 | Pearson Plc | HSBC | (61.255) | | | | |
| 328.880 | Phoenix Group Holdings Plc | HSBC | 219.034 | | | | |
| 312.300 | Prudential Plc | JP Morgan | 508.553 | | | | |
| 97.836 | Reckitt Benckiser Group Plc | HSBC | (223.066) | | | | |
| 485.024 | RELX Plc | JP Morgan | (121.256) | | | | |
| 1.823.050 | Rentokil Initial Plc | JP Morgan | (161.334) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement GBP | Nicht realisierter Netto(-verlust) GBP |
|-------------------------------------|-----------------|----------------------------------|---------------|---|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (940) | GBP | FTSE 100 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 71.524.600 | (4.279.275) |
| (40) | GBP | FTSE 250 Index Futures June 2022 | Juni 2022 | 1.628.880 | (14.780) |
| Gesamt | | | | | (4.294.055) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP |
|--|----------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 5.365 | GBP | 4.416 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 26 |
| GBP | 25 | CHF | 31 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | — |
| | | | | | | 26 |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 39.047.938 | GBP | 33.453.043 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (212.167) |
| GBP | 3.179.564 | EUR | 3.722.342 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 10.794 |
| | | | | | | (201.373) |
| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 985.624 | JPY | 158.593.673 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 6.983 |
| JPY | 28.330.565.633 | GBP | 176.041.675 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (1.220.965) |
| | | | | | | (1.213.982) |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 51.377 | USD | 63.351 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | 1.056 |
| USD | 11.466.031 | GBP | 9.266.266 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2022 | (158.303) |
| | | | | | | (157.247) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - GBP 221.371.751) | | | | | | (1.572.576) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2022

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 85,42 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 9,72 |
| Zyklische Konsumgüter | 4,64 |
| Staatsanleihen | 4,21 |
| Industrie | 2,80 |
| Kommunikation | 0,16 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 106,95 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | (6,95) |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 602 bis 623 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Anmerkungen zum Jahresabschluss

1. Organisation

BlackRock Strategic Funds (die „Gesellschaft“) ist eine als offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (*Société d'Investissement à Capital Variable*) nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg errichtete Aktiengesellschaft (*Société Anonyme*). Die Gesellschaft wurde von der luxemburgischen Aufsichtsbehörde, der *Commission de Surveillance du Secteur Financier* („CSSF“), als OGAW gemäß den Bestimmungen von Teil I des Gesetzes von 2010 zugelassen und unterliegt deren Aufsicht gemäß diesem Gesetz.

Zu ihrer Verwaltungsgesellschaft hat die Gesellschaft BlackRock (Luxembourg) S.A. bestellt.

Zum 31. Mai 2022 gehörten 30 Fonds (einzeln „ein Fonds“, zusammen „die Fonds“) zur Fondspalette der Gesellschaft. Die Gesellschaft hat die Struktur eines Umbrellafonds und umfasst mehrere Fonds mit getrennter Haftung. Jeder Fonds haftet getrennt von den anderen Fonds, und die Gesellschaft haftet nicht als Ganzes gegenüber Dritten für die Verbindlichkeiten einzelner Fonds. Jeder Fonds setzt sich aus einem getrennten Anlageportfolio zusammen, das gemäß den Anlagezielen jedes Fonds verwaltet und investiert wird. Jeder Fonds bildet ein Sondervermögen und besteht aus getrennten Anteilen, die, wie in Anhang I dargestellt, in Anteilklassen unterteilt sind.

Die Anteilklassen haben gleiche Rechte in der Gesellschaft, zeichnen sich jedoch durch unterschiedliche Eigenschaften und Gebührenstrukturen aus. Nähere Informationen hierzu können Sie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft nachlesen.

Auflegung von Anteilklassen

Anteilklassen, die während des Geschäftsjahres aufgelegt wurden, werden in Anhang I aufgeführt.

Bedeutende Ereignisse des Berichtsjahres

- ▶ Mit Wirkung zum 24. August 2021 wurde der auf EUR lautende BlackRock Total Advantage Fund geschlossen.
- ▶ Am 10. Dezember 2021 wurde ein neuer Prospekt herausgegeben.
- ▶ Am 22. Januar 2022 fusionierten die J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. and J.P. Morgan Bank (Ireland) plc mit der J.P. Morgan AG, die daraufhin ihre Rechtsform in eine Europäische Gesellschaft (*Societas Europaea*) namens J.P. Morgan SE änderte. Die J.P. Morgan SE wird ihre Funktionen als Transfer- und Registerstelle weiterhin kraft Gesetzes über die J.P. Morgan SE - Zweigniederlassung Luxemburg ausüben.
- ▶ Ein neuer Prospekt wurde am 27. Januar 2022 veröffentlicht.
- ▶ Mit Wirkung zum 6. Mai 2022 wurde der auf USD lautende BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund aufgelöst.
- ▶ Mit Wirkung zum 10. Mai 2022 wurde der auf USD lautende BlackRock Style Advantage Screened Fund aufgelöst.
- ▶ Mit Wirkung zum 13. Mai 2022 wurde Davina Saint zum Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft ernannt.

- ▶ Mit Wirkung zum 13. Mai 2022 schied Ursula Marchioni aus dem Verwaltungsrat der Gesellschaft aus.

Russland-Ukraine-Konflikt

Bestimmte Finanzmärkte haben vor allem aufgrund der geopolitischen Spannungen infolge des Einmarsches Russlands in die Ukraine und der Auswirkungen der sich daraus ergebenden Palette an Sanktionen, Vorschriften und anderen Maßnahmen, die den normalen Handel mit russischen Wertpapieren beeinträchtigten, nachgegeben. Der Verwaltungsrat und der Anlageverwalter überwachen weiterhin die Wertentwicklung der Anlagen im Einklang mit den Anlagezielen der Fonds, und die Geschäftstätigkeit der Fonds und die Veröffentlichung der Nettoinventarwerte werden fortgeführt.

2. Zusammenfassung wichtiger Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden

Der vorliegende Abschluss wurde nach Maßgabe der in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätze und der geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen der Luxemburger Behörden zur Erstellung von Abschlüssen Luxemburger OGAW und unter Beachtung der folgenden wichtigen Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden erstellt:

- (a) Bewertung von Anlagen, sonstigen Vermögenswerten und sonstigen Verbindlichkeiten

Die Anlagen, sonstigen Vermögenswerte und sonstigen Verbindlichkeiten der Gesellschaft werden wie folgt bewertet:

- ▶ Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, werden basierend auf dem am Bewertungstag zuletzt verfügbaren Kurs bewertet. Für Wertpapiere, die nach dem Bewertungszeitpunkt an Märkten gehandelt werden, können die zuletzt bekannten Preise zu diesem Zeitpunkt oder einem solchen anderen Zeitpunkt verwendet werden. Werden diese Wertpapiere oder sonstige Vermögenswerte an mehreren Börsen oder geregelten Märkten notiert bzw. gehandelt, steht es dem Verwaltungsrat frei, nach seinem Ermessen einen dieser Börsenplätze oder geregelten Märkte auszuwählen und zur Bewertung heranzuziehen. Abweichungen im Wert der Wertpapiere können beispielsweise auftreten, wenn die zugrunde liegenden Märkte zum Zeitpunkt der Nettoinventarwertberechnung bestimmter Fonds geschlossen sind oder wenn Regierungen Steuern oder Transaktionsgebühren auf Anlagen im Ausland erheben. Für diesen Fall hat der Verwaltungsrat Verfahren zur Bestimmung des Marktwerts eingeführt, um den angemessenen Wert dieser Anlagen zu schätzen. Solche Wertpapiere und Derivate sind mit ihrem durch kompetente Personen (dem Verwaltungsrat) ermittelten wahrscheinlichen Realisationswert zu bewerten. Wegen der mit Unsicherheiten behafteten Bewertung zum Marktwert können diese Schätzwerte erheblich von den Werten, die bei Vorhandensein eines aktiven Marktes für diese Wertpapiere verwendet worden wären, sowie von den Werten abweichen, die möglicherweise letztlich realisierbar gewesen wären;

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

- ▶ Bei nicht notierten Wertpapieren oder Wertpapieren, die weder an einer Börse noch an einem anderen regulierten Markt gehandelt werden (einschließlich Wertpapiere geschlossener Investmentfonds), sowie bei an anderen Märkten notierten oder nicht notierten Wertpapieren, für die kein Bewertungskurs verfügbar ist, oder bei Wertpapieren, deren notierter Kurs nach Meinung des Verwaltungsrats nicht den fairen Marktwert widerspiegelt, wird der Wert vom Verwaltungsrat nach Treu und Glauben basierend auf dem zu erwartenden Veräußerungs- bzw. Kaufpreis bestimmt;
- ▶ wenn mit den vorstehend dargestellten Methoden kein bestimmter Wert feststellbar ist oder wenn der Verwaltungsrat der Auffassung ist, dass eine andere Bewertungsmethode den beizulegenden Zeitwert des betreffenden Wertpapiers oder sonstigen Vermögenswertes für die verfolgten Zwecke besser erfasst, wird für die Bewertung des Wertpapiers oder eines sonstigen Vermögenswertes die Methode angewandt, welche der Verwaltungsrat im eigenen Ermessen bestimmt. Abweichungen beim Wert der Wertpapiere können beispielsweise auftreten, wenn die zugrunde liegenden Märkte zum Zeitpunkt der Berechnung des Nettoinventarwerts (NIW) bestimmter Fonds geschlossen sind. In solchen Fällen kann der Verwaltungsrat bestimmte Grenzen festlegen, bei deren Überschreiten eine Anpassung des Werts dieser Wertpapiere an ihren beizulegenden Zeitwert durch Anwendung einer speziellen Indexanpassung erfolgt. Wenn darüber hinaus Länder Steuern oder Transaktionsgebühren auf ausländische Anlagen erheben, kann der Verwaltungsrat den Nettoinventarwert anpassen, um solche Gebühren entsprechend zu berücksichtigen.
- ▶ zum 31. Mai 2022 wird die angepasste Bewertung bestimmter Wertpapiere und/oder Derivate in folgender Tabelle veröffentlicht:

| Fonds | Währung | Beizulegender Zeitwert | In % des NIW |
|--|---------|------------------------|--------------|
| BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund | USD | (474.466) | (0,07) |
| BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund | USD | 91.982 | 0,29 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | USD | 1.132.112 | 0,32 |
| BlackRock Global Event Driven Fund | USD | 2.095.784 | 0,04 |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund | USD | 43.728 | 0,03 |
| BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund | USD | (12.202) | (0,02) |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | GBP | (22.525) | (0,01) |

- ▶ Für bestimmte Fonds, die ihren Betrieb eingestellt haben und die zum Auflösungsdatum illiquide Wertpapiere gehalten haben, wurde der Marktwert der illiquiden Wertpapiere im Vergleich zum Nettoinventarwert des jeweiligen Fonds zur Verfügung gestellt. Dies führte dazu, dass der Wert der Wertpapiere effektiv auf Null abgeschrieben wurde, was wiederum zu einem Ausweis des Verlusts in der Aufwands- und Ertragsrechnung und in den Veränderungen im Nettofondsvermögen unter der Rubrik „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagevermögen“ in dem Geschäftsjahr führte in dem die

Auflösung erfolgte. Zum 31. Mai 2022 hielten der BlackRock Latin American Opportunities Fund (eingestellt am 8. März 2019) und BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund (eingestellt am 13. Mai 2019) offene illiquide Positionen, die zusammen weniger als 1,00% des Nettoinventarwerts der Fonds zum letzten Bewertungszeitpunkt vor dem Auflösungsdatum des Fonds ausmachten. Wenn die illiquiden Wertpapiere zu einem späteren Zeitpunkt veräußert werden oder ihr Wert realisiert wird, erfolgt die Ausschüttung an die Anteilinhaber entsprechend ihrer anteilmäßigen Beteiligung am Fonds zum Auflösungsdatum.

- ▶ Anlagen in offene Organismen für gemeinsame Anlagen werden auf Grundlage des letzten verfügbaren NIW der Anteile dieser Organismen für gemeinsame Anlagen bewertet;
- ▶ bestimmte Fonds können entscheiden, Anteilsklassen mit unterschiedlichen Bewertungspunkten aufzulegen, die als „Snap“ und „Close“ bezeichnet werden. Der Bewertungspunkt „Snap“ nimmt einen Wert zu einem anderen Zeitpunkt als der Marktschließung, und der Bewertungspunkt „Close“ nimmt den Wert auf Grundlage der Marktschlusskurse. Folglich werden die Nettoinventarwerte und die Wertentwicklung pro Anteil einer solchen Anteilklasse aufgrund der Anwendung unterschiedlicher Bewertungspunkte voraussichtlich voneinander abweichen. Während des zum 31. Mai 2022 endenden Jahres nahmen die auf AUD lautenden Hedged thesaurierenden abgesicherten Anteile der Klasse X des BlackRock Style Advantage Fund einen dualen Bewertungspunkt an. Zum 31. Mai 2022 belaufen sich das Gesamtnettovermögen (TNA) und der Nettoinventarwert je Anteil (NIW je Anteil) der nicht ausschüttenden in AUD abgesicherten Klasse X zum Snap-Bewertungszeitpunkt auf 46.606.215 AUD und 95,14 AUD. Zum Close-Bewertungszeitpunkt betragen das TNA und der NIW je Anteil 46.753.962 AUD und 95,44 AUD. Demzufolge besteht eine Abweichung zwischen den TNAs des Fonds. Das in der Nettovermögensaufstellung ausgewiesene TNA wird berechnet als Summe der TNAs der Fondsklassen unter Verwendung des Snap-TNA für die nicht ausschüttende in AUD abgesicherte Klasse X. Zum 31. Mai 2022 beläuft sich das TNA des Fonds, das unter Verwendung des nicht ausschüttenden in AUD abgesicherten Close-TNA der Klasse X berechnet wird, auf 121.104.097 USD. Die prozentuale Abweichung zwischen dem Snap- und Close-TNA des Fonds beträgt 0,09%;
- ▶ Wertpapierleihe: Gemäß den Anweisungen des Beauftragten für Wertpapierleihgeschäfte werden Wertpapiere an einen Broker geliefert und weiter als Teil des Portfolios behandelt und entsprechend bewertet;
- ▶ liquide Mittel wie Termingelder und Geldmarktinstrumente werden zu ihren fortgeführten Anschaffungskosten bewertet, was ihrem beizulegenden Zeitwert nahekommt;
- ▶ Bargeld und sonstige Vermögenswerte werden zu ihrem Nennwert bewertet;
- ▶ Vermögenswerte, zu denen insbesondere Barverbindlichkeiten gegenüber der Bank, Forderungen aus Zinsen und Dividenden, Forderungen aus verkauften Anlagen und

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

Forderungen aus gezeichneten Fondsanteilen gehören, werden zu ihrem Nennwert bewertet, es sei denn, die Erzielung eines solchen Nennwerts ist unwahrscheinlich;

- Verbindlichkeiten, die insbesondere Verbindlichkeiten aus Zinsen und Dividenden, Verbindlichkeiten aus Ertragsausschüttungen, Verbindlichkeiten aus erworbenem Anlagevermögen und Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Fondsanteilen umfassen, werden zu ihrem Nennwert bewertet.

(b) Realisierte Nettogewinne und -verluste aus Anlagen

Realisierte Nettogewinne und -verluste aus dem Verkauf von Anlagen werden nach der Durchschnittskostenmethode ermittelt.

(c) Erträge/Aufwendungen aus/für Anlagen, Geldkonten und Finanzderivaten

Die erzielten Erträge aus Anlagen werden von der Gesellschaft wie folgt verbucht:

- Zinserträge/Zinsaufwendungen laufen täglich auf und umfassen die lineare Abschreibung von Aufgeldern und die lineare Zuschreibung von Disagios;
- Bankzinsen und Zinserträge aus Festzins- sowie Geldmarkteinlagen werden periodengerecht abgegrenzt;
- Dividendenerträge werden zum Datum der Notierung Ex-Dividende und nach Abzug von Quellensteuern ausgewiesen;
- Erträge aus Wertpapierleihgeschäften werden periodengerecht erfasst;
- Aufwendungen für Negativrenditen auf Finanzvermögenswerte im Zusammenhang mit Zinsen aus einem negativen Zinssatz auf gehaltene Vermögenswerte werden täglich zugeschrieben und über die Laufzeit des zugrunde liegenden Instruments in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens ausgewiesen;
- Wird bei einer Anleihe ein Zahlungsausfall festgestellt, wird die Zinsabgrenzung auf das ausgefallene Wertpapier eingestellt. Bei Bestätigung des Zahlungsausfalls seitens einschlägiger Stellen wird der Forderungsbetrag abgeschrieben;
- der Zinssatz ewiger Anleihen im Portfolio der Anlagen, offenbart unter der Beschreibung, ist der Zinssatz, anwendbar zum Ende des Zeitraums und dient nur zur Information, weil diese Anleihen variable Zinssätze besitzen.

(d) Derivative Finanzinstrumente

Im Laufe des Berichtsjahres haben die Fonds eine Reihe von Devisentermingeschäften und Terminkontrakten abgeschlossen. Offene Devisentermingeschäfte und Futures-Kontrakte werden zum fairen Marktwert ihrer Glattstellung am Bewertungstag bewertet. Überschüsse/Fehlbeträge aus

diesen sowie aus noch nicht abgerechneten Kontrakten werden den nicht realisierten Gewinnen/Verlusten zugerechnet und unter „Vermögenswerte“ bzw. „Verbindlichkeiten“ in der Zusammensetzung des Nettofondsvermögens aufgeführt. Die Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses (oder -verlusts) und die realisierten Nettogewinne oder -verluste aus der Ausführung oder dem Abschluss von Devisentermingeschäften und Terminkontrakten werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen ausgewiesen.

Die Fonds können gedeckte Kauf- und Verkaufsoptionen oder Swaptionen verkaufen sowie Kauf- und Verkaufsoptionen oder Swaptionen kaufen. Bei Verkauf und/oder Kauf einer Option oder Swaption durch den Fonds wird ein Betrag in Höhe der von den Fonds erhaltenen oder gezahlten Prämie als Vermögenswert oder Verbindlichkeit ausgewiesen. Die Verbindlichkeit einer verkauften Option oder Swaption und der Vermögenswert einer gekauften Option oder Swaption werden nachfolgend mit dem aktuellen Marktpreis angesetzt, der den Zeitwert der Option oder Swaption widerspiegelt. Bei Verkauf oder Kauf eines Wertpapiers durch Ausüben einer Option oder Swaption wird die erhaltene (oder gezahlte) Prämie vom Basispreis des verkauften oder gekauften Wertpapiers abgezogen (oder zum Basispreis addiert). Bei Verfall einer Option oder Swaption (oder wenn Fonds ein Glattstellungsgeschäft abschließen) realisieren die Fonds einen Gewinn oder Verlust aus der Option oder Swaption in Höhe der erhaltenen oder gezahlten Prämie (oder einen Gewinn oder Verlust in der Höhe, in der die Kosten für die Glattstellungsgeschäfte die gezahlte oder erhaltene Prämie übersteigen). Bei Optionen auf Terminkontrakte zahlen die Fonds keine Prämie im Voraus. Die Fonds hinterlegen Marginzahlungen wie bei einem Futures-Kontrakt, und die Optionsprämie wird täglich zum Marktpreis bewertet. Die zum Marktwert gekauften Optionen/Swap-Optionen und die zum Marktwert verkauften Optionen/Swap-Optionen sind in den Vermögenswerten oder Verbindlichkeiten (je nachdem, was zutrifft) in der Aufstellung des Netto-Fondsvermögens enthalten. Die Nettoveränderung des nicht realisierten Netto-Wertzuwachses oder -verlusts und der bei Ablauf oder bei Glattstellungstransaktionen von Optionen oder Swaptions realisierten Gewinne oder Verluste sind in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen im Netto-Fondsvermögen ausgewiesen.

Die Fonds sind im Laufe des Jahres Differenzkontrakte (CFDs) eingegangen. Differenzkontrakte ermöglichen es den Anlegern, synthetische Long- bzw. Short-Positionen mit einer variablen Sicherheitsleistung einzunehmen. Im Unterschied zu Aktien haftet der Käufer im Falle von Differenzkontrakten möglicherweise für einen erheblich höheren Betrag als den als Sicherheitsleistung gezahlten Betrag.

CFD-Positionen werden vorbehaltlich einer täglichen Finanzierungsgebühr eingegangen, die zu einem im Vorfeld vereinbarten Zinssatz oberhalb oder unterhalb des geltenden Referenzwerts berechnet wird. Die damit verbundenen Zinserträge oder -aufwendungen sammeln sich täglich an und werden als Differenzkontrakte in einer Nettoposition in

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

der „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen“ ausgewiesen. Hieraus resultierende Zinserträge oder -aufwendungen werden in einer Nettoposition als „Zins- und Dividendenforderungen“ bzw. als „Zins- und Dividendenverbindlichkeiten“ in der Aufstellung des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen.

CFDs-Positionen unterliegen Dividendenquittungen oder -zahlungen, wenn eine Position an dem Tag, an dem eine Dividende erklärt wurde, gehalten wird. Hieraus resultierende Zinserträge oder -aufwendungen laufen zum Datum der Notierung der Ex-Dividende auf und werden nach Abzug von Quellensteuern als CFD-Dividenden abzüglich Quellensteuer in der Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen im Netto-Fondsvermögen ausgewiesen. Hieraus resultierende Einkommenserträge oder -aufwendungen werden in einer Nettoposition als „Zins- und Dividendenforderungen“ bzw. als „Zins- und Dividendenverbindlichkeiten“ in der Aufstellung des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen.

Der beizulegende Marktwert von Differenzkontrakten wird anhand des Handelspreises an der Börse ermittelt, an der die zugrunde liegenden Wertpapiere oder sonstigen Vermögenswerte gehandelt werden oder zum Handel zugelassen sind. Für zugrunde liegende Wertpapiere, die an erst nach dem Bewertungszeitpunkt schließenden Börsen gehandelt werden, werden die zu diesem oder einem anderen Zeitpunkt zuletzt bekannten Preise zu Bewertungszwecken herangezogen.

Die nicht realisierte Nettoaufwertung und die nicht realisierte Nettoabwertung für Differenzkontrakte sind in Vermögenswerten oder Verbindlichkeiten (je nachdem, was zutrifft) in der Aufstellung des Nettofondsvermögens enthalten.

Eine etwaige Änderung des Marktwertes wird als nicht realisierter Nettowertzuwachs oder -verlust in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen. Realisierte Nettogewinne oder Verluste bei Zurücksetzung oder Kündigung von Differenzkontrakten werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens ausgewiesen.

Realisierte Nettogewinne und -verluste aus dem Verkauf von CFDs wurden auf der Kostenbasis nach der „First In First Out“-Kostenmethode („FIFO“) ermittelt.

Die offenen CFD-Transaktionen der Fonds zum 31. Mai 2022 werden unter den Posten „Forderungen aus verkauftem Anlagevermögen“ und „Verbindlichkeiten aus erworbenem Anlagevermögen“ in der Aufstellung des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen. CFDs werden in der Vermögensaufstellung gesondert aufgeführt.

Die Fonds können Swap-Transaktionen („Swaps“) eingehen, in denen die Fonds und ein Kontrahent vereinbaren, regelmäßige Nettozahlungen zu tauschen, die sich auf einen bestimmten Nominalbetrag beziehen. Swap-Transaktionen

werden am OTC-Markt privat ausgehandelt und können als bilateraler Vertrag („OTC-Swaps“) oder zentral abgewickelt („zentral abgewickelte Swaps“) eingegangen werden. Diese regelmäßig getätigten oder erhaltenen Zahlungen werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens als Nettogewinne bzw. -verluste aufgeführt. Swaps werden auf Basis von Notierungen bewertet, die täglich beim Preisberechnungs-Service der Fonds, zentralen Clearing-Stellen oder Börsenmaklern eingehen und mittels täglicher Swap-Kurven und -Modellen hergeleitet werden, in die zahlreiche Marktfaktoren wie abgezinsten Cashflows, Handelsgeschäfte und Werte der zugrunde liegenden Referenzinstrumente einfließen. Bei einem zentral abgewickelten Swap erfolgt unmittelbar nach der Ausführung der Swap-Vereinbarung eine Novation der Swap-Vereinbarung auf eine zentrale Clearing-Stelle und der Fonds interagiert über einen Broker mit dem Clearing-Kontrahenten. Beim Eingehen eines zentral abgewickelten Swaps muss der Fonds beim Börsenmakler eine Sicherheitsmarge in Form von Barmitteln oder bestimmten anrechnungsfähigen Wertpapieren hinterlegen. Der Betrag variiert je nach Größe und Risikoprofil des entsprechenden Swaps. Etwaige bei Eingehen eines Swapvertrags getätigte oder erhaltene Vorauszahlungen werden als Teil der im Rahmen des Swaps realisierten Nettogewinne oder -verluste behandelt. Die tägliche Neubewertung zentral abgewickelter Swaps wird in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten als Forderung oder Verbindlichkeit für die Variation Margin (Nachschussmarge) in der Cash-at-Bank-Position oder in der Cash-owned-to-Bank-Position der Zusammenfassung des Nettofondsvermögens erfasst, bis der zentral abgewickelte Swap beendet und damit ein realisierter Nettogewinn oder -verlust erfasst wird. Die Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses oder -verlusts auf Swap-Transaktionen ist in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen. Hieraus resultierende Zinsforderungen oder -aufwendungen auf Swaps werden in einer Nettoposition als erwirtschaftete Zinsen oder Dividenden oder zahlbare Zinsen und Dividenden in der Zusammenfassung des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen. Die offenen Swap-Transaktionen der Fonds zum 31. Mai 2022 sind in den Posten „Forderungen aus verkauftem Anlagevermögen“ und „Verbindlichkeiten aus erworbenem Anlagevermögen“ in der Aufstellung des Nettofondsvermögens enthalten. Swaps werden in der Vermögensaufstellung gesondert aufgeführt.

Realisierte Nettogewinne und -verluste aus dem Verkauf von Swaps wurden auf der Kostenbasis nach der „First In First Out“-Kostenmethode („FIFO“) ermittelt.

Fonds können Wertpapierkontrakte der Kategorie „To Be Announced“ („TBA“ – hierbei werden die endgültigen Emissionsmodalitäten noch bekannt gegeben) erwerben. Hierbei handelt es sich um ein handelsübliches Verfahren am Markt für hypothekenbesicherte Wertpapiere, bei dem ein Kontrakt gekauft wird, der dem Käufer Anspruch auf ein Wertpapier aus einem Hypotheken-Pool zu einem festgelegten Preis und einem zuvor festgelegten späteren Zeitpunkt verleiht.

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

Zum Zeitpunkt des Erwerbs sind die wesentlichen Merkmale, nicht jedoch das zu erwerbende Wertpapier bekannt. Während der Preis zum Zeitpunkt des Erwerbs feststeht, ist der Nennwert des Wertpapiers nicht bekannt. Da ein TBA nicht zum Zeitpunkt des Erwerbs abgewickelt wird, kann dies gehebelte Positionen in einem Fonds mit sich bringen. Mit dem Kauf eines TBA ist ein Verlustrisiko verbunden, sofern der Wert des zu erwerbenden Wertpapiers vor dem Abwicklungstermin fällt. Risiken im Zusammenhang mit diesen Kontrakten ergeben sich auch aus der Möglichkeit, dass die Kontrahenten die vertraglichen Bedingungen des Kontrakts nicht erfüllen können. TBAs werden am Ende der Vermögensaufstellung gesondert aufgeführt.

Die Fonds können eine Verpflichtung vor deren Erfüllung verkaufen, falls dies für angebracht erachtet wird. Erlöse aus dem Verkauf von TBA-Wertpapieren werden erst zum vertraglich vereinbarten Abwicklungstermin vereinnahmt. Solange eine TBA-Verkaufsposition noch nicht geschlossen ist, wird eine solche Transaktion durch vergleichbare lieferbare Wertpapiere oder eine kompensierende TBA-Kaufposition gedeckt (die an oder vor dem Abwicklungstermin zur Belieferung ansteht).

Wird eine TBA-Verkaufsposition durch den Erwerb einer kompensatorischen Kaufposition geschlossen, so hat der Fonds einen Gewinn oder Verlust hieraus realisiert ungeachtet eines möglichen nicht realisierten Gewinns oder Verlusts aus dem zugrunde liegenden Wertpapier. Liefert der Fonds im Rahmen einer solchen Verpflichtung Wertpapiere, so realisiert der Fonds einen Gewinn oder Verlust aus dem Verkauf der Wertpapiere basierend auf dem zum Zeitpunkt des Abschlusses einer solchen Verpflichtung festgesetzten Stückpreis.

Die offenen TBA-Transaktionen der Fonds zum 31. Mai 2022 sind in den Posten „Forderungen aus verkauftem Anlagevermögen“ und „Verbindlichkeiten aus erworbenem Anlagevermögen“ in der Aufstellung des Nettofondsvermögens enthalten.

Die Marktwerte der TBAs sind in der Aufstellung des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen. Die Nettoveränderung des nicht realisierten Nettowertzuwachses oder -verlusts und der beim Verkauf der TBAs realisierten Gewinne oder Verluste sind in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen.

Realisierte Nettogewinne und -verluste aus dem Verkauf von TBA wurden auf der Kostenbasis nach der „First In First Out“-Kostenmethode („FIFO“) ermittelt.

(e) Fremdwährungen

Die Kosten für den Erwerb von Anlagen, die auf eine andere Währung als die Währung des jeweiligen Fonds lauten, wurden zu dem zum Erwerbszeitpunkt geltenden Wechselkurs umgerechnet. Anlagen und sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf andere Währungen als die Nennwährung des jeweiligen Fonds lauten, wurden zu dem am Bewertungszeitpunkt geltenden Wechselkurs am 31. Mai 2022

in Luxemburg umgerechnet. Die Netto-Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses oder Wertverlusts sowie die realisierten Gewinne oder Verluste aus dem Abgang oder der Abrechnung anderer Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten in Währungen, auf die der jeweilige Fonds nicht lautet, sind in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen ausgewiesen.

Erträge und Aufwendungen, die auf eine andere Währung als die Nennwährung des jeweiligen Fonds lauten, wurden zu dem zum Transaktionstag geltenden Wechselkurs umgerechnet.

Unterschiedliche Wechselkurse ergeben sich aus der Preismatrix und unterschiedlichen Bewertungspunkten zwischen den verschiedenen Portfolios. In der nachstehenden Tabelle werden die Wechselkurse von 17:00 Uhr MEZ am 31. Mai 2022 für den BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund und die Wechselkurse von 16:00 Uhr MEZ am 31. Mai 2022 für alle anderen Fonds dargestellt.

Anlagen und sonstige Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten aller Fonds, die auf andere Währungen als die Nennwährung des jeweiligen Fonds am jeweiligen Bewertungszeitpunkt des Fonds lauten, wurden zum 31. Mai 2022 mit folgenden Wechselkursen umgerechnet:

| WÄHRUNG | Alle Fonds (außer der BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund) | | BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund und BlackRock UK Equity Absolute Return Fund |
|---------|--|--------|---|--|
| | EUR | USD | EUR | GBP |
| AED | 0,2541 | 0,2723 | 0,2541 | 0,2163 |
| ARS | 0,0045 | 0,0048 | 0,0045 | 0,0038 |
| AUD | 0,6701 | 0,7178 | 0,6696 | 0,5702 |
| BRL | 0,1985 | 0,2126 | 0,1970 | 0,1689 |
| CAD | 0,7383 | 0,7909 | 0,7380 | 0,6283 |
| CHF | 0,9729 | 1,0422 | 0,9739 | 0,8279 |
| CLP | 0,0011 | 0,0012 | 0,0011 | 0,0010 |
| CNH | 0,1399 | 0,1498 | 0,1398 | 0,1190 |
| CNY | 0,1399 | 0,1498 | 0,1398 | 0,1190 |
| COP | 0,0002 | 0,0003 | 0,0002 | 0,0002 |
| CZK | 0,0405 | 0,0433 | 0,0404 | 0,0344 |
| DKK | 0,1344 | 0,1440 | 0,1344 | 0,1144 |
| EGP | 0,0502 | 0,0538 | 0,0502 | 0,0427 |
| EUR | 1,0000 | 1,0712 | 1,0000 | 0,8509 |
| GBP | 1,1752 | 1,2589 | 1,1765 | 1,0000 |
| GHS | 0,1199 | 0,1285 | 0,1199 | 0,1020 |
| HKD | 0,1190 | 0,1274 | 0,1190 | 0,1012 |
| HUF | 0,0025 | 0,0027 | 0,0025 | 0,0022 |
| IDR | 0,0001 | 0,0001 | 0,0001 | 0,0001 |
| ILS | 0,2798 | 0,2998 | 0,2803 | 0,2381 |
| INR | 0,0120 | 0,0129 | 0,0120 | 0,0102 |
| JPY | 0,0072 | 0,0078 | 0,0073 | 0,0062 |
| KRW | 0,0008 | 0,0008 | 0,0008 | 0,0006 |
| KZT | 0,0022 | 0,0024 | 0,0022 | 0,0019 |
| LKR | 0,0026 | 0,0028 | 0,0026 | 0,0022 |
| MXN | 0,0476 | 0,0510 | 0,0474 | 0,0405 |
| MYR | 0,2132 | 0,2284 | 0,2132 | 0,1814 |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| | Alle Fonds (außer der BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund) | BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund und BlackRock UK Equity Absolute Return Fund |
|---------|--|---|--|
| WÄHRUNG | EUR | USD | EUR |
| NGN | 0,0019 | 0,0021 | 0,0019 |
| NOK | 0,0991 | 0,1061 | 0,0993 |
| NZD | 0,6075 | 0,6508 | 0,6077 |
| PEN | 0,2539 | 0,2719 | 0,2533 |
| PHP | 0,0178 | 0,0191 | 0,0178 |
| PLN | 0,2188 | 0,2343 | 0,2183 |
| RON | 0,2024 | 0,2168 | 0,2022 |
| RUB | 0,0149 | 0,0159 | 0,0148 |
| SAR | 0,2489 | 0,2666 | 0,2489 |
| SEK | 0,0950 | 0,1018 | 0,0954 |
| SGD | 0,6809 | 0,7294 | 0,6809 |
| THB | 0,0273 | 0,0292 | 0,0273 |
| TRY | 0,0570 | 0,0610 | 0,0570 |
| TWD | 0,0322 | 0,0345 | 0,0322 |
| UAH | 0,0317 | 0,0339 | 0,0317 |
| USD | 0,9335 | 1,0000 | 0,9335 |
| UYU | 0,0233 | 0,0250 | 0,0234 |
| ZAR | 0,0598 | 0,0640 | 0,0599 |
| ZMW | 0,0540 | 0,0579 | 0,0540 |

(f) Konsolidierter Jahresabschluss

Die Konten der einzelnen Fonds werden in der Basiswährung der Fonds angegeben. Die konsolidierten Zahlen der Gesellschaft werden in USD ausgewiesen und beinhalten – ggf. umgerechnet – den Gesamtabschluss der verschiedenen Fonds. Für die Umrechnung des Netto-Fondsvermögens aller auf EUR lautender Teilfonds bis auf den BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund wurde der zum Bewertungszeitpunkt aller Fonds am 31. Mai 2022 in Luxemburg geltende Wechselkurs herangezogen:

| | EUR |
|-----|--------|
| USD | 0,9335 |

Für den BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund wurde der zum Bewertungszeitpunkt des Fonds am 31. Mai 2022 in Luxemburg geltende Wechselkurs herangezogen:

| | EUR |
|-----|--------|
| USD | 0,9335 |

Für den BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund und BlackRock UK Equity Absolute Return Fund wurde der zum Bewertungszeitpunkt des Fonds am 31. Mai 2022 in Luxemburg geltende Wechselkurs verwendet:

| | GBP |
|-----|--------|
| USD | 0,7943 |

Für die Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen gilt für die Umrechnung der folgende

durchschnittliche Wechselkurs, der über das Jahr für alle auf Euro lautenden Fonds mit Ausnahme des BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund berechnet wurde:

| | EUR |
|-----|--------|
| USD | 0,8777 |

Für den BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund wird der folgende durchschnittliche über das Jahr berechnete Wechselkurs verwendet:

| | EUR |
|-----|--------|
| USD | 0,8785 |

Für den BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund und den BlackRock UK Equity Absolute Return Fund werden der folgende durchschnittliche über das Jahr berechnete Wechselkurs verwendet:

| | GBP |
|-----|--------|
| USD | 0,7434 |

Die Berechnung der konsolidierten Angaben in der „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Nettofondsvermögen“ erfolgte unter Verwendung der durchschnittlichen Wechselkurse im Laufe des Jahres. Die daraus resultierende Wechselkursberichtigung von (1.916.568.943) USD berücksichtigt die Wechselkursschwankungen zwischen dem 1. Juni 2021 und dem 31. Mai 2022. Hierbei handelt es sich um einen fiktiven Betrag, der keinerlei Auswirkungen auf den Nettoinventarwert der einzelnen Fonds hat.

(g) Ertragsausgleich

Die Gesellschaft nimmt Maßnahmen zum Ertragsausgleich vor, um sicherzustellen, dass die Höhe des innerhalb eines Fonds aufgelaufenen und jeder Aktie zuzuordnenden Nettoertrags nicht durch Ausgabe, Umwandlung oder Rücknahme von Fondsanteilen im Verlauf des Jahres beeinträchtigt wird.

Der Ertragsausgleich wird in den Veränderungen des Anteilskapitals in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens berücksichtigt.

(h) Verwässerung

Der Verwaltungsrat kann den Nettoinventarwert („NIW“) je Anteil eines Fonds anpassen, um die Folgen einer „Verwässerung“ bei diesem Fonds zu mindern. Eine Verwässerung tritt ein, wenn die effektiven Kosten des Erwerbs oder der Veräußerung zugrunde liegender Vermögenswerte eines Fonds aufgrund von Faktoren wie Handels- und Maklergebühren, Steuern und Abgaben, Marktbewegungen und einer etwaigen Spanne zwischen An- und Verkaufskursen der zugrunde liegenden Vermögenswerte von dem für diese Vermögenswerte in der Bewertung des Fonds angesetzten Wert abweichen. Eine Verwässerung kann den Wert des Fonds beeinträchtigen und daher Auswirkungen

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

auf alle Anteilinhaber haben. Durch die Anpassung des Nettoinventarwerts pro Anteil kann dieser Verwässerungseffekt reduziert oder vermieden und bestehende Anteilinhaber vor den negativen Einflüssen einer Verwässerung geschützt werden. Der Verwaltungsrat kann eine Anpassung des NIW eines Fonds vornehmen, wenn an einem Handelstag der Wert der gesamten Transaktionen mit Anteilen aller Anteilklassen dieses Fonds zu einem Nettoanstieg bzw. einem Nettorückgang führt, der einen oder mehrere vom Verwaltungsrat für den Fonds festgesetzte Grenzwerte überschreitet. Der Betrag, um den der NIW eines Fonds an einem Handelstag angepasst werden kann, hängt von den voraussichtlichen Kosten der für den Fonds getätigten Marktabschlüsse ab. Unter diesen Umständen kann der NIW des jeweiligen Fonds um einen Betrag angepasst werden, der 1,50 % oder, im Falle von Rentenfonds, 3 % des jeweiligen NIWs nicht übersteigt. In Ausnahmefällen kann der Verwaltungsrat im Interesse der Anteilinhaber beschließen, den oben angegebenen maximalen Swing-Faktor vorübergehend zu erhöhen und die Anleger darüber zu informieren. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettoveränderung zu einem Anstieg des Werts aller Anteile des Fonds führt, und zu einer Verminderung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettoveränderung zu einem Rückgang des Werts der Anteile führt.

Da an einigen Börsen sowie in bestimmten Jurisdiktionen beim Kauf und Verkauf unterschiedliche Gebühren anfallen können, insbesondere in Bezug auf Steuern und Abgaben, können die hieraus resultierenden Anpassungen für die Nettozuflüsse von denen der Nettoabflüsse abweichen. Darüber hinaus kann der Verwaltungsrat beschließen, außerordentliche Steueraufwendungen in den Betrag der Anpassung mit einzubeziehen. Diese außerordentlichen Steueraufwendungen fallen auf jedem Markt in unterschiedlicher Höhe an und werden derzeit voraussichtlich 2,5 % des NIW nicht übersteigen. Legt ein Fonds überwiegend in bestimmten Anlageklassen wie Staatsanleihen oder Geldmarktinstrumenten an, kann der Verwaltungsrat entscheiden, dass eine solche Anpassung nicht angemessen ist. In Übereinstimmung mit dem Prospekt wurde eine derartige Verwässerungsanpassung zum 31. Mai 2022 beim BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund, BlackRock Global Equity Absolute Return Fund und BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund vorgenommen.

Während des Berichtszeitraums vom 1. Juni 2021 bis zum 31. Mai 2022 wurden für alle Fonds Verwässerungsanpassungen vorgenommen, mit Ausnahme des BlackRock Managed Index Portfolios – Growth und BlackRock Total Advantage Fund.

Der veröffentlichte/für Anteilsgeschäfte maßgebliche Nettoinventarwert je Anteil wird in der Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre ausgewiesen und kann gegebenenfalls eine Verwässerungsanpassung beinhalten. Diese Anpassung wird in der Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens bzw. der Aufwands- und

Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen nicht ausgewiesen.

(i) Transaktionskosten

Transaktionskosten sind zusätzliche, direkt dem Erwerb, der Ausgabe oder Veräußerung von Wertpapieren oder Derivaten zurechenbare Kosten. Zusätzliche Kosten sind Kosten, die nicht angefallen wären, wenn eine Gesellschaft das Wertpapier nicht erworben, ausgegeben oder verkauft hätte. Beim Erstausweis wird ein Wertpapier mit seinem Marktwert zuzüglich der direkt dem Kauf oder der Ausgabe des Wertpapiers zurechenbaren Transaktionskosten angesetzt.

Die Transaktionskosten ohne Verwahrstellengebühren für Kauf oder Verkauf von Wertpapieren werden unter dem Posten realisierte Nettogewinne/(-verluste) bzw. Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses (oder -verlusts) in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens jedes Fonds berücksichtigt. Transaktionsgebühren der Verwahrstelle werden in den Verwahrstellengebühren der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens angegeben. Weitere Informationen finden Sie unter Anmerkung 6.

(j) Devisen aus anderen Transaktionen

Devisen aus anderen Transaktionen beziehen sich auf realisierte und nicht realisierte Wertzuwächse oder -verluste aus Bankguthaben und Kontrakten am Kassamarkt und werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Nettofondsvermögen ausgewiesen.

3. Verwaltungsgesellschaft

Die Gesellschaft hat BlackRock (Luxembourg) S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“) zu ihrer Verwaltungsgesellschaft bestellt. Gemäß Kapitel 15 des Gesetzes von 2010 ist die Verwaltungsgesellschaft ermächtigt, als Fondsverwaltungsgesellschaft zu fungieren.

Die Gesellschaft hat mit der Verwaltungsgesellschaft eine Verwaltungsvereinbarung unterzeichnet. Gemäß dieser Vereinbarung wurde der Verwaltungsgesellschaft das Tagesgeschäft der Gesellschaft übertragen, d.h. sie zeichnet direkt oder durch Übertragung der Aufgabe auf Dritte verantwortlich für sämtliche betriebliche Abläufe im Zusammenhang mit der Anlageverwaltung und der allgemeinen Verwaltung der Gesellschaft und dem Vertrieb der Fonds.

In Übereinstimmung mit der Gesellschaft hat die Verwaltungsgesellschaft beschlossen, bestimmte Aufgaben – wie im Prospekt beschrieben – an Dritte zu übertragen.

Die Verwaltungsgesellschaft ist eine hundertprozentige Tochtergesellschaft der BlackRock-Gruppe. Sie untersteht der Aufsicht durch die CSSF.

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

4. Verwaltungs- und Vertriebsgebühren

Im Verlauf des Berichtsjahres zahlte die Gesellschaft Managementgebühren an die Verwaltungsgesellschaft.

Die Gesellschaft zahlt eine jährliche Verwaltungsgebühr, wie in Anhang F des Prospekts aufgeführt. Die Verwaltungsgebühr beträgt zwischen 0,37 % und 1,80 % des NIW pro Jahr. Eine Ausnahme bilden die Anteile der Klasse X, bei denen keine Verwaltungsgebühr, sondern im Rahmen einer Vereinbarung Gebühren an die Anlageberater oder deren verbundene Unternehmen gezahlt werden. Die Höhe der Managementgebühren schwankt abhängig von Fonds und Anteilklasse, die der Anleger erwirbt. Diese Managementgebühren fallen täglich an, basierend auf dem NAV des jeweiligen Fonds, und werden monatlich gezahlt. Durch diese Verwaltungsgebühr werden bestimmte Kosten und Gebühren beglichen, u. a. auch die Gebühren für die Anlageberater.

Legt ein Fonds einen wesentlichen Teil seines Nettovermögens in anderen OGAW und anderen Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA“) an, stellt der Anlageberater sicher, dass die gesamten Managementgebühren (ohne Performancegebühren, sofern zutreffend), die dem jeweiligen Fonds in Rechnung gestellt werden (einschließlich der Managementgebühren der anderen OGAW bzw. OGA, in die er investiert), nicht mehr als 3,75 % des NIW des Fonds betragen.

Bei folgenden Fonds war im Berichtsjahr im Zusammenhang mit Anlagen in von BlackRock verwaltete Zielfonds eine ermäßigte Managementgebühr zu zahlen, ausgewiesen in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens unter der Rubrik „Abschläge auf Managementgebühr“:

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund, BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund, BlackRock European Select Strategies Fund, BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund, BlackRock Fixed Income Strategies Fund, BlackRock Global Absolute Return Bond Fund, BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative, BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive, BlackRock Managed Index Portfolios – Growth und BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate.

Bei allen nachfolgend aufgeführten Fonds kam es im Jahr zu einer Ausgabenerstattung von der Verwaltungsgesellschaft, ausgewiesen in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens unter „Erstattung von Ausgaben“:

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund, BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund, BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund, BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund, BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund, BlackRock Global Absolute Return Bond Fund, BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative, BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive, BlackRock Managed Index Portfolios – Growth, BlackRock Managed

Index Portfolios – Moderate, BlackRock Style Advantage Screened Fund und BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund.

Im Berichtsjahr bezahlte die Gesellschaft Vertriebsgebühren an BlackRock Investment Management (UK) Limited, die als Hauptvertriebsgesellschaft fungierte.

Die Gesellschaft zahlt jährliche Vertriebsgebühren zwischen 1,25 % und 1,00 % des NIW für Anteile der Klasse C, und 0,50 % des NIW für Anteile der Klasse E. Diese Vertriebsgebühren fallen täglich an, sie basieren auf dem NIW des jeweiligen Fonds, wobei gegebenenfalls Anpassungen des NIW des betreffenden Fonds berücksichtigt werden, und sind monatlich zu zahlen.

Eine detaillierte Aufstellung zu den Verwaltungs- und Vertriebsgebühren je Anteilklasse und Fonds findet sich im Verkaufsprospekt und den wesentlichen KIID der Gesellschaft. Die zum 31. Mai 2022 fälligen Management- und Vertriebsgebühren sind in der Aufstellung des Nettovermögens unter der Rubrik „Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten“ enthalten.

5. Jährliche Servicegebühr

Die Gesellschaft zahlt der Verwaltungsgesellschaft eine jährliche Servicegebühr.

Die Höhe der Servicegebühr kann vom Verwaltungsrat in Absprache mit der Verwaltungsgesellschaft unterschiedlich festgesetzt werden; für die verschiedenen von der Gesellschaft ausgegebenen Fonds und Anteilsklassen gelten verschiedene Sätze. Zwischen dem Verwaltungsrat und der Verwaltungsgesellschaft wurde jedoch vereinbart, dass die gegenwärtige jährliche Servicegebühr höchstens 0,30 % pro Jahr beträgt. Die Administrationsgebühr fällt täglich an, basiert auf dem NIW der jeweiligen Anteilklasse und wird monatlich gezahlt.

Der Verwaltungsrat und die Verwaltungsgesellschaft setzen die Höhe der jährliche Servicegebühr so fest, dass die Gesamtkostenquote jedes Fonds im Vergleich zu einem breiten Markt ähnlicher Anlageprodukte, die Anlegern der Fonds zur Verfügung stehen, wettbewerbsfähig bleibt, wobei verschiedene Kriterien berücksichtigt werden, etwa die jeweilige Branche eines Fonds und die Wertentwicklung eines Fonds gegenüber seiner Vergleichsgruppe.

Die jährliche Servicegebühr wird von der Verwaltungsgesellschaft zur Deckung aller bei der Gesellschaft anfallenden festen und variablen Betriebs- und Verwaltungskosten und -aufwendungen verwendet, mit Ausnahme der Verwahrgebühren, Vertriebsgebühren, Wertpapierleihgebühren, aller Gebühren im Zusammenhang mit Darlehen (und um Missverständnissen vorzubeugen auch alle gegebenenfalls an den Darlehensgeber zu zahlenden Bereitstellungsprovisionen), Kosten für professionelle Dienstleistungen im Zusammenhang mit der Beantragung einer Rückerstattung von Quellensteuer (zuzüglich darauf

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

anfallender Steuern oder Zinsen) sowie etwaiger auf Ebene der Anlagen oder auf Ebene der Gesellschaft fälliger Steuern. Bereitstellungsprovisionen für Darlehen oder etwaige Kosten für professionelle Dienstleistungen im Zusammenhang mit der Beantragung einer Rückerstattung von Quellensteuer werden auf angemessener und ausgewogener Basis auf die betreffenden Fonds umgelegt.

Zu den Betriebs- und Verwaltungskosten und -aufwendungen gehören alle Kosten Dritter und sonstige erstattungsfähige Kosten, die bei der Gesellschaft oder in deren Namen gegebenenfalls anfallen. Dazu gehören unter anderem Gebühren für die Rechnungslegung des Fonds, für die Übertragungsstelle (einschließlich Kosten einer nachgeordneten Übertragungsstelle und damit verbundene Kosten von Handelsplattformen), alle Kosten für Rechts- und Steuerberatung sowie sonstige Beratung, Prüfungsgebühren, Vergütungen für Verwaltungsratsmitglieder, Reisekosten, Auslagen in vertretbarer Höhe, Kosten für Druck, Veröffentlichung und Übersetzung sowie alle anderen Kosten im Zusammenhang mit der Berichterstattung an die Anteilhaber und für bei Aufsichtsbehörden einzureichende Unterlagen, Lizenzgebühren, Korrespondenz- und sonstige Bankgebühren, Software-Support- und Wartungskosten, operative Kosten und Ausgaben für die Investor Servicing Teams sowie die Kosten für sonstige allgemeine Verwaltungsleistungen, die von verschiedenen Unternehmen der BlackRock-Unternehmensgruppe erbracht werden.

Die Verwaltungsgesellschaft übernimmt das finanzielle Risiko sicherzustellen, dass die Gesamtkostenquote der Fonds wettbewerbsfähig bleibt. Die Verwaltungsgesellschaft ist daher berechtigt, von der an sie bezahlten jährlichen Servicegebühr jeden Betrag, der über die tatsächlich der Gesellschaft in einem Jahr entstandenen Kosten hinausgeht, einzubehalten, während der Gesellschaft in einem Jahr entstandene Kosten und Auslagen, die über der an die Verwaltungsgesellschaft gezahlten jährlichen Servicegebühr liegen, von der Verwaltungsgesellschaft oder einer anderen Gesellschaft der BlackRock-Gruppe getragen werden.

Die zum 31. Mai 2022 fällige jährliche Servicegebühr ist in der Aufstellung des Nettovermögens unter der Rubrik „Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten“ enthalten.

Die Mitglieder des Verwaltungsrats der Gesellschaft, die keine Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe sind, erhielten für die Wahrnehmung ihrer Aufgaben während des zum 31. Mai 2022 endenden Berichtsjahres eine Vergütung in Höhe von 30.000 EUR brutto pro Jahr vor Steuern. Die Vorsitzende erhält eine Vergütung in Höhe von 33.500 EUR brutto pro Jahr vor Steuern. Verwaltungsratsmitglieder, die Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe sind, erhalten keine Vergütung für ihre Tätigkeit als Verwaltungsratsmitglied.

Nachfolgend aufgeführt sind die an Deloitte Audit S.à r.l. gezahlten Gebühren für das am 31. Mai 2022 abgeschlossene Geschäftsjahr.

31. Mai 2022
EUR

| | |
|---|---------|
| Prüfungs- und prüfungsbezogene Dienstleistungen (ohne MwSt.) | 430.400 |
| Nicht prüfungsbezogene Leistungen | – |

6. Verwahrstellengebühren

Die Verwahrstelle erhält für jeden Fonds eine Gebühr. Diese Gebühren dienen der Vergütung der Verwahrstelle für die Verwahrung und Transaktionskosten im Zusammenhang mit jedem Fonds.

Verwahrgebühren sind von den verwalteten Vermögenswerten und dem Land, in dem die Wert Vermögenswerte gehalten werden, abhängig. Die Transaktionsgebühren sind von der Art der Transaktion und dem Land, in dem die Transaktion vorgenommen wird, abhängig.

Die Handelsvolumen und Vermögensallokationen für jeden Fonds hängen von ihrer jeweiligen Anlagestrategie ab. Die gesamten Verwahrstellengebühren des einzelnen Fonds hängen zu jeder Zeit von seinen jeweiligen Vermögensallokationen und seiner Handelsaktivität ab.

Die zum 31. Mai 2022 fälligen Verwahrstellengebühren sind in der Aufstellung des Nettovermögens unter der Rubrik „Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten“ enthalten.

7. Performancegebühr

Bei jeder Anteilklasse in jedem Fonds kann zusätzlich zu anderen Gebühren und Auslagen eine Performancegebühr fällig werden, wie im Verkaufsprospekt beschrieben. Eine Ausnahme bildet die Anteilklasse X, bei der keine Performancegebühren gezahlt werden. Die Performancegebühr fällt an jedem Bewertungstag an und entspricht 8 %, 20 % oder 30 % (wie für den entsprechenden Fonds zutreffend, siehe Anhang E des Verkaufsprospekts) des Betrags, um den die Eigenkapitalrendite die Rendite des entsprechenden Referenzindex übersteigt, der in Anhang E des Verkaufsprospekts genauer beschrieben wird. Zur Berechnung der Performancegebühr werden zwei als Typ A und Typ B bezeichnete Methoden verwendet. Welche der beiden Methoden auf die einzelnen Fonds angewendet wird, ist Anhang E des Verkaufsprospekts zu entnehmen. Weitere Einzelheiten sind beim Investor Servicing Team vor Ort sowie am Geschäftssitz der Gesellschaft erhältlich.

Festgestellt wird die Performancegebühr am letzten Tag der Performance-Periode oder vorher, falls ein Anteilhaber alle oder einen Teil seiner Anteile zurückgibt oder umtauscht.

Die zum 31. Mai 2022 fälligen Performancegebühren werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens unter der Rubrik „Performancegebühren“ ausgewiesen.

8. Steuern

Die Luxemburger Zeichnungssteuer, belgische Steuer, die realisierte und nicht realisierte Kapitalertragsteuer sind in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettofondsvermögens unter der Rubrik „Steuern“ ausgewiesen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

Für das Berichtsjahr bis zum 31. Mai 2022 wurden Steuern in Höhe von 12.478.315 USD fällig.

Luxemburg

Die Gesellschaft ist als Investmentgesellschaft nach Luxemburger Recht eingetragen. Demnach ist die Gesellschaft gegenwärtig von der luxemburgischen Einkommen- und Kapitalertragsteuer befreit. Sie ist lediglich einer jährlichen Zeichnungssteuer („*taxe d'abonnement*“) in Höhe von 0,05 % des NIW von jedem Fonds zu jedem Quartalsende im Hinblick auf die Anteile der Klasse I, Klasse I A, Klasse J, Klasse T und der Klasse X in Höhe von 0,01 % des NIW eines jeden Fonds zum jeweiligen Quartalsende unterworfen. Für das Berichtsjahr bis zum 31. Mai 2022 wurden in Luxemburg Zeichnungssteuern in Höhe von 7.412.249 USD fällig.

Belgien

Die Gesellschaft ist in Belgien bei den Finanzdiensten und Marktbehörden gemäß Artikel 154 des Gesetzes vom 3. August 2012 über Finanztransaktionen und Finanzmärkte registriert. Zum öffentlichen Vertrieb in Belgien zugelassene Fonds unterliegen einer jährlichen Steuer von 0,0925 % auf den NIW der in Belgien über belgische Vermittler vertriebenen Anteile zum 31. Dezember des Vorjahres. Für das Berichtsjahr bis zum 31. Mai 2022 wurden in Belgien Steuern in Höhe von 141.486 USD fällig.

Vereinigtes Königreich

Reporting Funds

Die britische Reporting-Fund-Regelung gilt für die Gesellschaft. Dieser Regelung zufolge müssen Anleger den Teil der ihren Anteilen an einem Fonds mit britischem Reporting-Fund-Status zurechenbaren Erträge versteuern, unabhängig davon, ob die Erträge ausgeschüttet wurden oder nicht. Gewinne aus dem Verkauf ihrer Anteile unterliegen dagegen der Kapitalertragsteuer. Eine Liste der Fonds, die derzeit den Status eines UK Reporting Fund aufweisen, ist unter <https://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds> verfügbar.

Sonstige Steuern auf Transaktionen

In anderen Jurisdiktionen können Steuern, Finanztransaktionssteuern („*FTS*“) oder andere Transaktionssteuern auf bestimmte von den Fonds gehaltene Vermögenswerte erhoben werden (zum Beispiel die Stempelsteuer in Großbritannien oder die *FTS* in Frankreich).

Quellensteuer

Etwaige Dividenden, Zinsen und Kapitalerträge, die die Gesellschaft für ihre Anlagen erhält, unterliegen möglicherweise einer Quellensteuer im Ursprungsland, die in der Regel nicht erstattungsfähig ist, da die Gesellschaft selbst von der Einkommensteuer befreit ist. Durch die aktuelle Rechtsprechung der Europäischen Union kann sich jedoch der Umfang dieser nicht erstattungsfähigen Steuer unter Umständen verringern. Anleger sollten sich über mögliche Steuerfolgen einer Zeichnung, eines Kaufs, des Haltens, der Rücknahme, des Umtauschs oder des Verkaufs von Anteilen nach dem Recht des Landes, deren Staatsangehörige sie

sind bzw. in dem sie ihren Wohnsitz oder gewöhnlichen Aufenthalt haben, informieren und sich gegebenenfalls mit ihren professionellen Beratern in Verbindung setzen. Anleger sollten beachten, dass sich Höhe und Bemessungsgrundlage von Steuern sowie Freistellungen hiervon ändern können. Nähere Angaben zur Quellensteuer sind im Verkaufsprospekt enthalten.

Die Quellensteuer ist in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens unter der Rubrik „Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern“ enthalten.

Dividenden, welche die Gesellschaft auf CFD erhält, können der Quellensteuer unterliegen: Insbesondere die Quellensteuer für CFD auf US-Eigenkapitalinstrumenten wird gemäß Abschnitt 871 Buchstabe m des Internal Revenue Code („*IRC*“) geregelt. Diese Quellensteuer ist in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens unter der Rubrik „Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern“ enthalten.

9. Anlageberater und Unteranlageberater

Die Verwaltungsgesellschaft, BlackRock (Luxembourg) S.A., hat die Aufgaben und Leistungen der Anlageverwaltung und -beratung auf die folgenden Anlageberater übertragen: BlackRock Financial Management, Inc. (BFM Inc.), BlackRock Institutional Trust Company N.A. (BTC), BlackRock Investment Management LLC (BIMLLC), BlackRock Investment Management (UK) Limited (BIMUK) und BlackRock (Singapore) Limited (BSL), wie im Verkaufsprospekt beschrieben.

Die Anlageberater geben Empfehlungen und wirken bei der Verwaltung in den Bereichen Titel- und Branchenauswahl sowie der strategischen Asset-Allokation mit. BIM UK hat einige seiner Funktionen an BlackRock Japan Co., Ltd. (BLKJap), BlackRock Investment Management (Australia) Limited (BIMAL) und BlackRock Asset Management North Asia Limited (BAMNA) übertragen. Ungeachtet der Bestellung der Anlageberater übernimmt die Verwaltungsgesellschaft die volle Verantwortung gegenüber der Gesellschaft für alle Anlagegeschäfte.

| Fonds | Anlageberater | Sub-Anlageberater |
|--|---------------|-------------------|
| BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund | BITC | - |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | BIMUK | BAMNA |
| BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund | BIMUK, BIMLLC | BAMNA |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | BIMUK | - |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | BIMUK | - |
| BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | BIMUK | BAMNA |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | BIMUK | BAMNA |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | BIMUK, BFM | - |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | BIMUK, BFM | - |
| BlackRock ESG Euro Bond Fund | BIMUK | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Fonds | Anlageberater | Sub-Anlageberater |
|--|---------------|-------------------|
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund | BIMUK | - |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund | BIMUK | - |
| BlackRock European Absolute Return Fund | BIMUK | - |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | BIMUK | - |
| BlackRock European Select Strategies Fund | BIMUK, BSL | - |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | BIMUK | - |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund | BIMUK | - |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund | BIMUK, BSL | - |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | BIMUK, BSL, | BAMNA, |
| | BFM, BITC | BLKJap |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | BIMUK | - |
| BlackRock Global Event Driven Fund | BIMLLC | - |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | BIMUK, | BIMAL |
| | BIMMLLC, | |
| | BFM, BSL | |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | BIMUK, | BAMNA |
| | BIMLLC | |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | BIMUK, | BAMNA |
| | BIMLLC | |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | BIMUK, | BAMNA |
| | BIMLLC | |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | BIMUK, | BAMNA |
| | BIMLLC | |
| BlackRock Style Advantage Fund | BIMLLC | - |
| BlackRock Style Advantage Screened Fund ⁽¹⁾ | BIMUK, | - |
| | BIMLLC | |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | BIMLLC | - |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund | BIMLLC | - |
| BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund | BFM | - |
| BlackRock Total Advantage Fund ⁽¹⁾ | BIMUK, | - |
| | BIMMLLC, | |
| | BFM | |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | BIMUK | - |

⁽¹⁾ Der Fonds wurde aufgelöst, Näheres hierzu siehe Anmerkung 1.

10. Geschäfte mit verbundenen Parteien

Die Muttergesellschaft der Verwaltungsgesellschaft, die Hauptvertriebsgesellschaft und der Anlageberater ist BlackRock, Inc., ein Unternehmen mit Sitz in Delaware, USA.

Während des Berichtsjahres wurden keine wesentlichen Transaktionen außerhalb des gewöhnlichen Geschäftsverlaufs oder zu nicht üblichen Bedingungen getätigt. Im Berichtszeitraum wurden keine Transaktionen der Gesellschaft über BlackRock-Gesellschaften abgewickelt.

Die Gesellschaft hat BlackRock Advisors (UK) Limited (die „Wertpapierleihstelle“), ein verbundenes Unternehmen der Gesellschaft, als Wertpapierleihstelle beauftragt. Die Wertpapierleihstelle trägt alle mit der Wertpapierleihe verbundenen operativen Kosten. Der Gesamtertrag aus Wertpapierleihtransaktionen wird zwischen dem entsprechenden Fonds und dem Vermittler der Wertpapierleihe aufgeteilt. Die Fonds, die Wertpapierleihgeschäfte durchführen, erhalten mindestens 62,5%, während die Wertpapierleihstelle bis zu 37,5% dieses Ertrags vereinnahmt.

Manche der Fonds nutzen Cross-Investment-Verfahren, d. h., sie investieren in andere Fonds innerhalb der Umbrella-Struktur der Gesellschaft. Die Aufstellung des Nettovermögens und die kombinierte Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen wurden nicht angepasst, um die Auswirkungen der Cross-Investments zu beheben. Provisionen auf Anteilszeichnungen und Rückzahlungen sowie Verwaltungsgebühren wurden nicht auf die Vermögenswerte des Fonds angewandt, der Kreuzbeteiligungen an anderen Fonds hält.

In der unten stehenden Tabelle wird der Wert dieser Cross-Investments im Anlagenportfolio des jeweiligen Fonds zum 31. Mai 2022 angegeben:

| Fonds | Fonds für Cross-Investments | Währung | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|--|---------|------------|----------------------|
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | Blackrock Strategic Funds - BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | | | |
| | X2 (GBP) | EUR | 54.342.150 | 4,81 |

11. Ausschüttungen

Für die thesaurierenden Anteilklassen sieht die aktuelle Anlagepolitik des Verwaltungsrats eine Thesaurierung und Reinvestition sämtlicher Nettoerträge vor.

Bei ausschüttenden Anteilen sieht die Anlagepolitik eine substanzielle Ausschüttung des gesamten Anlageertrags (sofern verfügbar) für das Jahr nach Abzug der Aufwendungen (oder Bruttoertrag im Falle von G-Anteilen) vor. Der Verwaltungsrat kann darüber hinaus entscheiden, ob und in welcher Höhe realisierte und nicht realisierte Nettokapitalgewinne bei den Ausschüttungen berücksichtigt werden. In Fällen, in denen ausschüttende Anteilklassen Dividenden ausschütten, die realisierte oder nicht realisierte Nettokapitalgewinne beinhalten, oder im Fall von Fonds, die Erträge vor Abzug von Gebühren ausschütten, können die Ausschüttungen aus anfänglich gezeichnetem Kapital erfolgen. Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass auf diese Weise vorgenommene Ausschüttungen möglicherweise – in Abhängigkeit von den örtlichen Steuergesetzen – als Einkünfte zu versteuern sind; sie sollten diesbezüglich ihre persönlichen Steuerberater konsultieren.

Wenn ein Fonds mit UK Reporting-Status Erträge ausweist, die die vorgenommenen Ausschüttungen übersteigen, gilt der Überschuss als Ausschüttung und wird entsprechend als Ertrag gemäß dem Steuerstatus des Anlegers versteuert.

Die Gesellschaft kann Ertragsausgleichsvereinbarungen eingehen, um sicherzustellen, dass die Höhe des für einen Fonds aufgelaufenen Nettoertrags (oder Bruttoertrag im Falle von ausschüttenden Anteilen der Klasse G), der jedem Anteil zuzuteilen ist, nicht durch die Ausgabe, Umwandlung oder Rücknahme dieser Anteile im Verlauf eines Rechnungsjahres beeinträchtigt wird.

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

12. Wertpapierleihe

Die Tabelle unten zeigt den Wert der verliehenen Wertpapiere und die in diesem Zusammenhang erhaltenen Sicherheiten zum 31. Mai 2022:

| Fonds | WÄHRUNG | Wert der verliehenen Wertpapiere | Wert erhaltener Sicherheiten |
|---|---------|----------------------------------|------------------------------|
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | USD | 918.263 | 1.230.186 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | EUR | 39.070.514 | 43.230.570 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | USD | 16.761.160 | 19.310.649 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | USD | 148.708.220 | 163.215.395 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | USD | 15.480.810 | 17.072.212 |
| BlackRock ESG Euro Bond Fund | EUR | 26.613.943 | 28.202.518 |
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund | EUR | 25.865.937 | 27.612.325 |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund | EUR | 2.942.804 | 3.096.609 |
| BlackRock European Absolute Return Fund | EUR | 26.594.657 | 28.990.073 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | EUR | 20.278.059 | 22.301.575 |
| BlackRock European Select Strategies Fund | EUR | 31.727.854 | 35.275.005 |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund | EUR | 37.181.881 | 39.426.846 |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund | EUR | 264.203.162 | 284.047.249 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | EUR | 3.451.079 | 3.715.332 |
| BlackRock Global Event Driven Fund | USD | 135.558.783 | 159.751.796 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | USD | 60.204.525 | 69.382.864 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | EUR | 1.828.168 | 2.022.123 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | EUR | 5.211.926 | 8.112.018 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | EUR | 636.196 | 1.562.076 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | EUR | 14.544.123 | 16.586.712 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | USD | 26.162.421 | 29.893.771 |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund | USD | 7.499.936 | 8.793.638 |

Die im Geschäftsjahr aus Wertpapierleihtransaktionen erzielten Erträge werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen ausgewiesen unter der Überschrift „Wertpapierleihe“. Die verliehenen Wertpapiere sind im Anlageportfolio jeweils gekennzeichnet.

13. Transaktionskosten

Zur Erreichung seines Anlageziels entstehen einem Fonds Transaktionskosten im Zusammenhang mit den Handelstätigkeiten in seinem Anlagenportfolio. In der

nachstehenden Tabelle sind die einzeln abgrenzbaren Transaktionskosten ausgewiesen, die jedem Fonds für das zum 31. Mai 2022 endende Berichtsjahr entstanden sind. Diese Kosten umfassen Provisionskosten und Abwicklungsgebühren.

| Fonds | WÄHRUNG | Transaktionskosten |
|--|---------|--------------------|
| BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund | USD | 16.459 |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | USD | 239.087 |
| BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund | USD | 4.009 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | EUR | 221.892 |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | GBP | 112.930 |
| BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | USD | 27.567 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | USD | 1.653.131 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | USD | 297 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | USD | - |
| BlackRock ESG Euro Bond Fund | EUR | - |
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund | EUR | - |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund | EUR | - |
| BlackRock European Absolute Return Fund | EUR | 440.137 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | EUR | 478.524 |
| BlackRock European Select Strategies Fund | EUR | 248.648 |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | EUR | 46.744 |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund | EUR | 23 |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund | EUR | - |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | EUR | 301 |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | USD | 61.103 |
| BlackRock Global Event Driven Fund | USD | 342.092 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | USD | 1.270.204 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | EUR | 3.258 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | EUR | 1.833 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | EUR | 47.135 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | EUR | 60.573 |
| BlackRock Style Advantage Fund | USD | - |
| BlackRock Style Advantage Screened Fund ⁽¹⁾ | USD | - |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | USD | 204.661 |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund | USD | 141.416 |
| BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund | USD | 597 |
| BlackRock Total Advantage Fund ⁽¹⁾ | EUR | - |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | GBP | 2.702 |

⁽¹⁾ Der Fonds wurde aufgelöst, Näheres hierzu siehe Anmerkung 1.

Nicht alle Transaktionskosten sind gesondert feststellbar. Bei CFDs, Swaps, Devisentermingeschäften, Futures-Kontrakten, Optionen, Swap-Optionen und TBAs sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Diese Transaktionskosten sind zwar nicht einzeln abgrenzbar, werden jedoch von der Performance eines jeden Fonds erfasst. Die Kosten der Marktauswirkungen sind nicht einzeln feststellbar und daher nicht in der vorstehenden Tabelle erfasst.

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

14. Kreditfazilität

Die Gesellschaft richtete eine Kreditfazilität bei JPMorgan Chase Bank, N.A. („JPMorgan“) ein, im Rahmen derer JPMorgan den luxemburgischen Fonds zusammen mit anderen syndizierten Kreditgebern eine Kreditfazilität in Höhe von 1,23 Mrd. USD bereitstellt.

Diese Kreditfazilität werden die Fonds für temporäre Finanzierungszwecke, darunter unter anderem für Anteilsrücknahmen, nutzen. Etwaige Zinsgebühren und Provisionen, die durch die Inanspruchnahme der Kreditfazilität entstehen, werden aus dem Vermögen der entsprechenden Fonds bezahlt. Neue Fonds nehmen nicht automatisch an einer Kreditlinie teil und ihre Aufnahme muss daher in einem Beitrittsverfahren erfolgen. Dieses Verfahren beinhaltet unter anderem jede etwa erforderliche Due-Diligence-Prüfung durch die Kreditgeber, um den Beitritt der neuen Fonds zu genehmigen. Während dieses Geschäftsjahres nehmen solche Fonds an keiner Kreditlinie teil und können diese nicht in Anspruch nehmen. Es ist zudem nicht gewährleistet, dass die Kreditgeber den Beitritt neuer Fonds zu der Kreditlinie genehmigen oder dass einem Fonds ein Kredit gewährt wird, da die Kreditlinie dem Vorbehalt der Verfügbarkeit (auf gerechter Zuteilungsbasis) zwischen den Fonds und anderen BlackRock Fonds, die an dem Kreditvertrag beteiligt sind, unterliegt. Demzufolge nehmen bestimmte Fonds unter Umständen nicht an der Kreditlinie teil und es werden ihnen diesbezüglich keine Kosten entstehen.

Eine Darlehensverpflichtungsgebühr wird in Bezug auf diese Kreditfazilität erhoben und ist in der Aufwands-

und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens unter der Überschrift „Darlehensverpflichtungsgebühren“ enthalten. Die Darlehensverpflichtungsgebühr beträgt 0,10 % auf den ausstehenden Betrag.

Während des am 31. Mai 2022 endenden Geschäftsjahres wurde die Kreditfazilität nicht in Anspruch genommen.

15. Forderungen/Verbindlichkeiten gegenüber Börsenmaklern

Die Forderungen/Verbindlichkeiten gegenüber Börsenmaklern in der Aufstellung des Nettofondsvermögens bestehen aus an Clearing-Stellen des Fonds und diverse Kontrahenten gezahlte oder von diesen erhaltene Barsicherheiten und Margenzahlungen.

16. Gesamtkostenquote (TER)

Die Gesamtkostenquote („TER“) wird berechnet, indem die gesamten Kosten (ausgenommen Bankzinsen, Aufwendungen für negative Renditen von finanziellen Vermögenswerten und rückerstattete Aufwendungen) durch das durchschnittliche Nettovermögen der Anteilklassen geteilt werden, ausgedrückt in Prozent. Alle Daten wurden annualisiert.

Die Managementgebühren dürfen teilweise zur Vergütung von Vertriebsaktivitäten für die Gesellschaft verwendet werden. Rückerstattungen sind an institutionelle Anleger möglich, die aus kaufmännischer Sicht Gesellschaftsanteile für Dritte halten.

Die TERs für das Jahr vom 1. Juni 2021 bis 31. Mai 2022 lauten wie folgt:

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) ⁽¹⁾ | Performance-bezogene Gebühren (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) |
|--|---|---|---|
| BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund | Auf AUD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,981 % | 0,002% |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A | 2,420 % | 0,358% |
| | Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,995 % | 0,001% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 1,985 % | 0,005% |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 1,992 % | - |
| | Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 1,953 % | 0,012% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,847 % | 0,372% |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,483 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,505 % | 0,004% |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,717 % | 0,238% |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,505 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1,435 % | 0,212% |
| | Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1,522 % | 0,327% |
| | Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1,198 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 1,746 % | 0,556% |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,194 % | - | |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. | Performance- |
|---|--|------------------------|--|
| | | Gebühr) ⁽¹⁾ | bezogene Gebühren (als Prozentsatz des durch- schnittlichen Nettovermögens) |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | 2,688 % | 0,771% |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A | 2,589 % | 0,677% |
| | Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 2,828 % | 0,933% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,707 % | 0,302% |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,496 % | 0,001% |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 2,320 % | 0,909% |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 2,356 % | 0,944% |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,974 % | 0,571% |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 3,125 % | 0,697% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,115 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 1,970 % | 0,839% |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 1,853 % | 0,716% |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 1,851 % | 0,710% |
| BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,931 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,936 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D | 2,033 % | 0,711% |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,434 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,481 % | 0,032% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | 0,141 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status ⁽²⁾ | 0,134 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 0,937 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 0,932 % | - |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund ⁽³⁾ | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 0,934 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,534 % | - |
| | Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,557 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 1,561 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,855 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,055 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,630 % | - |
| | Auf CAD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,614 % | - |
| | Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,627 % | - |
| | Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,631 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 0,610 % | - |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,080 % | - | |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,941 % | 0,079% |
| | CNH-Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,840 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,964 % | 0,075% |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,930 % | 0,077% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 2,134 % | 0,266% |
| | Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D ⁽²⁾ | 1,427 % | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,432 % | 0,069% |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,485 % | 0,120% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,569 % | 0,204% |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,436 % | 0,077% |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 1,123 % | 0,045% |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1,217 % | 0,140% |
| | Auf JPY lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I ⁽²⁾ | 1,143 % | - |
| | Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I ⁽²⁾ | 1,148 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 1,144 % | 0,066% |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 1,308 % | 0,226% |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 1,187 % | 0,118% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status | 1,236 % | 0,170% |
| | Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X ⁽²⁾ | 0,083 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | 0,060 % | - |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 1,185 % | 0,069% | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 1,243 % | 0,127% | |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 1,406 % | 0,290% | |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 1,107 % | - | |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) ⁽¹⁾ | Performance- |
|---|---|---|--|
| | | | bezogene Gebühren (als Prozentsatz des durch- schnittlichen Nettovermögens) |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,919 % | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,942 % | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse D | 1,420 % | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,440 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,440 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,430 % | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,430 % | - |
| | Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,431 % | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,428 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1,120 % | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1,144 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,142 % | - |
| | Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 0,832 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 0,830 % | - |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund ⁽³⁾ | Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 1,752 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,770 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,766 % | - |
| | Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,781 % | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 1,760 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 1,772 % | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,024 % | - |
| | Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,999 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,012 % | - |
| | Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,012 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,014 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,019 % | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,014 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,026 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,270 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,286 % | - |
| | Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse I | 0,829 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I | 0,839 % | - |
| | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil (G) der Klasse I | 0,826 % | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 0,836 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,834 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 0,834 % | - |
| Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse X | 0,061 % | - | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,083 % | - | |
| Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,085 % | - | |
| Auf CAD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,085 % | - | |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 0,925 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse AI | 0,892 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 0,934 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,572 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,559 % | - |
| | Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse E | 1,429 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse E | 1,429 % | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,419 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,433 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,505 % | - |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,102 % | - | |
| BlackRock ESG Euro Bond Fund | Ausschüttungsanteil der Klasse A | 0,977 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 0,984 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 1,004 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,640 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,476 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,492 % | - |
| | Ausschüttender Anteil (G) der Klasse X | 0,093 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,090 % | - |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 0,338 % | - | |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. | Performance- |
|--|---|------------------------|-----------------|
| | | Gebühr) ⁽¹⁾ | Nettovermögens) |
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,017 % | - |
| | Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A ⁽²⁾ | 1,044 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 1,010 % | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse D | 0,615 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,619 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,518 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,481 % | - |
| | Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I ⁽²⁾ | 0,484 % | - |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,081 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 0,831 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 0,850 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,532 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,312 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,444 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,050 % | - |
| BlackRock European Absolute Return Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 0,200 % | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse A | 2,320 % | 0,446% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 2,531 % | 0,666% |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse D | 1,715 % | 0,340% |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,884 % | 0,524% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 2,034 % | 0,667% |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,766 % | 0,397% |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,572 % | 0,215% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,878 % | 0,510% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 1,833 % | 0,754% |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse S | 1,284 % | 0,210% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,078 % | - |
| | Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 1,890 % | 0,014% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,965 % | 0,096% |
| | Ausschüttungsanteile (G) der Klasse D | 1,369 % | - |
| | Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,589 % | 0,228% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,630 % | 0,264% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,431 % | 0,063% |
| BlackRock European Select Strategies Fund ⁽³⁾ | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1,088 % | 0,007% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,072 % | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse A | 1,560 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,554 % | - |
| | Auf CZK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,557 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 1,551 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D | 0,949 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,962 % | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse E | 2,054 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,056 % | - |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | Ausschüttungsanteil der Klasse I | 0,762 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,772 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,121 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,427 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,038 % | 0,148% |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,223 % | 0,338% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,944 % | 0,045% |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,593 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 0,813 % | 0,215% |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 0,588 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | 0,097 % | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) ⁽¹⁾ | Performance-bezogene Gebühren (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) |
|---|---|---|---|
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund ⁽³⁾ | Ausschüttungsanteil der Klasse A | 1,268 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,268 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 1,285 % | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse D | 0,868 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,881 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,787 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,675 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,091 % | - |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund ⁽³⁾ | Ausschüttungsanteil der Klasse A | 1,268 % | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | 1,266 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | 1,262 % | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,263 % | - |
| | Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,233 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,259 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 1,269 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 1,261 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 1,286 % | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse D | 0,868 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,866 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,868 % | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,866 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,864 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,870 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,865 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,766 % | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse I | 0,676 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,678 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,675 % | - |
| Akkumulierungsanteil der Klasse S ⁽²⁾ | 0,737 % | - | |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S ⁽²⁾ | 0,729 % | - | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse X | 0,082 % | - | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,081 % | - | |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund ⁽³⁾ | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,307 % | - |
| | Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,343 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,355 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D | 0,858 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,860 % | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,782 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,859 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,660 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,658 % | - |
| | Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,659 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,160 % | - |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | 1,879 % | 0,002% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,389 % | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,368 % | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,391 % | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1,169 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,099 % | - |
| | Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,100 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 0,938 % | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 0,936 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 0,926 % | - |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 0,942 % | - | |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) ⁽¹⁾ | Performance-bezogene | |
|---|---|--|--|---|
| | | | Gebühren (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) | |
| BlackRock Global Event Driven Fund | Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | 1,886 % | - | |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,864 % | - | |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,872 % | - | |
| | HKD-Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,853 % | - | |
| | SGD-Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,868 % | - | |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 1,869 % | - | |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 1,866 % | - | |
| | Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,371 % | - | |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,367 % | - | |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,363 % | - | |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,373 % | - | |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,359 % | - | |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,370 % | - | |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,384 % | - | |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 1,071 % | 0,001% | |
| | Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 1,103 % | - | |
| | Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 1,078 % | - | |
| | Auf BRL lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,061 % | - | |
| | Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1,074 % | - | |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 1,072 % | 0,001% | |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 1,072 % | - | |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 1,080 % | 0,001% | |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse IA | 0,571 % | - | |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse IA | 0,582 % | - | |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse S | 1,061 % | - | |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S | 1,071 % | - | |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,072 % | - | |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 0,864 % | - | |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 0,859 % | - | |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 0,866 % | - | |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | 0,863 % | - | |
| | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf CHF lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A ⁽²⁾ | 1,585 % | - |
| | | Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 1,538 % | - |
| Auf AUD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status ⁽²⁾ | | 1,613 % | - | |
| Auf CAD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status ⁽²⁾ | | 1,608 % | - | |
| Auf CNH lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status ⁽²⁾ | | 1,621 % | - | |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | | 1,570 % | - | |
| Auf HKD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | | 1,536 % | - | |
| Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | | 1,569 % | - | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse A | | 1,536 % | - | |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A ⁽²⁾ | | 1,582 % | - | |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A ⁽²⁾ | | 1,631 % | - | |
| Ausschüttungsanteil der Klasse D | | 0,941 % | - | |
| Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status ⁽²⁾ | | 0,959 % | - | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | | 0,921 % | - | |
| Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | | 2,038 % | - | |
| Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I ⁽²⁾ | | 0,727 % | - | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status ⁽²⁾ | | 0,857 % | - | |
| Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status ⁽²⁾ | | 0,862 % | - | |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status ⁽²⁾ | | 0,871 % | - | |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status ⁽²⁾ | | 0,859 % | - | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | | 0,080 % | - | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status | | 0,627 % | - | |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) ⁽¹⁾ | Performance- |
|---|---|---|--|
| | | | bezogene Gebühren (als Prozentsatz des durch- schnittlichen Nettovermögens) |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative ⁽³⁾ | Ausschüttungsanteil der Klasse A | 1,134 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,137 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,157 % | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse D | 0,501 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,503 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,498 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,508 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,657 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,444 % | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Balance | 1,127 % | - |
| Vermögensstrategie Moderat - Ausgewogen ausschüttender Anteil | 0,522 % | - | |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive ⁽³⁾ | Ausschüttungsanteil der Klasse A | 1,124 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,129 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,120 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 1,128 % | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,500 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,502 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,499 % | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,498 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,496 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,503 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,501 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,633 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,440 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,426 % | - |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Substanz | 1,126 % | - | |
| Vermögensstrategie Defensiv ausschüttender Anteil | 0,508 % | - | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,050 % | - | |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth ⁽³⁾ | Ausschüttungsanteil der Klasse A | 1,131 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,133 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,127 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 1,134 % | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,501 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,502 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,497 % | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,499 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,497 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,505 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,504 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,646 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,441 % | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,426 % | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Chance | 1,128 % | - |
| Vermögensstrategie Wachstum ausschüttender Anteil | 0,502 % | - | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,051 % | - | |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. | Performance- | Performance- | Performance- |
|---|---|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | | Bezugs- | gebühren (als | gebühren (als | gebühren (als |
| | | Prozentsatz | Prozentsatz | Prozentsatz | Prozentsatz |
| | | des durch- | des durch- | des durch- | des durch- |
| | | schnittlichen | schnittlichen | schnittlichen | schnittlichen |
| | | Nettovermögens) | Nettovermögens) | Nettovermögens) | Nettovermögens) |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate ⁽³⁾ | Ausschüttungsanteil der Klasse A | 1,129 % | - | - | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,128 % | - | - | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,124 % | - | - | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 1,136 % | - | - | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,501 % | - | - | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,510 % | - | - | - |
| | Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,497 % | - | - | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,498 % | - | - | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,497 % | - | - | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,503 % | - | - | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,500 % | - | - | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,635 % | - | - | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse I | 0,428 % | - | - | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,442 % | - | - | - |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,427 % | - | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Wachstum | 1,127 % | - | - | - |
| | IndexInvest Wachstum, auf CHF lautender, abgesicherter ausschüttender Anteil | 1,124 % | - | - | - |
| | Vermögensstrategie Ausgewogen ausschüttender Anteil | 0,497 % | - | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,043 % | - | - | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,061 % | - | - | - |
| Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,061 % | - | - | - | |
| BlackRock Style Advantage Fund | Ausschüttungsanteil der Klasse A | 1,412 % | - | - | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | 1,480 % | - | - | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,479 % | - | - | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,472 % | - | - | - |
| | Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,466 % | - | - | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,923 % | - | - | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,982 % | - | - | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,898 % | - | - | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,921 % | - | - | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 0,914 % | - | - | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,967 % | - | - | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,986 % | - | - | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil PF der Klasse I | 0,617 % | - | - | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil PF der Klasse I | 0,529 % | - | - | - |
| | Auf BRL lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,718 % | - | - | - |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,716 % | - | - | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 0,672 % | - | - | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 0,964 % | - | - | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 0,715 % | - | - | - |
| | Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status | 0,736 % | - | - | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,213 % | - | - | - |
| | Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,201 % | - | - | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,170 % | - | - | - |
| Auf NZD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X | (0,082) % | - | - | - | |
| Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | 0,173 % | - | - | - | |
| Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 0,865 % | - | - | - | |
| Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z | 0,867 % | - | - | - | |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,027 % | - | - | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,629 % | - | - | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,536 % | - | - | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,488 % | - | - | - |
| | Auf JPY lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,486 % | - | - | - |
| | Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,485 % | - | - | - |
| | Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | 0,084 % | - | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) ⁽¹⁾ | Performance-bezogene |
|--|---|---|--|
| | | | Gebühren (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 1,150 % | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | 0,734 % | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,646 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 1,659 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,504 % | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I | 0,504 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,104 % | - |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,105 % | - |
| | Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,104 % | - |
| | Auf JPY lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,106 % | - |
| BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse A | 2,257 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 2,276 % | - |
| | Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 2,290 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse AI | 2,296 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse C | 3,265 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,692 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,697 % | - |
| | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 1,686 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,796 % | - |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 1,373 % | - |
| | Ausschüttungsanteil der Klasse J | 1,689 % | - |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X | 0,189 % | - |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A | 2,617 % | 0,757% |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A | 2,687 % | 0,826% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status | 3,191 % | 1,329% |
| | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 2,290 % | 1,185% |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D | 2,544 % | 1,415% |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 1,581 % | 0,490% |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D | 2,614 % | 1,512% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status | 4,318 % | 3,318% |
| | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E | 3,903 % | 1,490% |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E | 2,955 % | 0,561% |
| | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 2,103 % | 1,264% |
| | Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 2,383 % | 1,541% |
| | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I | 2,282 % | 1,450% |
| | Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status | 0,087 % | - |

⁽¹⁾ Alle Zahlen werden annualisiert.

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

⁽³⁾ Fonds investiert in zugrunde liegende Zielfonds, die keine TER in Übereinstimmung mit der SFAMA-Richtlinie veröffentlichen.

Die TERs wurden nach den Leitlinien der Swiss Funds and Asset Management Association („SFAMA“) zur Berechnung und Offenlegung der TER für Organismen für gemeinsame Anlagen berechnet. Die SFAMA-Leitlinien wurden zuletzt am 1. Januar 2022 geändert.

Bestimmte Fonds, wie vorstehend angegeben, investieren einen erheblichen Teil ihres Nettovermögens in zugrunde liegende Zielfonds, die keine TER in Übereinstimmung mit der SFAMA-Richtlinie publizieren. Daher ist die anteilige TER der zugrundeliegenden Zielfonds nicht in die TER der vorstehend dargestellten Fonds eingeflossen. Dieser Verzicht auf eine Berechnung erfolgt in Übereinstimmung mit der SFAMA-Richtlinie.

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

17. Weitere Ereignisse

Ein neuer Prospekt wurde am 20. Juni 2022 veröffentlicht.

Mit Wirkung zum 20. Juni 2022 wurde der BlackRock Fixed Income Strategies Fund in BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund umbenannt.

Mit Wirkung zum 31. Juli 2022 ist Barry O'Dwyer als Mitglied des Vorstands zurückgetreten.

Es gab es keine weiteren Ereignisse nach dem Ende des Geschäftsjahrs und bis zum Datum der Genehmigung des Jahresabschlusses, die nach Auffassung des Verwaltungsrats wesentliche Auswirkungen auf den Jahresabschluss für das zum 31. Mai 2022 endende Geschäftsjahr haben könnten.

18. Genehmigungsdatum

Der Verwaltungsrat hat den Jahresabschluss am 27. September 2022 genehmigt.

An die Anteilhaber der
BlackRock Strategic Funds (BSF)
49, avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxemburg,
Großherzogtum Luxemburg

BERICHT DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS

Prüfvermerk

Wir haben den Jahresabschluss für BlackRock Strategic Funds (die „Gesellschaft“) und alle ihre Teilfonds, bestehend aus der Aufstellung des Nettovermögens und dem Portfolio der Anlagen zum 31. Mai 2022 sowie der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen im Netto-Fondsvermögen für das abgeschlossene Berichtsjahr, sowie die Anmerkungen zum Jahresabschluss, einschließlich der Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsgrundsätze, geprüft.

Nach unserer Auffassung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss, in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Vorschriften für die Aufstellung und Darstellung von Jahresabschlüssen, ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage der Gesellschaft und ihrer einzelnen Teilfonds zum 31. Mai 2022 sowie der Ertragslage und der Veränderungen ihres Nettovermögens für das zu diesem Zeitpunkt endende Berichtsjahr.

Die Grundlage für unser Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über den Beruf des Abschlussprüfers (Gesetz vom 23. Juli 2016) und den international anerkannten Grundsätzen zur Abschlussprüfung (International Standards on Auditing, ISA) in ihrer für Luxemburg durch die **Commission de Surveillance du Secteur Financier** (CSSF) verabschiedeten Fassung durchgeführt. Unsere Aufgaben im Rahmen des Gesetzes vom 23. Juli 2016 und der Standards, wie sie laut CSSF in Luxemburg anzuwenden sind, sind eingehender im Abschnitt „Zuständigkeiten des unabhängigen Abschlussprüfers bei der Prüfung von Jahresabschlüssen“ unseres Berichtes dargestellt. Wir sind ferner gemäß dem International Code of Ethics for Professional Accountants einschließlich der International Independence Standards, herausgegeben vom International Ethics Standards Board for Accountants (IESBA Code), der für Luxemburg von der Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) verabschiedet wurde, in Übereinstimmung mit den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfungen von Jahresabschlüssen von Bedeutung sind, dem Gebot der Unabhängigkeit verpflichtet und haben unsere berufsethischen Verantwortlichkeiten gemäß diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und angemessen sind, um eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu bilden.

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft ist für die sonstigen Angaben verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht aufgeführten Informationen, nicht jedoch den Jahresabschluss und unseren Prüfbericht des unabhängigen Abschlussprüfers hierzu.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen und wir geben hierzu keinerlei abschließende Feststellung ab.

In Verbindung mit unserer Prüfung der Abschlüsse sind wir dafür verantwortlich, die sonstigen Informationen zur Kenntnis zu nehmen und hierbei zu beurteilen, ob die sonstigen Informationen in wesentlichem Widerspruch zu den Abschlüssen oder unseren bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnissen stehen oder anderweitig wesentliche Fehldarstellungen zu enthalten scheinen. Wenn wir auf Grundlage der von uns durchgeführten Tätigkeiten wesentliche Falschaussagen dieser sonstigen Informationen feststellen, sind wir verpflichtet, hierauf hinzuweisen. Wir haben in dieser Hinsicht nichts zu berichten.

Verantwortungen des Verwaltungsrats der Gesellschaft für die Jahresabschlüsse

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft ist für die Erstellung und korrekte Darstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen in Luxemburg bezüglich der Aufstellung und Vorlage des Jahresabschlusses sowie eine interne Kontrolle verantwortlich, die nach Ermessen des Verwaltungsrats der Gesellschaft bei der Aufstellung des Jahresabschlusses, der frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – unzutreffenden Angaben ist, erforderlich ist.

Im Rahmen der Erstellung von Jahresabschlüssen zählt es zu den Aufgaben des Verwaltungsrats der Gesellschaft, die Fähigkeit des Fonds, seine Unternehmenstätigkeit fortzuführen, zu bewerten, gegebenenfalls Umstände offenzulegen, die für die Fortführung der Unternehmenstätigkeit von Belang sind, sowie den Grundsatz der Unternehmensfortführung der Rechnungslegung zugrundezulegen, es sei denn, der Verwaltungsrat der Gesellschaft beabsichtigt entweder den Fonds aufzulösen oder den Betrieb einzustellen oder er hat keine realistische Alternative dazu.

Verantwortlichkeiten des unabhängigen Abschlussprüfers für die Prüfung der Jahresabschlüsse

Ziel unserer Prüfung ist es, mit hinreichender Sicherheit zu beurteilen, ob der Jahresabschluss insgesamt frei von wesentlichen Fehldarstellungen, sei es aufgrund beabsichtigter oder unbeabsichtigter Fehler, ist, und einen Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers zu erstellen, der unser Prüfungsurteil enthält. Eine hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, gleichwohl aber keine Garantie dafür, dass eine gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg angenommenen ISA durchgeführte Prüfung stets jede vorliegende wesentliche Fehldarstellung aufdeckt. Fehldarstellungen können beabsichtigt oder unbeabsichtigt sein und sind als wesentlich anzusehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass sie einzeln oder in ihrer Gesamtheit die wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern, die auf der Grundlage dieser Abschlüsse getroffen werden, beeinflussen können.

Im Rahmen einer Prüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg verabschiedeten ISA üben wir während der gesamten Prüfung ein pflichtgemäßes Ermessen aus und behalten eine kritische Grundhaltung bei. Ferner unternehmen wir Folgendes:

- Ermittlung und Beurteilung der Risiken wesentlicher Fehldarstellungen des Jahresabschlusses, sei es aufgrund beabsichtigter oder unbeabsichtigter Fehler, Planung und Durchführung von Prüfverfahren, die diesen Risiken Rechnung tragen, und Erlangung von Prüfungsnachweisen, die ausreichend und angemessen sind, um eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu bilden. Das Risiko, eine wesentliche Fehldarstellung aufgrund beabsichtigter Fehler nicht aufzudecken, ist höher als dasjenige, das sich aus einem unbeabsichtigten Fehler ergibt, da beabsichtigte Fehler mit betrügerischen Absprachen, Fälschungen, absichtlichen Unterlassungen, Falschdarstellungen oder der Außerkraftsetzung der internen Kontrolle einhergehen können.

- Erlangung eines Verständnisses der für die Prüfung relevanten internen Kontrollen, um Prüfverfahren zu entwickeln, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht, um ein Urteil über die Wirksamkeit der internen Kontrolle der Gesellschaft abzugeben.
- Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden und der Angemessenheit der vom Verwaltungsrat der Gesellschaft vorgenommenen Schätzungen und diesbezüglichen Angaben;
- Feststellung, ob die Anwendung der Fortführungsgrundsätze der Rechnungslegung durch den Verwaltungsrat der Gesellschaft angemessen ist, und, anhand der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Bedingungen besteht, die erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft zur Fortführung aufkommen lassen können. Falls wir zu dem Schluss gelangen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers auf die dazugehörigen Angaben im Jahresabschluss aufmerksam zu machen oder, wenn diese Angaben nicht ausreichen, unser Prüfungsurteil zu ändern. Unsere Feststellungen beruhen auf den Prüfungsnachweisen, die wir bis zum Datum unseres Berichts des unabhängigen Abschlussprüfers erhalten haben. Zukünftige Ereignisse oder Bedingungen können jedoch dazu führen, dass die Gesellschaft nicht mehr fortgeführt wird.
- Beurteilung der Gesamtdarstellung, der Struktur und des Inhalts des Jahresabschlusses einschließlich der Angaben sowie der Frage, ob der Abschluss die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt wird.

Wir stehen mit den für die Verwaltung Verantwortlichen in Kontakt, u. a. in Bezug auf den geplanten Umfang und den Zeitpunkt der Prüfung sowie in Bezug auf wesentliche Prüfungsfeststellungen, einschließlich aller wesentlichen Mängel in der internen Kontrolle, die wir im Rahmen unserer Prüfung feststellen.

Für Deloitte Audit, *Cabinet de révision agréé*

Justin Griffiths, *Réviseur d'entreprises agréé*
Partner

27. September 2022

Anhang I – Anteilklassen (ungeprüft)

Bestehende Anteilklassen

Zum 31. Mai 2022 bietet die Gesellschaft folgende Anteilklassen an.

Klasse A

Auf CHF lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A
Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse A
Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A
Auf USD lautender Ausschüttungsanteil der Klasse A
Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A
Auf AUD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status
Auf CAD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status
Auf CNH lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status
Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status
Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status
Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status
Auf HKD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status
Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status
Auf USD lautender Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status
Auf AUD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A
Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A
Auf CNH-Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A
Auf CZK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A
Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A
Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A
Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A
Auf HKD-Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A
Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A
Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A
Auf SGD-Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A
Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A
Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A
Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status
Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status
Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status
Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status
Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status
Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status

Klasse AI¹

Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse AI
Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse AI
Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse AI

Klasse C¹

Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse C

Klasse D¹

Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil (G) der Klasse D
Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse D
Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D
Auf USD lautender Ausschüttungsanteil der Klasse D
Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D
Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status

Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status
Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status
Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status
Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status
Auf USD lautender Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status
Auf USD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status
Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D
Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D
Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D
Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D
Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D
Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D
Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D
Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status
Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status
Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status
Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status
Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status
Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status
Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status

Klasse E¹

Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse E
Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse E
Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E
Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E
Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E

Klasse I^{1, 2}

Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil (G) der Klasse I
Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse I
Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I
Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status
Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status
Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status
Auf USD lautender Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status
Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil PF der Klasse I
Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil PF der Klasse I
Auf BRL lautender thesaurierender Anteil der Klasse I
Auf BRL lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I
Auf CAD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I
Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I
Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I
Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I
Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I
Auf JPY lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I
Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I
Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I
Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I
Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I
Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status

Anhang I – Anteilklassen (ungeprüft) Fortsetzung

Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status
 Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status
 Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status
 Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status
 Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status
 Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status
 Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status

Klasse IA^{1, 2}

Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse IA
 Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse IA

Klasse IndexInvest Balance¹

Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Balance
 Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Chance
 Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Substanz
 IndexInvest Wachstum, auf CHF lautender, abgesicherter ausschüttender Anteil
 Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Wachstum

Klasse J²

Auf USD lautender Ausschüttungsanteil der Klasse J

Klasse S¹

Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse S
 Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S
 Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse S
 Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S
 Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status
 Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status
 Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status
 Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status
 Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status

Vermögensstrategie Klasse¹

Vermögensstrategie Ausgewogen auf EUR lautender ausschüttender Anteil
 Vermögensstrategie Defensiv auf EUR lautender ausschüttender Anteil
 Vermögensstrategie Moderat - Ausgewogen auf EUR lautender ausschüttender Anteil
 Vermögensstrategie Wachstum auf EUR lautender ausschüttender Anteil

Klasse X²

Auf EUR lautender ausschüttender (G) Anteil der Klasse X
 Auf EUR lautender Ausschüttungsanteil der Klasse X
 Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X
 Auf CAD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X
 Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X
 Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X
 Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X
 Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X
 Auf JPY lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X
 Auf NZD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X
 Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X
 Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X
 Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status
 Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status
 Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status
 Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status

Klasse Z¹

Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z
 Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse Z
 Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z
 Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse Z
 Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse Z
 Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status
 Auf GBP lautender Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status
 Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status
 Auf USD lautender Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status
 Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund Status

⁽¹⁾ Nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft verfügbar.

⁽²⁾ Für institutionelle Anleger verfügbar.

Auflegung von Anteilklassen

Die angegebenen Daten sind die Auflegungs- und Wiedereröffnungsdaten, wobei die genannten Anteilklassen erst zu einem späteren Zeitpunkt zur Zeichnung bereitstehen können.

| Datum des Inkrafttretens | Fonds | Typ |
|--------------------------|---|--|
| 28. Juli 2021 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status |
| 8. September 2021 | BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X |
| 29. September 2021 | BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund | Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A |
| 29. September 2021 | BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund | Auf SEK lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I |
| 10. November 2021 | BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D |
| 22. Dezember 2021 | BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | Auf JPY lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I |
| 22. Dezember 2021 | BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | Auf JPY lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I |
| 22. Dezember 2021 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf CHF lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A |
| 22. Dezember 2021 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A |
| 22. Dezember 2021 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A |
| 22. Dezember 2021 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status |

Anhang I – Anteilklassen (ungeprüft) Fortsetzung

| Datum des Inkrafttretens | Fonds | Typ |
|--------------------------|--|--|
| 22. Dezember 2021 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf CHF lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status |
| 22. Dezember 2021 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status |
| 22. Dezember 2021 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S mit UK Reporting Fund Status |
| 29. Dezember 2021 | BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X mit UK Reporting Fund Status |
| 23. Februar 2022 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf EUR lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I |
| 23. März 2022 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf AUD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status |
| 23. März 2022 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf CAD lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status |
| 23. März 2022 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf CNH lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status |
| 13. April 2022 | BlackRock Fixed Income Strategies Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse S |
| 13. April 2022 | BlackRock Fixed Income Strategies Fund | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse S |

Geschlossene Anteilklassen

| Datum des Inkrafttretens | Fonds | Typ |
|--------------------------|---|---|
| 24. August 2021 | BlackRock Total Advantage Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse A |
| 24. August 2021 | BlackRock Total Advantage Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse D |
| 24. August 2021 | BlackRock Total Advantage Fund | Auf USD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D |
| 24. August 2021 | BlackRock Total Advantage Fund | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status |
| 24. August 2021 | BlackRock Total Advantage Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse E |
| 24. August 2021 | BlackRock Total Advantage Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse I |
| 24. August 2021 | BlackRock Total Advantage Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse X |
| 6. Mai 2022 | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund | Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse A mit UK Reporting Fund Status |
| 6. Mai 2022 | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse A |
| 6. Mai 2022 | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse A |
| 6. Mai 2022 | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund | Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status |
| 6. Mai 2022 | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status |
| 6. Mai 2022 | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D mit UK Reporting Fund Status |
| 6. Mai 2022 | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse E |
| 6. Mai 2022 | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund | Auf GBP lautender Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status |
| 6. Mai 2022 | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund | Auf GBP lautender Hedged Ausschüttungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status |
| 6. Mai 2022 | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I |
| 6. Mai 2022 | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I |
| 6. Mai 2022 | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse I mit UK Reporting Fund Status |
| 6. Mai 2022 | BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse X |
| 10. Mai 2022 | BlackRock Style Advantage Screened Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse A |
| 10. Mai 2022 | BlackRock Style Advantage Screened Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse D |
| 10. Mai 2022 | BlackRock Style Advantage Screened Fund | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D |
| 10. Mai 2022 | BlackRock Style Advantage Screened Fund | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse D |
| 10. Mai 2022 | BlackRock Style Advantage Screened Fund | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse E |
| 10. Mai 2022 | BlackRock Style Advantage Screened Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse I |
| 10. Mai 2022 | BlackRock Style Advantage Screened Fund | Auf EUR lautender Akkumulierungsanteil der Klasse I |
| 10. Mai 2022 | BlackRock Style Advantage Screened Fund | Auf EUR lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I |
| 10. Mai 2022 | BlackRock Style Advantage Screened Fund | Auf GBP lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse I |
| 10. Mai 2022 | BlackRock Style Advantage Screened Fund | Akkumulierungsanteil der Klasse X |
| 10. Mai 2022 | BlackRock Style Advantage Screened Fund | Auf AUD lautender Hedged Akkumulierungsanteil der Klasse X |

Anhang II – Globales Marktrisiko (ungeprüft)

Gesamtengagement

Gemäß der aktuellen Anlagepolitik von BlackRock wird das Gesamtengagement anhand des „Commitment-Ansatzes“ oder der Value-at-Risk-Methode („VaR“-Methode) gemessen, die sämtliche Bestandteile des Portfolios berücksichtigt.

Der Commitment-Ansatz ist ein Verfahren, bei dem die zugrunde liegenden Markt- oder Nennwerte der Finanzderivate zusammengefasst werden, um das Gesamtrisiko eines Fonds aus Finanzderivaten zu bestimmen.

Gemäß dem Gesetz von 2010 darf bei einem Fonds, der den Commitment-Ansatz anwendet, das Gesamtmarktrisiko 100 % des Nettovermögens dieses Fonds nicht übersteigen.

Folgende Fonds wenden den Commitment-Ansatz an:

- BlackRock European Unconstrained Equity Fund
- BlackRock Global Real Asset Securities Fund
- BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative
- BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive
- BlackRock Managed Index Portfolios – Growth
- BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate
- BlackRock Systematic ESG World Equity Fund
- BlackRock Systematic Global Equity Fund

VaR ist eine statistische Maßzahl für das Risiko, mit der die möglichen Verluste als Folge negativer Marktbewegungen in einem normalen Marktumfeld geschätzt werden.

Die VaR-Berechnungen für die BlackRock Strategic Funds basieren mit Ausnahme des BlackRock Global Event Driven Funds auf einem bereinigten historischen Simulationsmodell. Das für den BlackRock Global Event Driven Fund verwendete VaR-Modell ist ein Monte Carlo-Simulationsmodell. Beide Modelle verwenden einem Konfidenzniveau von 99 %, eine Haltedauer von einem Tag und einen historischen Beobachtungszeitraum von mindestens einem Jahr (250 Tage). Der VaR-Wert wird anhand einer gegebenen Wahrscheinlichkeit und eines gegebenen Zeithorizonts ermittelt. Ein VaR von 99 % für 1 Tag bedeutet, dass angenommen wird, dass in 99 % der Zeit über den Zeitraum eines Tages der Fonds höchstens diesen Wert, als Prozentsatz angegeben, verlieren wird. Höhere VaR-Werte deuten daher auf ein höheres Risiko hin.

Das VaR-Modell, das bei der „Risk & Quantitative Analysis (RQA)“ von BlackRock verwendet wird, ist ein bereinigtes historisches Simulationsmodell.

Für die Fonds, die einen relativen VaR-Ansatz verwenden, erstellt die Abteilung RQA ein Referenzportfolio als Grundlage für die vergleichende VaR-Berechnung. Dabei entspricht das Referenzportfolio im Allgemeinen dem Vergleichsindex, der auch als Vergleichsmaßstab für die Wertentwicklung des entsprechenden Fonds herangezogen wird. Dieser Vergleichsindex (oder ein aus verschiedenen Teilindizes zusammengesetzter Vergleichsindex) wird von einem anerkannten Indexanbieter aus Wertpapieren zusammengestellt, in die die Fonds gemäß ihrer Anlagerichtlinien anlegen dürfen. Mit dieser Vorgehensweise wird die Verfügbarkeit von Indizes mit entsprechenden Indexregeln sichergestellt, die ihrerseits Diversifizierungsregeln einhalten.

Bei Fonds, die anhand der VaR-Methode überwacht werden, beobachten die Anlageberater die Einhaltung der aufsichtsrechtlich vorgegebenen Grenzen und aller internen, für den Fonds angemessen erscheinenden Risikogrenzen.

In der folgenden Tabelle ist die höchste, niedrigste und durchschnittliche Ausnutzung der VaR-Grenzen in Prozent der jeweiligen absoluten oder relativen VaR-Grenze der Regulierungsbehörde angegeben. Für die Fonds, die einen relativen VaR-Ansatz verwenden, darf der VaR des entsprechenden Fondsportfolios das Doppelte des VaR des Referenzportfolios nicht übersteigen. Die angegebene Ausnutzung bezieht sich auf das in diesem Kontext eingegangene Risikoniveau.

| Fonds | Gesamt- risikoansatz | Referenzportfolio | Höchste | Niedrigste | Durchsch- |
|--|-------------------------|-------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|--|
| | | | Ausnutzung der VaR- Grenze in % | Ausnutzung der VaR- Grenze in % | nittliche Ausnutzung der VaR- Grenze in % |
| BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 36,67 % | 15,21 % | 26,29 % |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 28,40 % | 16,99 % | 22,83 % |
| BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 29,25 % | 20,80 % | 25,12 % |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 29,52 % | 13,53 % | 20,31 % |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 67,98 % | 28,62 % | 49,70 % |
| BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | Absoluter VaR | Entfällt | 70,21 % | 0,67 % | 36,72 % |

Anhang II – Globales Marktrisiko (ungeprüft) Fortsetzung

| Fonds | Gesamt- risikoansatz | Referenzportfolio | Höchste Ausnutzung der VaR- Grenze in % | Niedrigste Ausnutzung der VaR- Grenze in % | Durchsch- nittliche Ausnutzung der VaR- Grenze in % |
|--|-------------------------|-----------------------------|--|---|---|
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | Relativer VaR | MSCI Emerging Markets Index | 70,79 % | 45,96 % | 52,33 % |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 41,59 % | 16,77 % | 26,22 % |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 38,91 % | 6,04 % | 17,31 % |
| | | Bloomberg Barclays MSCI | | | |
| | | Euro Aggregate Sustainable | | | |
| BlackRock ESG Euro Bond Fund | Relativer VaR | SRI Index | 50,27 % | 42,22 % | 47,09 % |
| | | Bloomberg Barclays MSCI | | | |
| | | Euro Corporate Sustainable | | | |
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund | Relativer VaR | SRI Index | 61,56 % | 43,75 % | 49,22 % |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 6,71 % | 1,08 % | 2,95 % |
| BlackRock European Absolute Return Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 37,12 % | 22,14 % | 28,75 % |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | Relativer VaR | S&P Europe BMI Index | 90,00 % | 49,96 % | 64,56 % |
| | | 75% Barclays Pan European | | | |
| | | Aggregate Index (Hedged | | | |
| | | EUR) / 25% MSCI Europe | | | |
| | | Index (Hedged EUR) | | | |
| BlackRock European Select Strategies Fund | Relativer VaR | Index (Hedged EUR) | 72,21 % | 47,46 % | 53,54 % |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 20,57 % | 2,36 % | 7,57 % |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 18,56 % | 3,89 % | 8,52 % |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 14,09 % | 6,04 % | 9,16 % |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 40,03 % | 21,47 % | 28,58 % |
| BlackRock Global Event Driven Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 43,84 % | 14,48 % | 21,08 % |
| BlackRock Style Advantage Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 34,44 % | 18,25 % | 24,85 % |
| BlackRock Style Advantage Screened Fund ⁽¹⁾ | Absoluter VaR | Entfällt | 33,32 % | 0,89 % | 21,16 % |
| BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 38,68 % | 10,06 % | 20,93 % |
| BlackRock Total Advantage Fund ⁽¹⁾ | Absoluter VaR | Entfällt | 25,27 % | 0,26 % | 18,90 % |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 31,08 % | 14,76 % | 19,56 % |

⁽¹⁾ Der Fonds wurde aufgelöst, Näheres hierzu siehe Anmerkung 1.

Leverage

Durch den Einsatz von Derivaten können Fonds höheren Risiken ausgesetzt sein. So können insbesondere Derivatekontrakte hohen Schwankungen unterliegen, und der Anfangseinschuss ist in der Regel im Vergleich zum Kontraktvolumen gering, sodass das Marktrisiko der Transaktionen gehebelt sein kann. Vergleichsweise geringe Marktbewegungen können deutlich stärkere Auswirkungen auf Derivate als auf herkömmliche Anleihen oder Aktien haben. Gehebelte Derivatepositionen können daher die Volatilität innerhalb der Fonds verstärken.

Im Sinne dieses Hinweises bezeichnet Leverage das Anlageengagement, das über den Einsatz von Finanzderivaten erzielt wird. Berechnet wird die Leverage als Summe der rechnerischen Werte aller vom betreffenden Fonds gehaltenen Finanzderivate, ohne Netting, und wird als Prozentsatz des NIW ausgedrückt.

In der folgenden Tabelle wird die Höhe des Leverage während des Berichtsjahres für die entsprechenden Fonds angegeben.

| Fonds | % Durchschnittliches Leverage |
|--|-------------------------------|
| BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund | 690,90 % |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | 89,45 % |
| BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund | 454,97 % |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | 111,37 % |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | 173,86 % |
| BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | 72,86 % |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | 76,93 % |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | 600,14 % |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | 114,90 % |
| BlackRock ESG Euro Bond Fund | 105,47 % |
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund | 48,06 % |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund | 136,61 % |
| BlackRock European Absolute Return Fund | 76,41 % |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | 77,40 % |
| BlackRock European Select Strategies Fund | 161,69 % |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund | 154,69 % |

Anhang II – Globales Marktrisiko (ungeprüft) Fortsetzung

| Fonds | % Durchschnittliches Leverage |
|--|--------------------------------------|
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund | 564,81 % |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | 902,73 % |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | 160,75 % |
| BlackRock Global Event Driven Fund | 89,39 % |
| BlackRock Style Advantage Fund | 1.092,55 % |
| BlackRock Style Advantage Screened Fund ⁽¹⁾ | 813,00 % |
| BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund | 481,18 % |
| BlackRock Total Advantage Fund ⁽¹⁾ | 768,22 % |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | 135,53 % |

⁽¹⁾ Der Fonds wurde aufgelöst, Näheres hierzu siehe Anmerkung 1.

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)

Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung

Die Gesellschaft kann im Namen jedes Fonds und vorbehaltlich der durch die CSSF und im Prospekt festgelegten Bedingungen und Grenzen Techniken und Instrumente bezüglich Wertpapiere einschließlich Investitionen in derivativen OTC-Finanzinstrumenten („FDI“, Financial Derivative Instruments) einsetzen, sofern diese Techniken und Instrumente für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung oder gegebenenfalls für Direktanlagezwecke eingesetzt werden oder um Schutz vor dem Wechselkursrisiko zu bieten.

Wertpapierleihe und Total Return Swaps (einschließlich CFDs)

Sämtliche von den Fonds eingegangene Wertpapierleihtransaktionen unterliegen einer schriftlichen, rechtsverbindlichen Vereinbarung zwischen den Fonds und der Wertpapierleihstelle, BlackRock Advisors (UK) Limited, ein verbundenes Unternehmen der Gesellschaft, sowie einer gesonderten Vereinbarung zwischen der Wertpapierleihstelle und der genehmigten entleihenden Gegenpartei. Im Austausch für entlehene Wertpapiere erhaltene Sicherheiten werden im Rahmen einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung auf ein Konto bei einem dritten Sicherheitenverwalter im Namen der Verwahrstelle im Auftrag der Fonds übertragen und dort gehalten. Die entgegengenommenen Sicherheiten werden von dem Vermögen der Verwahrstelle oder der Wertpapierleihstelle getrennt gehalten.

Sämtliche Geschäfte mit TRS (einschließlich CFDs) gehen die Fonds gemäß einer Mastervereinbarung der International Swaps and Derivatives Associations, Inc. („ISDA-Mastervereinbarung“) oder einer ähnlichen Vereinbarung ein. Eine ISDA-Mastervereinbarung ist eine zweiseitige Vereinbarung zwischen den Fonds und einem Kontrahenten, welche OTC-FDI-Transaktionen (einschließlich TRS und CFDs) regelt, die die Parteien eingehen. Die Exposures der Parteien gemäß der ISDA-Master-Vereinbarung werden saldiert und gemeinsam besichert. Daher beziehen sich alle Angaben zu Sicherheiten in diesem Bericht auf alle OTC-FDIs, welche die Fonds gemäß der ISDA-Master-Vereinbarung eingehen, und nicht nur auf TRS und CFDs. Sämtliche von den Fonds gemäß der ISDA Master-Vereinbarung unbar erhaltenen/gestellten Sicherheiten werden gemäß einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung bilateral übertragen.

Die nachstehende Tabelle zeigt die Werte der Sicherheiten auf Darlehen als Anteil an den gesamten verleihbaren Vermögenswerten und am NIW des Fonds sowie den Wert der TRS (einschließlich CFDs) als Anteil am NIW des Fonds zum 31. Mai 2022 und die Einkünfte/Erträge für das Jahr bis zum 31. Mai 2022. Die gesamten verleihbaren Vermögenswerte stellen den Gesamtwert der Vermögenswerte dar, die Teil des Wertpapierleiheprogramms der Fonds sind. Der Wert der TRS (einschließlich CFDs) basiert auf dem zugrunde liegenden Forderungswert auf absoluter Bruttowertbasis.

| Fonds | Währung | Verleihte Wertpapiere | | TRS (einschließlich CFDs) | |
|--|---------|-----------------------------------|-----------|--|------------------------------|
| | | % der verleihbaren Vermögenswerte | % des NIW | % der verleihbaren Vermögenswerte 31. Mai 2022 | Erwirtschaftete Nettoerträge |
| BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund | USD | Entfällt | Entfällt | 756,10 % | 65.529.163 |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | USD | 5,78 % | 1,84 % | 61,39 % | 6.945.620 |
| BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund | USD | Entfällt | Entfällt | 470,44 % | (197.107) |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | EUR | 10,67 % | 3,46 % | 7,15 % | (8.428.682) |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | GBP | Entfällt | Entfällt | 107,44 % | (51.105.817) |
| BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund | USD | Entfällt | Entfällt | Entfällt | 1.448.344 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | USD | 10,25 % | 4,70 % | 75,51 % | (1.437.037) |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | USD | 19,81 % | 13,07 % | Entfällt | N/A |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | USD | 21,73 % | 16,08 % | Entfällt | N/A |
| BlackRock ESG Euro Bond Fund | EUR | 5,91 % | 5,14 % | Entfällt | N/A |
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund | EUR | 11,37 % | 10,02 % | Entfällt | N/A |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund | EUR | 2,14 % | 1,85 % | Entfällt | N/A |
| BlackRock European Absolute Return Fund | EUR | 8,15 % | 1,74 % | 65,83 % | 70.380.849 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | EUR | 3,67 % | 3,36 % | 54,31 % | 25.831.734 |
| BlackRock European Select Strategies Fund | EUR | 11,25 % | 8,31 % | 1,36 % | 429.981 |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund | EUR | 11,70 % | 10,11 % | 0,16 % | 49.214 |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund | EUR | 8,82 % | 6,09 % | 0,35 % | 567.757 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | EUR | 3,88 % | 2,22 % | 4,66 % | (35.859) |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | USD | Entfällt | Entfällt | 52,26 % | 1.896.187 |
| BlackRock Global Event Driven Fund | USD | 7,82 % | 2,46 % | 74,36 % | 51.988.622 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | USD | 8,56 % | 7,30 % | 1,17 % | 440.795 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | EUR | 2,19 % | 1,97 % | Entfällt | N/A |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | EUR | 3,58 % | 3,30 % | Entfällt | N/A |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | EUR | 0,18 % | 0,14 % | Entfällt | N/A |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | EUR | 2,04 % | 1,86 % | Entfällt | N/A |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Fonds | Währung | Verleihte Wertpapiere | | TRS (einschließlich CFDs) | |
|--|---------|-----------------------------------|-----------|--|------------------------------|
| | | % der verleihbaren Vermögenswerte | % des NIW | % der verleihbaren Vermögenswerte 31. Mai 2022 | Erwirtschaftete Nettoerträge |
| BlackRock Style Advantage Fund | USD | Entfällt | Entfällt | 218,12% | 13.583.115 |
| BlackRock Style Advantage Screened Fund | USD | Entfällt | Entfällt | Entfällt | 1.810.577 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | USD | 6,28 % | 5,94 % | Entfällt | N/A |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund | USD | 5,76 % | 5,17 % | Entfällt | N/A |
| BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund | USD | Entfällt | Entfällt | 367,48 % | (1.714.126) |
| BlackRock Total Advantage Fund | EUR | Entfällt | Entfällt | Entfällt | 268.851 |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | GBP | Entfällt | Entfällt | 101,37 % | 23.574.691 |

Der Gesamtertrag aus Wertpapierleihgeschäften wird zwischen dem betreffenden Fonds und der Wertpapierleihstelle aufgeteilt. Der Fonds erhält dabei mindestens 62,5 %, während die Wertpapierleihstelle bis zu 37,5 % dieses Ertrags erhält, wobei sämtliche operativen Kosten aus dem Anteil des Vermittlers für die Wertpapierleihe getragen werden. Die im Geschäftsjahr aus Wertpapierleihtransaktionen erzielten Erträge werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Nettofondsvermögen unter der Rubrik „Wertpapierleihe“ ausgewiesen. Die aus Total Return Swaps (einschließlich CFDs) erzielten Gesamterträge werden auf der Grundlage der Gesamterträge dargestellt, einschließlich der damit verbundenen Zins- und Dividendenerträge oder -aufwendungen und Nettogewinne/-verluste aus Preisbewegungen des beizulegenden Zeitwerts. Sämtliche Erträge und Kosten aus TRS (einschließlich CFDs) fließen an die Fonds und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Aufteilung von Erträgen mit der Verwaltungsgesellschaft des Fonds oder Dritten.

Die folgende Tabelle gibt den Wert der verliehenen Wertpapiere (einzeln im Anlageportfolio der entsprechenden Fonds aufgeführt) und der damit verbundenen erhaltenen Sicherheiten sowie den von der Gegenpartei analysierten zugrunde liegenden Wert des Exposures auf einer absoluten Bruttobasis für TRS (einschließlich CFDs) zum 31. Mai 2022 wieder.

| Gegenpartei | Niederlassungsland der Gegenpartei | Wertpapierleihe | | Zugrunde liegendes Exposure 31. Mai 2022 | TRS (einschließlich CFDs) |
|--|------------------------------------|--------------------|------------------------|--|---------------------------|
| | | Verliehener Betrag | Erhaltene Sicherheiten | | |
| BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | | |
| Bank of America NA | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 466.798.759 | |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 1.839.088.023 | |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 1.742.998.367 | |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 1.176.947.870 | |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 711.388.715 | |
| Gesamt | | Entfällt | Entfällt | 5.937.221.734 | |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (in USD) | | | | | |
| Bank of America NA | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 9.336.146 | |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | 653.495 | 833.006 | N/A | |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 11.266.211 | |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 10.112.248 | |
| Societe Generale SA | Frankreich | 264.768 | 397.180 | N/A | |
| Gesamt | | 918.263 | 1.230.186 | 30.714.605 | |
| BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | | |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 61.509.627 | |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 28.790.308 | |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 71.724.177 | |
| Gesamt | | Entfällt | Entfällt | 162.024.112 | |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (in EUR) | | | | | |
| Bank of America NA | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 11.680.329 | |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 21.072.965 | 22.658.099 | 20.121.114 | |
| BNP Paribas Arbitrage SNC | Frankreich | 4.659.500 | 5.131.533 | N/A | |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 37.125.395 | |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 790.126 | 863.704 | 11.846.394 | |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | 164.208 | 174.412 | N/A | |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 4.004.528 | 4.749.135 | N/A | |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | 679.058 | 749.133 | N/A | |
| UBS AG | Schweiz | 7.326.656 | 8.447.177 | N/A | |
| Macquarie Bank Ltd | Australien | 373.473 | 457.377 | N/A | |
| Gesamt | | 39.070.514 | 43.230.570 | 80.773.232 | |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Gegenpartei | Niederlassungsland der Gegenpartei | Wertpapierleihe | | TRS (einschließlich CFDs) |
|---|------------------------------------|--------------------|------------------------|---|
| | | Verliehener Betrag | Erhaltene Sicherheiten | Zugrunde liegendes Exposure 31. Mai 2022 |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund (in GBP) | | | | |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 260.851.605 |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 216.354.486 |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 166.695.951 |
| Gesamt | | Entfällt | Entfällt | 643.902.042 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (in USD) | | | | |
| Bank of America NA | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 82.878.979 |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 1.802.707 | 1.938.309 | N/A |
| BNP Paribas | Frankreich | Entfällt | Entfällt | 20.950.025 |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 38.869.496 |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 5.105.105 | 5.580.514 | 35.585.340 |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 86.055.957 |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 2.129.776 | 2.525.790 | N/A |
| Macquarie Bank Ltd | Australien | 5.036.808 | 6.168.363 | N/A |
| UBS AG | Schweiz | 2.686.764 | 3.097.673 | 4.733.003 |
| Gesamt | | 16.761.160 | 19.310.649 | 269.072.800 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (in USD) | | | | |
| Banco Santander SA | Spanien | 99.047.012 | 108.680.253 | N/A |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 24.685.879 | 28.193.122 | N/A |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 1.751.801 | 1.828.047 | N/A |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | 6.449.207 | 6.655.679 | N/A |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 2.279.445 | 2.416.812 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 3.788.380 | 4.069.652 | N/A |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | 243.068 | 253.551 | N/A |
| Nomura International Plc | Großbritannien | 10.463.428 | 10.918.324 | N/A |
| Zürcher Kantonalbank | Schweiz | Entfällt | 199.955 | N/A |
| Gesamt | | 148.708.220 | 163.215.395 | N/A |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (in USD) | | | | |
| Banco Santander SA | Spanien | 6.459.943 | 7.088.231 | N/A |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 6.712.300 | 7.488.969 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 2.126.802 | 2.305.408 | N/A |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | 181.765 | 189.604 | N/A |
| Gesamt | | 15.480.810 | 17.072.212 | N/A |
| BlackRock ESG Euro Bond Fund (in EUR) | | | | |
| Banco Santander SA | Spanien | 619.698 | 681.953 | N/A |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 7.956.928 | 8.236.751 | N/A |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | 2.551.157 | 2.637.628 | N/A |
| Deutsche Bank AG | Deutschland | 1.233.880 | 1.292.461 | N/A |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 2.593.571 | 2.749.867 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 6.000.967 | 6.517.025 | N/A |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | 4.318.968 | 4.535.587 | N/A |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | 1.338.774 | 1.551.246 | N/A |
| Gesamt | | 26.613.943 | 28.202.518 | N/A |
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund (in EUR) | | | | |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 2.616.288 | 2.756.567 | N/A |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 3.025.313 | 3.156.989 | N/A |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | 831.335 | 857.950 | N/A |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 12.338.106 | 13.081.638 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 5.106.041 | 5.715.203 | N/A |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | 1.649.281 | 1.720.409 | N/A |
| Societe Generale SA | Frankreich | 299.573 | 323.569 | N/A |
| Gesamt | | 25.865.937 | 27.612.325 | N/A |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund (in EUR) | | | | |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 474.965 | 500.431 | N/A |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 1.694.539 | 1.757.632 | N/A |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | 184.529 | 206.579 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 588.771 | 631.967 | N/A |
| Gesamt | | 2.942.804 | 3.096.609 | N/A |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Gegenpartei | Niederlassungsland der Gegenpartei | Wertpapierleihe | | TRS (einschließlich CFDs) |
|---|------------------------------------|--------------------|------------------------|---|
| | | Verliehener Betrag | Erhaltene Sicherheiten | Zugrunde liegendes Exposure 31. Mai 2022 |
| BlackRock European Absolute Return Fund (in EUR) | | | | |
| Bank of America NA | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 311.929.755 |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 11.454.023 | 12.315.607 | 84.388.195 |
| BNP Paribas Arbitrage SNC | Frankreich | 15.140.634 | 16.674.466 | 67.071.801 |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 279.419.213 |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 264.380.927 |
| Gesamt | | 26.594.657 | 28.990.073 | 1.007.189.891 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund (in EUR) | | | | |
| Bank of America NA | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 129.047.971 |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 9.889.762 | 10.633.680 | 41.522.047 |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 73.823.677 |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 3.857.780 | 4.217.030 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 83.848.254 |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | 5.345.139 | 5.672.674 | N/A |
| Societe Generale SA | Frankreich | 1.185.378 | 1.778.191 | N/A |
| Gesamt | | 20.278.059 | 22.301.575 | 328.241.949 |
| BlackRock European Select Strategies Fund (in EUR) | | | | |
| Bank of America NA | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 5.177.118 |
| Banco Santander S.A. | Spanien | 265.375 | 387.807 | N/A |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 455.502 | 688.411 | N/A |
| BNP Paribas Arbitrage SNC | Frankreich | 10.549.056 | 11.617.734 | N/A |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 1.359.503 | 1.568.913 | N/A |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | 67.391 | 248.159 | N/A |
| Deutsche Bank AG | Deutschland | 898.619 | 941.282 | N/A |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 3.633.563 | 3.852.531 | N/A |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | 5.057.955 | 5.500.402 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 7.560.931 | 8.416.456 | N/A |
| Nomura International Plc | Großbritannien | 188.184 | 196.365 | N/A |
| Societe Generale SA | Frankreich | 1.284.584 | 1.387.479 | N/A |
| UBS AG | Schweiz | 407.191 | 469.466 | N/A |
| Gesamt | | 31.727.854 | 35.275.005 | 5.177.118 |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund (in EUR) | | | | |
| Bank of America NA | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 602.648 |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 11.343.522 | 12.013.213 | N/A |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 5.841.685 | 6.095.941 | N/A |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | 2.358.131 | 2.433.627 | N/A |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 6.142.012 | 6.512.148 | N/A |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | 1.775.264 | 1.987.391 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 5.099.944 | 5.543.108 | N/A |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | 4.222.532 | 4.404.635 | N/A |
| Credit Suisse International | Schweiz | 398.791 | 436.783 | N/A |
| Gesamt | | 37.181.881 | 39.426.846 | 602.648 |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | | | | |
| Banco Santander SA | Spanien | 11.358.971 | 12.500.067 | N/A |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 53.262.824 | 56.657.835 | N/A |
| BNP Paribas Arbitrage SNC | Frankreich | 5.440.312 | 5.991.446 | N/A |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 20.057.538 | 20.847.121 | 473.308 |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | 21.266.456 | 22.096.781 | N/A |
| Deutsche Bank AG | Deutschland | 16.445.581 | 20.498.742 | N/A |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 25.755.469 | 27.307.563 | 7.400.648 |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | 6.032.124 | 6.750.875 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 29.755.263 | 32.367.081 | 7.508.411 |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | 58.151.688 | 60.662.633 | N/A |
| RBC Europe Limited | Großbritannien | 6.862.119 | 7.699.716 | N/A |
| UBS AG | Schweiz | 1.488.609 | 1.588.830 | N/A |
| Zürcher Kantonalbank | Schweiz | 6.716.433 | 7.315.424 | N/A |
| Credit Suisse International | Schweiz | 1.609.775 | 1.763.135 | N/A |
| Gesamt | | 264.203.162 | 284.047.249 | 15.382.367 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Gegenpartei | Niederlassungsland der Gegenpartei | Wertpapierleihe | | TRS (einschließlich CFDs) |
|--|------------------------------------|--------------------|------------------------|---|
| | | Verliehener Betrag | Erhaltene Sicherheiten | Zugrunde liegendes Exposure 31. Mai 2022 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (in EUR) | | | | |
| BNP Paribas Arbitrage SNC | Frankreich | 1.303.422 | 1.435.467 | N/A |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 261.970 | 273.372 | 3.389.768 |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | 1.272.777 | 1.348.912 | N/A |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 3.846.400 |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 292.132 | 322.969 | N/A |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | 320.778 | 334.612 | N/A |
| Gesamt | | 3.451.079 | 3.715.332 | 7.236.168 |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 12.223.117 |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 10.888.550 |
| UBS AG | Schweiz | Entfällt | Entfällt | 11.386.275 |
| Gesamt | | Entfällt | Entfällt | 34.497.942 |
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | | | | |
| Bank of America NA | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 87.537.725 |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 72.387.417 | 89.465.211 | 555.726.366 |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 7.816.737 | 8.156.957 | 147.755.237 |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | 149.274 | 190.279 | 295.237.912 |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 9.220.807 | 9.821.278 | 643.549.445 |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | 2.188.212 | 2.324.190 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 1.341.686.092 |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | 366.961 | 389.447 | 1.024.576.590 |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | 9.167.042 | 10.113.032 | N/A |
| UBS AG | Schweiz | 34.262.333 | 39.291.402 | 1.102.293 |
| Gesamt | | 135.558.783 | 159.751.796 | 4.097.171.660 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund (in USD) | | | | |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 29.391.207 | 34.098.188 | N/A |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 3.785.329 | 4.137.831 | 9.632.677 |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | 14.794.117 | 15.713.443 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 2.666.561 | 4.551.275 | N/A |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | 2.983.046 | 3.290.881 | N/A |
| UBS AG | Schweiz | 6.584.265 | 7.591.246 | N/A |
| Gesamt | | 60.204.525 | 69.382.864 | 9.632.677 |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Conservative (in EUR) | | | | |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 1.318.436 | 1.417.611 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 509.732 | 604.512 | N/A |
| Gesamt | | 1.828.168 | 2.022.123 | N/A |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Defensive (in EUR) | | | | |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 2.852.164 | 5.343.109 | N/A |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | 168.774 | 179.262 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 2.086.809 | 2.474.833 | N/A |
| Merrill Lynch International | Vereinigte Staaten von Amerika | 103.488 | 114.081 | N/A |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | 691 | 733 | N/A |
| Gesamt | | 5.211.926 | 8.112.018 | N/A |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Growth (in EUR) | | | | |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | Entfällt | 866.785 | N/A |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 631.510 | 690.318 | N/A |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | 4.686 | 4.973 | N/A |
| Gesamt | | 636.196 | 1.562.076 | N/A |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Moderate (in EUR) | | | | |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 13.672.224 | 15.633.749 | N/A |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 867.805 | 948.618 | N/A |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | 4.094 | 4.345 | N/A |
| Gesamt | | 14.544.123 | 16.586.712 | N/A |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Gegenpartei | Niederlassungsland der Gegenpartei | Wertpapierleihe | | TRS (einschließlich CFDs) |
|--|------------------------------------|--------------------|------------------------|---|
| | | Verliehener Betrag | Erhaltene Sicherheiten | Zugrunde liegendes Exposure 31. Mai 2022 |
| BlackRock Style Advantage Fund (in USD) | | | | |
| Bank of America NA | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 45.516.022 |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 48.036.688 |
| BNP Paribas | Frankreich | Entfällt | Entfällt | 72.150.502 |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 11.874.169 |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 48.157.156 |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 24.889.033 |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 13.291.577 |
| Gesamt | | Entfällt | Entfällt | 263.915.147 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (in USD) | | | | |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 2.990.649 | 3.215.609 | N/A |
| BNP Paribas Arbitrage SNC | Frankreich | 1.420.302 | 1.564.186 | N/A |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | 4.491.010 | 5.724.665 | N/A |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 2.592.320 | 2.833.726 | N/A |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | 3.070.024 | 3.260.799 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 2.265.768 | 2.687.068 | N/A |
| Merrill Lynch International | Vereinigte Staaten von Amerika | 1.927.622 | 2.124.932 | N/A |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | 1.093.694 | 1.206.557 | N/A |
| UBS AG | Schweiz | 6.311.032 | 7.276.229 | N/A |
| Gesamt | | 26.162.421 | 29.893.771 | N/A |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund (in USD) | | | | |
| Barclays Bank Plc | Großbritannien | 513.147 | 551.746 | N/A |
| BNP Paribas Arbitrage SNC | Frankreich | 203.421 | 224.029 | N/A |
| Citigroup Global Markets Ltd | Großbritannien | 1.654.667 | 2.109.196 | N/A |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | 1.318.324 | 1.441.091 | N/A |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | 92.250 | 97.983 | N/A |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | 191.789 | 231.799 | N/A |
| Societe Generale SA | Frankreich | 207.822 | 311.755 | N/A |
| UBS AG | Schweiz | 3.318.516 | 3.826.039 | N/A |
| Gesamt | | 7.499.936 | 8.793.638 | N/A |
| BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund (in USD) | | | | |
| Bank of America NA | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 52.881.445 |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 72.899.085 |
| Morgan Stanley Group Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | Entfällt | Entfällt | 67.076.659 |
| Gesamt | | Entfällt | Entfällt | 192.857.189 |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund (in GBP) | | | | |
| BNP Paribas | Frankreich | Entfällt | Entfällt | 2.905.182 |
| HSBC Bank Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 90.785.027 |
| JP Morgan Securities Plc | Großbritannien | Entfällt | Entfällt | 123.221.515 |
| Gesamt | | Entfällt | Entfällt | 216.911.724 |

Alle verliehenen Wertpapiere haben eine offene Laufzeit, da sie täglich zurückgefordert oder gekündigt werden können. Die nachstehende Tabelle enthält eine Analyse der Laufzeit von TRS (einschließlich CFDs) zum 31. Mai 2022:

| | Laufzeit | | | | | | Gesamt |
|--|----------|--------------|---------------|----------------|-----------------|---------------|---------------|
| | 1 Tag | 2 bis 7 Tage | 8 bis 30 Tage | 31 bis 90 Tage | 91 bis 365 Tage | Über 365 Tage | |
| BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | 5.937.221.734 | 5.937.221.734 |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (in USD) | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | 30.714.605 | 30.714.605 |
| BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | 162.024.112 | 162.024.112 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (in EUR) | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | 80.773.232 | - | 80.773.232 |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund (in GBP) | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | 643.902.042 | 643.902.042 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| | Laufzeit | | | | | | | Gesamt |
|--|----------|--------------|---------------|----------------|-----------------|---------------|----------------------|---------------|
| | 1 Tag | 2 bis 7 Tage | 8 bis 30 Tage | 31 bis 90 Tage | 91 bis 365 Tage | Über 365 Tage | Offene Transaktionen | |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 269.072.800 | 269.072.800 |
| BlackRock European Absolute Return Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 1.007.189.891 | 1.007.189.891 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 328.241.949 | 328.241.949 |
| BlackRock European Select Strategies Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 5.177.118 | 5.177.118 |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 602.648 | 602.648 |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | 5.556.759 | 637.971 | 9.187.636 | - | - | 15.382.366 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | 7.236.168 | - | - | - | - | 7.236.168 |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 34.497.942 | 34.497.942 |
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 4.097.171.660 | 4.097.171.660 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 9.632.677 | 9.632.677 |
| BlackRock Style Advantage Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | 22.509.319 | - | - | - | 241.405.828 | 263.915.147 |
| BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 192.857.189 | 192.857.189 |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund (in GBP) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 216.911.724 | 216.911.724 |

Die vorstehende Laufzeitendarstellung basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitsdatum der jeweiligen Transaktion. Offene Transaktionen sind Transaktionen, die täglich zurückgefordert oder gekündigt werden können, und beinhalten CFD.

Sicherheiten

Die Fonds üben Tätigkeiten aus, bei denen gegebenenfalls Sicherheiten von einem Kontrahenten gestellt werden müssen („gestellte Sicherheiten“) oder sie halten gegebenenfalls Sicherheiten, die von einem Kontrahenten entgegengenommen wurden („entgegengenommene Sicherheiten“).

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse nach Währung der von den Fonds mittels einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung erhaltenen/ gestellten Bar- und unbaren Sicherheiten hinsichtlich der Wertpapierleihttransaktionen und OTC-FDIs (einschließlich TRS und CFDs) zum 31. Mai 2022.

| Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten | Entgegen- | Gestellte nicht |
|--|---------------------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | | | genommene unbare Sicherheiten | zahlungswirksame Sicherheiten |
| BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 3.922.000 | 9.930.000 | - | - |
| Gesamt | 3.922.000 | 9.930.000 | - | - |

| Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten | Entgegen- | Gestellte nicht |
|--|---------------------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | | | genommene unbare Sicherheiten | zahlungswirksame Sicherheiten |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 36.344 | - |
| CAD | - | - | 36.345 | - |
| CHF | - | - | 36.645 | - |
| EUR | - | - | 677.077 | - |
| GBP | - | - | 187.098 | - |
| JPY | - | - | 1.163 | - |
| USD | - | - | 255.514 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 1.442.000 | - | - | - |
| Gesamt | 1.442.000 | - | 1.230.186 | - |
| BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 300.000 | 283.000 | - | - |
| Gesamt | 300.000 | 283.000 | - | - |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 2.786.305 | - |
| CHF | - | - | 509.514 | - |
| EUR | - | - | 5.123.160 | - |
| GBP | - | - | 10.939.174 | - |
| JPY | - | - | 11.110.254 | - |
| NOK | - | - | 49.768 | - |
| NZD | - | - | 75.161 | - |
| USD | - | - | 12.637.234 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 980.000 | 6.720.000 | - | - |
| Gesamt | 980.000 | 6.720.000 | 43.230.570 | - |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten | Entgegen-genommene unbare Sicherheiten | Gestellte nicht zahlungs-wirksamei cherheiten |
|---|---------------------------|---------------------------|--|---|
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund (in GBP) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 4.410.000 | 14.440.000 | - | - |
| Gesamt | 4.410.000 | 14.440.000 | - | - |
| BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund (in USD) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 47.000 | - | - |
| Gesamt | - | 47.000 | - | - |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 79.902 | - |
| CHF | - | - | 270.982 | - |
| EUR | - | - | 679.875 | - |
| GBP | - | - | 1.978.925 | - |
| JPY | - | - | 4.411.834 | - |
| NOK | - | - | 4.257 | - |
| NZD | - | - | 6.430 | - |
| USD | - | - | 11.878.444 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 2.300.000 | 16.065.000 | - | - |
| Gesamt | 2.300.000 | 16.065.000 | 19.310.649 | - |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| CAD | - | - | 249.091 | - |
| CHF | - | - | 95.280 | - |
| DKK | - | - | 5.504.545 | - |
| EUR | - | - | 89.577.027 | - |
| GBP | - | - | 39.668.562 | - |
| JPY | - | - | 151.478 | - |
| NOK | - | - | 304.131 | - |
| SEK | - | - | 29.682 | - |
| USD | - | - | 27.635.599 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 3.050.000 | 23.473.000 | - | - |
| Gesamt | 3.050.000 | 23.473.000 | 163.215.395 | - |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| CHF | - | - | 157.415 | - |
| DKK | - | - | 1.195.336 | - |
| EUR | - | - | 7.582.857 | - |
| GBP | - | - | 3.486.304 | - |
| JPY | - | - | 612.338 | - |
| SEK | - | - | 7.885 | - |
| USD | - | - | 4.030.077 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 2.591.000 | - | - |
| Gesamt | - | 2.591.000 | 17.072.212 | - |
| BlackRock ESG Euro Bond Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| CAD | - | - | 283.417 | - |
| CHF | - | - | 233.485 | - |
| DKK | - | - | 1.287.700 | - |
| EUR | - | - | 11.968.142 | - |
| GBP | - | - | 3.141.999 | - |
| JPY | - | - | 2.391.970 | - |
| NOK | - | - | 106.941 | - |
| USD | - | - | 8.788.864 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 1.910.000 | - | - |
| Gesamt | - | 1.910.000 | 28.202.518 | - |

[640] BlackRock Strategic Funds (BSF)

| Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten | Entgegen-genommene unbare Sicherheiten | Gestellte nicht zahlungs-wirksamei cherheiten |
|---|---------------------------|---------------------------|--|---|
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| CAD | - | - | 1.348.270 | - |
| CHF | - | - | 771.061 | - |
| DKK | - | - | 569.477 | - |
| EUR | - | - | 6.998.160 | - |
| GBP | - | - | 3.770.721 | - |
| JPY | - | - | 3.329.981 | - |
| NOK | - | - | 43.926 | - |
| SEK | - | - | 2.902 | - |
| USD | - | - | 10.777.827 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 2.468.000 | - | - |
| Gesamt | - | 2.468.000 | 27.612.325 | - |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 10.888 | - |
| CAD | - | - | 35.594 | - |
| DKK | - | - | 218.716 | - |
| EUR | - | - | 1.535.260 | - |
| GBP | - | - | 428.007 | - |
| NOK | - | - | 837 | - |
| SEK | - | - | 527 | - |
| USD | - | - | 866.780 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 437.000 | - | - |
| Gesamt | - | 437.000 | 3.096.609 | - |
| BlackRock European Absolute Return Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 6.526.510 | - |
| EUR | - | - | 2.388.805 | - |
| GBP | - | - | 6.088.440 | - |
| JPY | - | - | 8.829.989 | - |
| NOK | - | - | 27.051 | - |
| NZD | - | - | 40.853 | - |
| USD | - | - | 5.088.425 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 370.000 | 22.984.000 | - | - |
| Gesamt | 370.000 | 22.984.000 | 28.990.073 | - |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 601.063 | - |
| CAD | - | - | 162.717 | - |
| CHF | - | - | 164.059 | - |
| EUR | - | - | 5.880.758 | - |
| GBP | - | - | 6.939.667 | - |
| JPY | - | - | 405.455 | - |
| NOK | - | - | 23.357 | - |
| NZD | - | - | 35.274 | - |
| USD | - | - | 8.089.225 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 10.404.500 | - | - |
| Gesamt | - | 10.404.500 | 22.301.575 | - |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten | Entgegen- | Gestellte nicht |
|---|---------------------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | | | genommene unbare Sicherheiten | zahlungs-wirksamei cherheiten |
| BlackRock European Select Strategies Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 4.325.385 | - |
| CAD | - | - | 828.067 | - |
| CHF | - | - | 509.717 | - |
| DKK | - | - | 224.420 | - |
| EUR | - | - | 5.606.948 | - |
| GBP | - | - | 2.088.336 | - |
| JPY | - | - | 10.298.308 | - |
| NOK | - | - | 12.652 | - |
| SEK | - | - | 725 | - |
| USD | - | - | 11.380.447 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 1.632.000 | - | - |
| Gesamt | - | 1.632.000 | 35.275.005 | - |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 230.871 | - |
| CAD | - | - | 1.013.619 | - |
| CHF | - | - | 481.235 | - |
| DKK | - | - | 1.796.427 | - |
| EUR | - | - | 14.935.355 | - |
| GBP | - | - | 6.285.930 | - |
| JPY | - | - | 2.141.734 | - |
| NOK | - | - | 126.697 | - |
| NZD | - | - | 10.149 | - |
| SEK | - | - | 9.427 | - |
| USD | - | - | 12.395.402 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 260.000 | 2.677.000 | - | - |
| Gesamt | 260.000 | 2.677.000 | 39.426.846 | - |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 3.663.955 | - |
| CAD | - | - | 3.851.594 | - |
| CHF | - | - | 4.163.333 | - |
| DKK | - | - | 10.272.236 | - |
| EUR | - | - | 117.398.507 | - |
| GBP | - | - | 41.898.214 | - |
| JPY | - | - | 11.821.663 | - |
| NOK | - | - | 781.493 | - |
| NZD | - | - | 89.016 | - |
| SEK | - | - | 31.398 | - |
| USD | - | - | 90.075.840 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 891.000 | 63.293.400 | - | 864.111.423 |
| Gesamt | 891.000 | 63.293.400 | 284.047.249 | 864.111.423 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 518.148 | - |
| CHF | - | - | 65.593 | - |
| DKK | - | - | 8.043 | - |
| EUR | - | - | 1.285.711 | - |
| GBP | - | - | 391.517 | - |
| JPY | - | - | 978.866 | - |
| NOK | - | - | 2.853 | - |
| USD | - | - | 464.601 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 2.656.000 | - | - |
| Gesamt | - | 2.656.000 | 3.715.332 | - |

| Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten | Entgegen- | Gestellte nicht |
|--|---------------------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | | | genommene unbare Sicherheiten | zahlungs-wirksamei cherheiten |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 361.000 | - | - | - |
| Gesamt | 361.000 | - | - | - |
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 1.466.501 | - |
| CAD | - | - | 858.645 | - |
| DKK | - | - | 980.237 | - |
| EUR | - | - | 22.579.685 | - |
| GBP | - | - | 22.987.261 | - |
| JPY | - | - | 18.145.316 | - |
| NOK | - | - | 91.326 | - |
| NZD | - | - | 118.010 | - |
| SEK | - | - | 6.466 | - |
| USD | - | - | 92.518.349 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 16.190.000 | 22.902.000 | - | 1.484.001.946 |
| Gesamt | 16.190.000 | 22.902.000 | 159.751.796 | 1.484.001.946 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 987.776 | - |
| CHF | - | - | 488.285 | - |
| EUR | - | - | 9.683.110 | - |
| GBP | - | - | 15.192.413 | - |
| JPY | - | - | 8.274.419 | - |
| NOK | - | - | 52.632 | - |
| NZD | - | - | 79.486 | - |
| USD | - | - | 34.624.743 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 250.000 | 1.898.000 | - | - |
| Gesamt | 250.000 | 1.898.000 | 69.382.864 | - |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Conservative (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 58.438 | - |
| CHF | - | - | 64.855 | - |
| EUR | - | - | 257.632 | - |
| GBP | - | - | 657.878 | - |
| JPY | - | - | 586.636 | - |
| NOK | - | - | 3.114 | - |
| NZD | - | - | 4.702 | - |
| USD | - | - | 388.868 | - |
| Gesamt | - | - | 2.022.123 | - |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Defensive (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 220.256 | - |
| CAD | - | - | 10.922 | - |
| CHF | - | - | 265.513 | - |
| EUR | - | - | 1.103.086 | - |
| GBP | - | - | 2.511.478 | - |
| JPY | - | - | 2.385.823 | - |
| NOK | - | - | 11.736 | - |
| NZD | - | - | 17.724 | - |
| USD | - | - | 1.585.480 | - |
| Gesamt | - | - | 8.112.018 | - |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten | Entgegen- | Gestellte nicht |
|--|---------------------------|---------------------------|-------------------------------|-----------------------------|
| | | | genommene unbare Sicherheiten | zahlungswirksameicherheiten |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Growth (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 35.731 | - |
| EUR | - | - | 161.228 | - |
| GBP | - | - | 536.677 | - |
| JPY | - | - | 36.329 | - |
| NOK | - | - | 1.904 | - |
| NZD | - | - | 2.875 | - |
| USD | - | - | 787.332 | - |
| Gesamt | - | - | 1.562.076 | - |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Moderate (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 644.462 | - |
| EUR | - | - | 2.826.877 | - |
| GBP | - | - | 7.439.497 | - |
| JPY | - | - | 546.411 | - |
| NOK | - | - | 34.339 | - |
| NZD | - | - | 51.860 | - |
| USD | - | - | 5.043.266 | - |
| Gesamt | - | - | 16.586.712 | - |
| BlackRock Style Advantage Fund (in USD) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 2.543.000 | 2.370.000 | 44.914.314 | - |
| Gesamt | 2.543.000 | 2.370.000 | 44.914.314 | - |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 697.166 | - |
| CAD | - | - | 203.439 | - |
| CHF | - | - | 288.282 | - |
| EUR | - | - | 8.021.053 | - |
| GBP | - | - | 3.868.262 | - |
| JPY | - | - | 6.352.966 | - |
| NOK | - | - | 7.063 | - |
| NZD | - | - | 10.667 | - |
| USD | - | - | 10.444.873 | - |
| Gesamt | - | - | 29.893.771 | - |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 132.140 | - |
| CAD | - | - | 28.528 | - |
| CHF | - | - | 53.631 | - |
| EUR | - | - | 2.099.795 | - |
| GBP | - | - | 967.408 | - |
| JPY | - | - | 1.883.712 | - |
| NOK | - | - | 1.212 | - |
| NZD | - | - | 1.830 | - |
| USD | - | - | 3.625.382 | - |
| Gesamt | - | - | 8.793.638 | - |
| BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund (in USD) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 290.000 | 238.000 | - | - |
| Gesamt | 290.000 | 238.000 | - | - |
| BlackRock Total Advantage Fund (in EUR) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 1.000 | - | - |
| Gesamt | - | 1.000 | - | - |

| Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten | Entgegen- | Gestellte nicht |
|--|---------------------------|---------------------------|-------------------------------|-----------------------------|
| | | | genommene unbare Sicherheiten | zahlungswirksameicherheiten |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund (in GBP) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 10.070.000 | - | - | - |
| Gesamt | 10.070.000 | - | - | - |

Am 31. Mai 2022 war ein Teil der von den Fonds erhaltenen Barsicherheiten in Geldmarktfonds reinvestiert, die von den verbundenen Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden, wie im Anlageportfolio der Fonds aufgeführt. Die Fonds sind die rechtlichen Eigentümer der entgegengenommenen Sicherheiten und können die Vermögenswerte verkaufen und die Barmittel im Falle eines Ausfalls einbehalten. Sämtliche als Sicherheit entgegengenommenen oder gestellten Barmittel haben eine offene Laufzeit, da sie keinem vertraglichen Fälligkeitsdatum unterliegen.

Unbare Sicherheiten, die auf der Grundlage einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung in Verbindung mit Wertpapierleihgeschäften und OTC-FDI-Transaktionen entgegengenommen werden, können nicht verkauft, wiederangelegt oder verpfändet werden.

Die im Verlauf des Geschäftsjahres bis zum 31. Mai 2022 von den Fonds erzielten Erträge aus der Wiederanlage von Barsicherheiten in Geldmarktfonds werden nachstehend zusammengefasst. Diese Erträge stellen die akkumulierten Gesamterträge des jeweiligen Geldmarktfonds für das zum 31. Mai 2022 endende Jahr dar. In diesen Beträgen sind etwaige Zinsverbindlichkeiten gegenüber dem Kontrahenten gemäß den entsprechenden Sicherheitenvereinbarungen nicht berücksichtigt.

| Geldmarktfonds | Gesamterträge |
|--|---------------|
| Institutional Cash Series plc | |
| - Institutional Euro Liquidity Fund | (0,71) % |
| - Institutional GBP Liquidity Fund | 0,34 % |
| - Institutional US Dollar Liquidity Fund | 0,17 % |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Art, Qualität und Laufzeit der unbaren Sicherheiten, welche die Fonds auf der Grundlage einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung in Verbindung mit Wertpapierleihtransaktionen entgegengenommen haben. Stand: 31. Mai 2022.

| Art und Qualität der Sicherheit | Laufzeit | | | | | | Offen | Gesamt |
|---|----------|--------------|---------------|----------------|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
| | 1 Tag | 2 bis 7 Tage | 8 bis 30 Tage | 31 bis 90 Tage | 91 bis 365 Tage | Über 365 Tage | | |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - | | | | | | | | |
| Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | - | 900.204 | - | 900.204 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 329.982 | 329.982 |
| Gesamt | - | - | - | - | - | 900.204 | 329.982 | 1.230.186 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - | | | | | | | | |
| Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 80.309 | - | 4.384.513 | 6.521.477 | - | 10.986.299 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 32.244.271 | 32.244.271 |
| Gesamt | - | - | 80.309 | - | 4.384.513 | 6.521.477 | 32.244.271 | 43.230.570 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - | | | | | | | | |
| Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 6.870 | - | 374.267 | 2.562.560 | - | 2.943.697 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 16.366.952 | 16.366.952 |
| Gesamt | - | - | 6.870 | - | 374.267 | 2.562.560 | 16.366.952 | 19.310.649 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - | | | | | | | | |
| Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 3.738 | - | 15.403.627 | 38.114.866 | - | 53.522.231 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 109.693.164 | 109.693.164 |
| Gesamt | - | - | 3.738 | - | 15.403.627 | 38.114.866 | 109.693.164 | 163.215.395 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - | | | | | | | | |
| Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 1.446 | - | 2.943.879 | 6.263.582 | - | 9.208.907 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 7.863.305 | 7.863.305 |
| Gesamt | - | - | 1.446 | - | 2.943.879 | 6.263.582 | 7.863.305 | 17.072.212 |
| BlackRock ESG Euro Bond Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - | | | | | | | | |
| Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 3.881 | 855 | 1.116.777 | 21.721.013 | - | 22.842.526 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 5.359.992 | 5.359.992 |
| Gesamt | - | - | 3.881 | 855 | 1.116.777 | 21.721.013 | 5.359.992 | 28.202.518 |
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - | | | | | | | | |
| Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 1.813 | - | 2.750.143 | 17.092.964 | - | 19.844.920 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 7.767.405 | 7.767.405 |
| Gesamt | - | - | 1.813 | - | 2.750.143 | 17.092.964 | 7.767.405 | 27.612.325 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Art und Qualität der Sicherheit | Laufzeit | | | | | | Offen | Gesamt |
|---|----------|--------------|----------------|----------------|-------------------|--------------------|-------------------|--------------------|
| | 1 Tag | 2 bis 7 Tage | 8 bis 30 Tage | 31 bis 90 Tage | 91 bis 365 Tage | Über 365 Tage | | |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 597 | - | 195.913 | 2.693.524 | - | 2.890.034 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 206.575 | 206.575 |
| Gesamt | - | - | 597 | - | 195.913 | 2.693.524 | 206.575 | 3.096.609 |
| BlackRock European Absolute Return Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 43.651 | - | 2.381.389 | 3.559.710 | - | 5.984.750 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 23.005.323 | 23.005.323 |
| Gesamt | - | - | 43.651 | - | 2.381.389 | 3.559.710 | 23.005.323 | 28.990.073 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 37.690 | - | 2.053.252 | 10.359.094 | - | 12.450.036 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 9.851.539 | 9.851.539 |
| Gesamt | - | - | 37.690 | - | 2.053.252 | 10.359.094 | 9.851.539 | 22.301.575 |
| BlackRock European Select Strategies Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 3.530 | 623 | 1.032.786 | 12.198.979 | - | 13.235.918 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 22.039.087 | 22.039.087 |
| Gesamt | - | - | 3.530 | 623 | 1.032.786 | 12.198.979 | 22.039.087 | 35.275.005 |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 13.844 | - | 5.836.469 | 25.599.821 | - | 31.450.134 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 7.976.712 | 7.976.712 |
| Gesamt | - | - | 13.844 | - | 5.836.469 | 25.599.821 | 7.976.712 | 39.426.846 |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 117.421 | 316.315 | 35.081.044 | 188.074.428 | - | 223.589.208 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 60.458.041 | 60.458.041 |
| Gesamt | - | - | 117.421 | 316.315 | 35.081.044 | 188.074.428 | 60.458.041 | 284.047.249 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | 300.605 | 1.680.652 | - | 1.981.257 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 1.734.075 | 1.734.075 |
| Gesamt | - | - | - | - | 300.605 | 1.680.652 | 1.734.075 | 3.715.332 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Art und Qualität der Sicherheit | Laufzeit | | | | | | Offen | Gesamt |
|--|----------|--------------|----------------|----------------|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
| | 1 Tag | 2 bis 7 Tage | 8 bis 30 Tage | 31 bis 90 Tage | 91 bis 365 Tage | Über 365 Tage | | |
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 126.093 | - | 10.165.124 | 28.637.581 | - | 38.928.798 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 120.822.998 | 120.822.998 |
| Gesamt | - | - | 126.093 | - | 10.165.124 | 28.637.581 | 120.822.998 | 159.751.796 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 84.931 | - | 5.386.534 | 15.470.309 | - | 20.941.774 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 48.441.090 | 48.441.090 |
| Gesamt | - | - | 84.931 | - | 5.386.534 | 15.470.309 | 48.441.090 | 69.382.864 |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Conservative (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 5.025 | - | 273.726 | 377.561 | - | 656.312 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 1.365.811 | 1.365.811 |
| Gesamt | - | - | 5.025 | - | 273.726 | 377.561 | 1.365.811 | 2.022.123 |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Defensive (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 18.938 | - | 1.051.287 | 1.613.332 | - | 2.683.557 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 5.428.461 | 5.428.461 |
| Gesamt | - | - | 18.938 | - | 1.051.287 | 1.613.332 | 5.428.461 | 8.112.018 |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Growth (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 3.072 | - | 167.367 | 488.963 | - | 659.402 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 902.674 | 902.674 |
| Gesamt | - | - | 3.072 | - | 167.367 | 488.963 | 902.674 | 1.562.076 |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Moderate (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 55.412 | - | 3.018.713 | 4.516.032 | - | 7.590.157 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 8.996.555 | 8.996.555 |
| Gesamt | - | - | 55.412 | - | 3.018.713 | 4.516.032 | 8.996.555 | 16.586.712 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 11.397 | - | 982.310 | 11.128.161 | - | 12.121.868 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 17.771.903 | 17.771.903 |
| Gesamt | - | - | 11.397 | - | 982.310 | 11.128.161 | 17.771.903 | 29.893.771 |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 1.956 | - | 111.319 | 2.885.526 | - | 2.998.801 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 5.794.837 | 5.794.837 |
| Gesamt | - | - | 1.956 | - | 111.319 | 2.885.526 | 5.794.837 | 8.793.638 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Art, Qualität und Laufzeit der unbaren Sicherheiten, welche die Fonds auf der Grundlage einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung in Verbindung mit OTC-FDIs erhalten/gestellt haben (Stand: 31. Mai 2022).

| Art und Qualität der Sicherheit | Laufzeit | | | | | | Offene Transaktionen | Gesamt |
|--|----------|--------------|------------------------|----------------|-----------------|--------------------|----------------------|----------------------|
| | 1 Tag | 2 bis 7 Tage | 8 bis 30 Tage | 31 bis 90 Tage | 91 bis 365 Tage | Über 365 Tage | | |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment Grade | - | - | - | - | - | 864.111.423 | - | 864.111.423 |
| Gesamt | - | - | - | - | - | 864.111.423 | - | 864.111.423 |
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment Grade | - | - | - 1.484.001.946 | - | - | - | - | 1.484.001.946 |
| Gesamt | - | - | - 1.484.001.946 | - | - | - | - | 1.484.001.946 |
| BlackRock Style Advantage Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment Grade | - | - | - | - | - | 44.914.314 | - | 44.914.314 |
| Gesamt | - | - | - | - | - | 44.914.314 | - | 44.914.314 |

Wertpapiere der Kategorie Investment Grade werden von einem Unternehmen begeben, dessen Bonität von einer der weltweit anerkannten Ratingagenturen Standard & Poor's, Moody's oder Fitch mindestens mit dem Kreditrating Investment Grade eingestuft wird.

Ein anerkannter Aktienindex enthält mindestens 20 Aktien, von denen keine mehr als 20 % des Gesamtindex darstellt und in dem keine fünf Aktien zusammen mehr als 60 % des Gesamtindex repräsentieren.

Die Laufzeitenanalyse für festverzinsliche Wertpapiere, die als Sicherheit entgegengenommen oder gestellt werden, basiert auf dem jeweiligen vertraglichen Fälligkeitsdatum. Als Sicherheiten entgegengenommene oder gestellte Aktien und börsengehandelte Fonds (ETFs) werden indes als offene Transaktionen ausgewiesen, da sie keinem vertraglich festgelegten Fälligkeitsdatum unterliegen.

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Beträge der unbaren Sicherheiten, welche die Fonds in Verbindung mit Wertpapierleihtransaktionen entgegengenommen haben und die von der Verwahrstelle der Fonds (oder deren Beauftragten) oder über ein Wertpapierabrechnungssystem gehalten werden. Stand: 31. Mai 2022.

| Verwahrstelle | Entgegengenommene unbare Sicherheiten |
|--|---------------------------------------|
| | Wertpapierleihe |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (in USD) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 1.230.186 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 43.230.570 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (in USD) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 19.310.649 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (in USD) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 111.664.999 |
| EUROCLEAR | 51.550.396 |
| Gesamt | 163.215.395 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (in USD) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 8.052.910 |
| EUROCLEAR | 9.019.302 |
| Gesamt | 17.072.212 |
| BlackRock ESG Euro Bond Fund (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 11.929.684 |
| EUROCLEAR | 16.272.834 |
| Gesamt | 28.202.518 |
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 18.598.558 |
| EUROCLEAR | 9.013.767 |
| Gesamt | 27.612.325 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Verwahrstelle | Entgegengenommene unbare Sicherheiten |
|--|--|
| Verwahrstelle | Wertpapierleihe |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 206.575 |
| EUROCLEAR | 2.890.034 |
| Gesamt | 3.096.609 |
| BlackRock European Absolute Return Fund (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 28.990.073 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 22.301.575 |
| BlackRock European Select Strategies Fund (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 26.509.345 |
| EUROCLEAR | 8.765.660 |
| Gesamt | 35.275.005 |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 18.333.252 |
| EUROCLEAR | 21.093.594 |
| Gesamt | 39.426.846 |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 156.128.740 |
| EUROCLEAR | 127.918.509 |
| Gesamt | 284.047.249 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 2.093.048 |
| EUROCLEAR | 1.622.284 |
| Gesamt | 3.715.332 |
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 145.453.502 |
| EUROCLEAR | 14.298.294 |
| Gesamt | 159.751.796 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund (in USD) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 69.382.864 |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Conservative (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 2.022.123 |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Defensive (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 8.112.018 |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Growth (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 1.562.076 |
| BlackRock Managed Index Portfolios -Moderate (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 16.586.712 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (in USD) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 29.893.771 |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund (in USD) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 8.793.638 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

Die folgende Tabelle führt die zehn größten Emittenten nach Wert der unbaren Sicherheiten auf, die von den Fonds mittels einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung über Wertpapierleihtransaktionen und OTC-FDIs angenommen wurden, Stand: 31. Mai 2022.

| Emittenten | Wert |
|---|------------|
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (in USD) | |
| Republic of Austria | 150.720 |
| French Republic | 150.720 |
| United Kingdom | 150.719 |
| Republic of Germany | 150.718 |
| Kingdom of Netherlands | 150.715 |
| United States Treasury | 146.614 |
| Citrix Systems Inc | 36.345 |
| Enghouse Systems Ltd | 36.345 |
| Woolworths Group Ltd | 36.344 |
| Telefonica SA | 36.339 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 4.229.707 |
| United Kingdom | 4.181.334 |
| Standard Chartered Plc | 2.104.925 |
| European Investment Bank | 1.424.275 |
| adidas AG | 1.007.534 |
| Sony Corp | 950.092 |
| CSL Ltd | 889.805 |
| Coherent Inc | 846.368 |
| Atlantia SpA | 844.716 |
| Cerner Corp | 844.715 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (in USD) | |
| United States Treasury | 1.323.286 |
| United Kingdom | 1.318.374 |
| T-Mobile US Inc | 559.846 |
| Citigroup Inc | 559.843 |
| Neogen Corp | 559.835 |
| Fox Corp | 559.834 |
| Carrier Global Corp | 559.817 |
| Agilent Technologies Inc | 559.795 |
| Take-Two Interactive Software Inc | 559.760 |
| FMC Corp | 559.737 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (in USD) | |
| United States Treasury | 11.069.081 |
| Snam SpA | 9.879.996 |
| BNP Paribas SA | 9.879.985 |
| Imperial Brands Plc | 9.879.952 |
| GlaxoSmithKline Plc | 9.879.935 |
| ViacomCBS Inc | 9.879.934 |
| Deutsche Post AG | 9.879.923 |
| Eni SpA | 9.879.922 |
| Endesa SA | 9.485.579 |
| Republic of Germany | 9.088.902 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (in USD) | |
| United States Treasury | 2.981.839 |
| Republic of Germany | 1.458.988 |
| Kingdom of Netherlands | 1.457.542 |
| United Kingdom | 1.406.497 |
| Kingdom of Denmark | 1.195.336 |
| Snam SpA | 644.383 |
| BNP Paribas SA | 644.382 |
| Imperial Brands Plc | 644.380 |
| GlaxoSmithKline Plc | 644.379 |
| ViacomCBS Inc | 644.379 |

| Emittenten | Wert |
|---|-----------|
| BlackRock ESG Euro Bond Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 5.916.716 |
| Kingdom of Netherlands | 3.007.464 |
| United Kingdom | 2.924.232 |
| French Republic | 2.616.875 |
| Republic of Germany | 2.510.225 |
| Republic of Austria | 1.854.873 |
| Kingdom of Denmark | 1.287.700 |
| Kingdom of Belgium | 844.323 |
| Province of Quebec Canada | 283.417 |
| Viatis Inc | 261.417 |
| BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 5.260.418 |
| United Kingdom | 3.770.722 |
| Republic of Germany | 1.663.636 |
| Kingdom of Netherlands | 1.646.110 |
| Province of Quebec Canada | 1.348.270 |
| Viatis Inc | 1.243.608 |
| Iberdrola SA | 1.224.536 |
| French Republic | 1.119.847 |
| Asian Development Bank | 1.099.586 |
| FMS Wertmanagement | 899.659 |
| BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 724.558 |
| Republic of Germany | 428.582 |
| United Kingdom | 428.007 |
| Kingdom of Netherlands | 425.466 |
| Republic of Austria | 334.831 |
| French Republic | 252.417 |
| Kingdom of Denmark | 218.716 |
| Kingdom of Belgium | 38.611 |
| Global Payments Inc | 18.657 |
| Alphabet Inc | 18.433 |
| BlackRock European Absolute Return Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 2.337.630 |
| United Kingdom | 2.173.812 |
| Toyota Motor Corp | 1.553.491 |
| Anthem Inc | 1.544.433 |
| Rio Tinto Ltd | 1.381.700 |
| Shimano Inc | 1.327.369 |
| Sonic Healthcare Ltd | 1.279.124 |
| Hakuhodo DY Holdings Inc | 1.272.652 |
| Transurban Group | 1.226.989 |
| Standard Chartered Plc | 1.144.113 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 3.951.344 |
| United Kingdom | 3.641.138 |
| French Republic | 1.033.129 |
| Kingdom of Netherlands | 1.026.480 |
| Republic of Germany | 1.026.479 |
| Standard Chartered Plc | 987.863 |
| European Investment Bank | 668.427 |
| Kingdom of Belgium | 540.337 |
| adidas AG | 472.846 |
| CSL Ltd | 417.595 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Emittenten | Wert |
|---|------------|
| BlackRock European Select Strategies Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 5.301.075 |
| United Kingdom | 1.687.713 |
| Toyota Motor Corp | 1.082.376 |
| Anthem Inc | 1.076.065 |
| Rio Tinto Ltd | 962.683 |
| Shimano Inc | 924.828 |
| Kingdom of Belgium | 900.512 |
| Sonic Healthcare Ltd | 891.214 |
| Hakuhodo DY Holdings Inc | 886.705 |
| Transurban Group | 854.890 |
| BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 7.911.626 |
| United Kingdom | 5.406.094 |
| Republic of Germany | 4.210.929 |
| Kingdom of Netherlands | 4.178.303 |
| French Republic | 2.530.494 |
| Kingdom of Denmark | 1.796.427 |
| Republic of Austria | 1.255.383 |
| Kingdom of Belgium | 960.570 |
| Province of Quebec Canada | 671.180 |
| Asian Development Bank | 639.589 |
| BlackRock Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 57.516.796 |
| United Kingdom | 32.898.569 |
| Kingdom of Netherlands | 27.995.477 |
| Republic of Germany | 26.667.194 |
| French Republic | 24.940.063 |
| Kingdom of Denmark | 10.272.236 |
| Republic of Austria | 8.733.729 |
| Kingdom of Belgium | 7.305.652 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 4.977.574 |
| European Investment Bank | 4.893.646 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (in EUR) | |
| Republic of Germany | 369.111 |
| French Republic | 368.807 |
| Kingdom of Netherlands | 368.002 |
| United Kingdom | 359.399 |
| United States Treasury | 331.644 |
| Toyota Motor Corp | 133.737 |
| Anthem Inc | 132.957 |
| Rio Tinto Ltd | 118.947 |
| Shimano Inc | 114.270 |
| Kingdom of Belgium | 112.024 |
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | |
| United Kingdom | 11.226.062 |
| United States Treasury | 9.688.359 |
| Cerner Corp | 8.703.907 |
| JPMorgan Chase & Co | 5.039.345 |
| Norfolk Southern Corp | 4.774.792 |
| APA Corp | 4.774.782 |
| Trane Technologies Plc | 4.774.746 |
| QUALCOMM Inc | 4.774.733 |
| Hershey Co | 4.774.692 |
| Regeneron Pharmaceuticals Inc | 4.774.472 |

| Emittenten | Wert |
|---|-----------|
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund (in USD) | |
| United States Treasury | 7.736.254 |
| United Kingdom | 7.736.033 |
| Kingdom of Belgium | 2.765.457 |
| Standard Chartered Plc | 2.226.062 |
| Cerner Corp | 1.772.726 |
| European Investment Bank | 1.506.243 |
| Infrastrutture Wireless Italiane SpA | 1.464.537 |
| Abbott Laboratories | 1.279.457 |
| JPMorgan Chase & Co | 1.183.861 |
| AMETEK Inc | 1.083.950 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative (in EUR) | |
| United Kingdom | 250.221 |
| United States Treasury | 250.007 |
| Standard Chartered Plc | 131.695 |
| European Investment Bank | 89.110 |
| adidas AG | 63.037 |
| CSL Ltd | 55.671 |
| DS Smith Plc | 52.635 |
| HelloFresh SE | 50.414 |
| RS GROUP Plc | 45.820 |
| BT Group Plc | 44.497 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (in EUR) | |
| United States Treasury | 994.769 |
| United Kingdom | 974.983 |
| Standard Chartered Plc | 496.372 |
| European Investment Bank | 335.865 |
| adidas AG | 237.591 |
| CSL Ltd | 209.829 |
| DS Smith Plc | 198.388 |
| HelloFresh SE | 190.015 |
| RS GROUP Plc | 172.701 |
| BT Group Plc | 167.712 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (in EUR) | |
| United States Treasury | 275.171 |
| United Kingdom | 274.658 |
| Standard Chartered Plc | 80.524 |
| Abbott Laboratories | 64.581 |
| Viatris Inc | 64.359 |
| IDEX Corp | 64.000 |
| Activision Blizzard Inc | 63.941 |
| Automatic Data Processing Inc | 63.695 |
| STERIS Plc | 62.354 |
| European Investment Bank | 54.485 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (in EUR) | |
| United Kingdom | 2.926.229 |
| United States Treasury | 2.924.754 |
| Standard Chartered Plc | 1.452.367 |
| European Investment Bank | 982.729 |
| adidas AG | 695.184 |
| CSL Ltd | 613.952 |
| DS Smith Plc | 580.476 |
| HelloFresh SE | 555.976 |
| RS GROUP Plc | 505.316 |
| BT Group Plc | 490.719 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Emittenten | Wert |
|--|-----------|
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (in USD) | |
| United Kingdom | 2.676.543 |
| United States Treasury | 2.576.891 |
| French Republic | 1.433.319 |
| Kingdom of Netherlands | 1.420.269 |
| Republic of Germany | 1.420.231 |
| Republic of Austria | 1.078.296 |
| Kingdom of Belgium | 958.342 |
| Sony Corp | 759.725 |
| Coherent Inc | 758.911 |
| Cerner Corp | 727.621 |
| BlackRock Systematic Global Equity Fund (in USD) | |
| United Kingdom | 748.466 |
| United States Treasury | 621.388 |
| Republic of Austria | 388.920 |
| Sony Corp | 387.192 |
| French Republic | 383.549 |
| Coherent Inc | 383.534 |
| Cerner Corp | 382.603 |
| Atlantia SpA | 382.603 |
| Anaplan Inc | 382.601 |
| ConocoPhillips | 382.598 |

| Emittent unbarer Sicherheiten (OTC-Derivate-Transaktionen) | Wert | % des NIW des Fonds |
|--|------------|---------------------|
| BlackRock Style Advantage Fund (in USD) | | |
| United States Treasury | 44.914.314 | 37,12% |

Keine als Sicherheiten von einem einzelnen Emittenten in Bezug auf effizientes Portfolio-Management und OTC-FDIs entgegengenommenen Wertpapiere überstiegen 20% des NIW des entsprechenden Fonds zum Jahresende.

Keiner der Fonds wurde vollständig durch von einem EU-Mitgliedstaat zum Abschlussstichtag gestellte oder zugesicherte Wertpapiere besichert.

Möchten Sie mehr erfahren?

blackrockinternational.com | +44 (0)20 7743 3000

© 2022 BlackRock, Inc. Alle Rechte vorbehalten. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS und iSHARES sind Marken von BlackRock, Inc. oder deren Tochtergesellschaften in den Vereinigten Staaten und anderen Ländern. Alle anderen Marken sind Eigentum der jeweiligen Rechteinhaber.

BlackRock

Go paperless. . . 
It's Easy, Economical and Green!
Go to www.blackrock.com/edelivery