



Geprüfter nicht gesetzlich

vorgeschriebener Jahresabschluss

Institutional Cash Series plc

(Bericht für Anleger in der Schweiz)

Geprüfter nicht gesetzlich vorgeschriebener Jahresabschluss für den BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund, den BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund, den BlackRock ICS Euro Liquidity Fund, den BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund, den BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund, den BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund, den BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund, den BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund, den BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund, den BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund, den BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund und den BlackRock ICS US Treasury Fund, (zusammen die „Fonds“) – BERICHT FÜR ANLEGER IN DER SCHWEIZ.

Manche Fonds der Gesellschaft sind nicht von der Swiss Financial Market Supervisory Authority (die „FINMA“) zum Vertrieb an nicht qualifizierte Anlegerinnen und Anleger in der Schweiz aus genehmigt. Folglich sind keine Informationen bezüglich dieser Fonds in dem vorliegenden Bericht enthalten. Allerdings werden die Anlegerinnen und Anleger darauf aufmerksam gemacht, dass einige in diesem Bericht enthaltene Angaben auf einer konsolidierten Basis erstellt wurden, und daher auch Daten jener Fonds enthalten, die nicht als Angebot an nicht qualifizierte Anlegerinnen und Anleger in der Schweiz genehmigt sind.

Für den Berichtszeitraum zum 30. September 2024

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

| INHALT | Seite |
|--|-------|
| Überblick | |
| Allgemeine Informationen | 1 |
| Hintergrund | 3 |
| Performance | |
| Bericht des Investmentmanagers | 4 |
| Governance (Unternehmensführung) | |
| Bericht des Verwaltungsrats | 13 |
| Bericht der Verwahrstelle an die Anteilinhaber | 15 |
| Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer | 16 |
| Jahresabschluss | |
| Gewinn- und Verlustrechnung | 19 |
| Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens | 22 |
| Bilanz | 25 |
| Anmerkungen zum Jahresabschluss | 28 |
| Aufstellung der Vermögenswerte | 67 |
| Zusätzliche Informationen und aufsichtsrechtliche Angaben (ungeprüft) | |
| Aufstellungen wesentlicher Käufe und Verkäufe (ungeprüft) | 144 |
| Informationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft) | 157 |
| Transaktionen mit verbundenen Personen (ungeprüft) | 160 |
| Transaktionskosten (ungeprüft) | 161 |
| Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions) (ungeprüft) | 161 |
| Wechselseitige Anlagen (ungeprüft) | 161 |
| Gesamtrisikoeexposition (ungeprüft) | 161 |
| Hebelwirkung (ungeprüft) | 161 |
| Vergütungsbericht (ungeprüft) | 162 |
| Effizientes Portfoliomanagement und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) | 166 |
| Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen (ungeprüft) | 173 |

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Verwaltungsrat¹

Barry O'Dwyer (Vorsitzender) (Ire)
Francis Drought (Ire)²
Nicola Grenham (Irin)³

¹Nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied

²Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe

³Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

Verwaltungsgesellschaft

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

Fondsverwalter, Register- und Transferstelle

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

Verwahrstelle

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

Secretary

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

Eingetragener Geschäftssitz des Unternehmens

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

Investmentmanager, Hauptvertriebsgesellschaft und Unter-Investmentmanager⁴

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

US-Investmentmanager⁴

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

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

Registernummer des Unternehmens: 298213

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

Das Unternehmen ist bei der Comisión Nacional de Mercado de Valores in Spanien ordnungsgemäß unter der Nummer 542 eingetragen.

Unabhängige Abschlussprüfer

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

Rechtsberater für irisches Recht

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

Zahlstelle in Frankreich

CACEIS Bank Frankreich
1-3 Place Valhubert
75013 Paris
Frankreich

Zahlstelle in der Schweiz

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

Vertreter in Südafrika

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

Vertreter in der Schweiz

BlackRock Asset Management Schweiz AG
Bahnhofstrasse 39
8001 Zürich
Schweiz

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

HINTERGRUND

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

Das Unternehmen besitzt die Struktur eines Umbrellafonds und besteht aus separaten Fonds („Fonds“) des Unternehmens. Die Anteile der einzelnen Fonds können in verschiedene Anteilklassen eingeteilt werden (jeweils eine „Anteilklasse“). Jeder Fonds repräsentiert ein separates Portfolio von Vermögenswerten und kann sich aus einer oder mehreren Anteilklassen zusammensetzen. Für die jeweiligen Anteilklassen können verschiedene Zeichnungs- und Rücknahmebestimmungen, Gebühren, Kosten oder Brokerage-Arrangements gelten. Die Auflegung einer zusätzlichen Anteilklasse wird der CBI vorab mitgeteilt. Das für jeden Fonds geführte Vermögensportfolio wird gemäß den im Prospekt und im Prospektnachtrag angegebenen Anlagezielen und -strategien der einzelnen Fonds angelegt.

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

Der Begriff „Fonds“ oder „Finanzprodukt“ bezeichnet entweder einen Fonds oder mehrere Fonds des Unternehmens oder – wenn dies der Kontext erfordert – die Verwaltungsgesellschaft des jeweiligen Fonds oder deren Stellvertreter, der für den jeweiligen Fonds handelt. Die Begriffe „BlackRock“ und „Investmentmanager“ werden stellvertretend für die BlackRock Investment Management (UK) Limited und/oder die BlackRock Capital Management, Inc., wie jeweils zutreffend, verwendet. Alle Verweise auf „rückkaufbare Anteile“ beziehen sich auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile, wenn Fondsanteile als finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert werden. Die Bezeichnung „Verwaltungsratsmitglieder“ bedeutet die Verwaltungsratsmitglieder des Unternehmens.

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

Details der Fonds

Zum 30. September 2024 sind 12 Fonds des Unternehmens in der Schweiz zum Angebot an nicht qualifizierte Anleger zugelassen.

Veränderungen im Unternehmen im Laufe des Geschäftsjahres

Am 10. November 2023 wurde für das Unternehmen ein aktualisierter Prospekt zur Aufnahme der folgenden Änderungen veröffentlicht:

- Aktualisierungen zu den Informationen über Verwaltungsratsmitglieder und den Angaben zur Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“).
- Kleine Aktualisierungen der Abschnitte zur Anlagepolitik, um eine enge Angleichung an die Bestimmungen der GMFV zu erreichen.

Am 5. Dezember 2023 trat Becky Tilston Hales als nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied des Unternehmens zurück. Francis Drought wurde zum nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglied des Unternehmens ernannt.

Am 6. Dezember 2023 veröffentlichte die FCA ein neues Konsultationspapier, CP23/28 „Updating the regime for Money Market Funds“, zu GMF. In diesem Dokument werden Vorschläge zur Verbesserung der Widerstandsfähigkeit von im Vereinigten Königreich ansässigen Geldmarktfonds dargelegt. Das Konsultationspapier wurde in enger Abstimmung mit dem britischen Finanzministerium und der Bank of England entwickelt. Eine der vorgeschlagenen Änderungen besteht darin, den Mindestanteil an hochgradig liquiden Vermögenswerten, den alle Typen von Geldmarktfonds halten müssen, zu erhöhen. Dies soll sicherstellen, dass GMF über ausreichend liquide Mittel verfügen, um zu Zeiten mit sehr starken, aber plausiblen Marktspannungen über einen kurzen Zeitraum hinweg hohe Rücknahmen zu verkraften. Die Konsultation wurde am 8. März 2024 abgeschlossen.

Am 27. Dezember 2023 wurde für den BlackRock ICS Euro Liquidity Fund die Anteilklasse Admin II (Acc T0) aufgelegt.

Am 11. Januar 2024 wurden die Anteilklassen Admin III (Acc T0), Admin III (Dis) und Admin IV (Acc T0) für den BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund, den BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund und den BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund aufgelegt.

Am 11. März 2024 wurden die Anteilklassen Admin III (Dis), Admin III (Dis) und the Admin IV (Dis) für den BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund, den BlackRock ICS Euro Liquidity Fund und den BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund aufgelegt.

Am 8. April 2024 wurde für das Unternehmen ein Prospektnachtrag herausgegeben. Es gab keine wesentlichen Änderungen, die offengelegt werden mussten.

Am 7. Mai 2024 wurden Anteile der Klasse E (Dis) für den BlackRock ICS US Treasury Fund aufgelegt.

Am 25. Juni 2024 wurden alle Anteile der Klasse Heritage (Acc T0) des BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund aufgelegt.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS

Anlageziel

BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund
BlackRock ICS US Treasury Fund

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

BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund

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

BlackRock ICS Euro Liquidity Fund
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund

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

BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund

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

BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund

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

Ansatz zum Investmentmanagement sowie Umwelt-, Sozial- und Governance-Politik („ESG“)

In der folgenden Tabelle wird der für die einzelnen Fonds gewählte Ansatz zum Investmentmanagement dargelegt. Darüber hinaus zeigt sie, welche Fonds gemäß der EU-SFDR ökologische oder soziale Merkmale („Artikel-8-Fonds“) fördern oder nachhaltige Anlagen als Ziel haben („Artikel-9-Fonds“).

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

| Name des Fonds | Performanceindikator | Ansatz zum Investmentmanagement | SFDR-Kriterien |
|--|-------------------------------------|---------------------------------|----------------|
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund ¹ | €STR Overnight | Aktiv | Sonstige |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund ¹ | €STR Overnight | Aktiv | Artikel 8 |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund ¹ | €STR Overnight | Aktiv | Artikel 8 |
| BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund ¹ | 3-Month compounded €STR in arrears | Aktiv | Artikel 8 |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund ¹ | SONIA Overnight | Aktiv | Sonstige |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund ¹ | SONIA Overnight | Aktiv | Artikel 8 |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund ¹ | SONIA Overnight | Aktiv | Artikel 8 |
| BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund ¹ | 3-Month compounded SONIA in arrears | Aktiv | Artikel 8 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund ¹ | SOFR Overnight | Aktiv | Artikel 8 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund ¹ | SOFR Overnight | Aktiv | Artikel 8 |
| BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund ¹ | 3-Month compounded SOFR in arrears | Aktiv | Artikel 8 |
| BlackRock ICS US Treasury Fund ¹ | SOFR Overnight | Aktiv | Sonstige |

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Zusammenfassung der Wertentwicklung

Die nachstehende Tabelle vergleicht die realisierte Performance des Fonds mit dem entsprechenden Performanceindikator im Geschäftsjahr zum 30. September 2024.

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

- Bei den aufgeführten Renditen handelt es sich um die Performance-Renditen für die primäre Anteilklasse des Fonds nach Abzug von Gebühren, die als repräsentative Anteilklasse ausgewählt wurde. Die primäre Anteilklasse stellt die Anteilklasse dar, in die die Mehrheit der Anleger des Fonds investiert. Sie berücksichtigt außerdem andere relevante Faktoren wie die Basiswährung des Fonds. Sofern nichts anderes angegeben ist, lauten die zu Vergleichszwecken angegebenen Erträge auf dieselbe Währung wie die primäre Anteilklasse. Die Performance-Renditen für andere Anteilklassen können auf Anfrage zur Verfügung gestellt werden.
- Für Fonds, die ihren Handel im Geschäftsjahr aufgenommen haben und/oder deren Anteile im Geschäftsjahr vollständig zurückgenommen wurden, werden die Renditen ab dem Datum angegeben, an dem der jeweilige Fonds den Handel aufnahm und/oder ab dem Datum, an dem die Fondsanteile vollständig zurückgenommen wurden. Die Total Expense Ratio (Gesamtkostenquote, „TER“) ist die effektive TER ab dem Datum, an dem der Fonds den Handel aufgenommen hat und/oder bis zum Datum der vollständigen Rücknahme des Fonds.
- Die Fondserträge stützen sich auf die Summe der täglichen Dividendensätze nach Abzug von Gebühren. Gemäß den Anforderungen des Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), die für die Abschlüsse gelten, kann es zu Abweichungen zwischen dem NIW je Anteil, wie im Abschluss ausgewiesen, und dem NIW je Anteil, der gemäß der im Prospekt ausgewiesenen Bewertungsmethode berechnet wird, kommen.
- Die Gesamtkostenquote stellt die Summe aller Gebühren, Betriebskosten und Aufwendungen (mit Ausnahme direkter Handelskosten) dar, die dem Vermögen der einzelnen Fonds als Prozentsatz des durchschnittlichen Vermögens auf Basis des Zwölfmonatszeitraums zum 30. September 2024 belastet wird.

| Name des Fonds | Fondsrendite % | Performance-Indikator % | TER % |
|--|-------------------|----------------------------|----------|
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc) | 3,72 | 3,96 | 0,20 |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Acc) | 4,01 | 3,96 | 0,20 |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc) | 3,82 | 3,96 | 0,20 |
| BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Core | 4,17 | 3,96 | 0,20 |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc) | 5,14 | 5,30 | 0,20 |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Dis) | 5,25 | 5,30 | 0,20 |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc) | 5,28 | 5,30 | 0,20 |
| BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Core | 5,47 | 5,30 | 0,20 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Dis) | 5,46 | 5,30 | 0,20 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc) | 5,47 | 5,30 | 0,20 |
| BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Select | 5,83 | 5,54 | 0,15 |
| BlackRock ICS US Treasury Fund - Anteilklasse Core (Acc) | 5,29 | 5,30 | 0,20 |

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

Globaler Wirtschaftsüberblick

Die globalen Aktien, die durch den MSCI All Country World Index repräsentiert werden, verzeichneten in den zwölf Monaten bis zum 30. September 2024 (in USD) eine Rendite von 31,76 %. Bei deutlich niedrigerer Inflation (d. h. die Steigerungsrate der Preise für Waren und Dienstleistungen) und Optimismus der Anleger legten Aktienwerte deutlich zu, während die größten Zentralbanken der Welt begannen, ihre Geldpolitik zu lockern. Doch zunehmende geopolitische Spannungen, darunter der Krieg im Nahen Osten und Angriffe auf die Frachtrouten im Roten Meer, könnten für eine verstärkte Störung der Weltwirtschaft sprechen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Globaler Wirtschaftsüberblick (Fortsetzung)

In den USA präsentierte sich die Wirtschaft während des größten Teils des zwölfmonatigen Berichtszeitraums solide und verzeichnete ein stärkeres Wachstum als andere Industrieländer, was sowohl an den steigenden Verbraucher- als auch den zunehmenden Staatsausgaben lag. Die US-Verbraucher Ausgaben wurden durch ein starkes Lohnwachstum und höhere Vermögenspreise gestützt. Gegen Ende des zwölfmonatigen Berichtszeitraums gab es allerdings Anzeichen für Schwäche am Arbeitsmarkt. In Japan wuchs das Bruttoinlandsprodukt („BIP“) im zweiten Quartal 2024 um 3,1 %, nachdem es in den drei vorangegangenen Quartalen stagniert hatte. Die Erholung wurde angetrieben durch den steigenden privaten Konsum. Die Wirtschaft des Vereinigten Königreichs schrumpfte gegen Ende 2023, bevor sie dann in den ersten beiden Quartalen 2024 zu Wachstum zurückkehrte, was an anziehendem Output im Dienstleistungs- und im Produktionssektor lag. Das Wachstum in der Eurozone erholte sich in der ersten Hälfte 2024 ebenfalls, unterstützt durch die starke Leistung mehrerer kleinerer Volkswirtschaften der Währungsunion, darunter Irland, Spanien und Portugal.

Die meisten Schwellenländer verzeichneten weiterhin Wirtschaftswachstum. Trotz der sich aus dem Hochzinsumfeld ergebenden wirtschaftliche Herausforderungen sorgte die Widerstandsfähigkeit der US-Wirtschaft für Unterstützung. Das chinesische BIP wuchs langsamer als erwartet, eine Folge der Bedenken hinsichtlich des Immobiliensektors des Landes und der schwachen Einzelhandelsumsätze. Von den Investoren positiv aufgenommen wurde jedoch Chinas Ankündigung einer neuen Runde von Konjunkturmaßnahmen Ende September 2024. Die indische Wirtschaft expandierte in einem robusten Tempo, unterstützt durch die Stärke des verarbeitenden Gewerbes und zunehmende Exporte. In Brasilien erholte sich das Wachstum in den ersten beiden Quartalen des Jahres 2024, was hauptsächlich auf die gestiegenen Ausgaben der Privathaushalte und der Regierung zurückzuführen war.

Die meisten der weltweit größten Zentralbanken gaben ihre restriktive Geldpolitik auf, da die Inflation im zwölfmonatigen Berichtszeitraum weiter zurückging. Die US-Notenbank (die „Fed“) senkte die Zinssätze im September 2024 um 0,5 %, während sie gleichzeitig einige der angesammelten Anleihenbestände in ihrer Bilanz weiter reduzierte. Die Bank of England („BoE“) beließ die Zinssätze während des größten Teils des zwölfmonatigen Berichtszeitraums unverändert, bis sie sie dann im August 2024 senkte, nachdem die Inflation im Vereinigten Königreich auf die Zielmarke von 2,0 % gefallen war. Die Europäische Zentralbank (die „EZB“) senkte die Zinssätze im Juni 2024, nachdem sie diese seit September 2023 unverändert gelassen hatte. In einer bemerkenswerten Wende erhöhte die Bank of Japan („BoJ“) im März 2024 die Zinssätze erstmals seit 2007, um sie dann im Juli 2024 erneut heraufzusetzen.

Globale Aktien entwickelten sich im zwölfmonatigen Berichtszeitraum ausgesprochen positiv, da die anhaltende Stärke der Weltwirtschaft die Sorge vor einer möglichen Rezession zerstreute. Eine niedrigere Inflation und erste Anzeichen für nachlassende Konjunktur in den USA im weiteren Verlauf des Berichtszeitraums erhöhten die Wahrscheinlichkeit stärkerer Zinssenkungen, während die Kurse großer Technologiewerte in der Hoffnung zulegten, dass die Entwicklung im Bereich der künstlichen Intelligenz das Wachstum ankurbeln würde. Weltweit sahen sich Anleihen und Aktien, die die Merkmale von Unternehmen in Bezug auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) berücksichtigen, mit regulatorischen Bedenken und einer veränderten Anlegerstimmung konfrontiert. ESG-Fonds verzeichneten insgesamt positive Zuflüsse. Während die Investments in Europa stabil blieben, kam es in den USA zu Abflüssen.

Die (sich gegenläufig zu den Kursen entwickelnden) Renditen der 10-jährigen US-Staatsanleihe, ein Referenzzins für den globalen Anleihenmarkt, beendeten den zwölfmonatigen Berichtszeitraum – im Anschluss an Spitzenwerte im Herbst 2023 und im Frühjahr 2024 – deutlich niedriger. Die Renditekurve, die die Differenz zwischen den Renditen verschiedener Laufzeiten misst, blieb invers, sodass die Renditen am kürzeren Ende höher waren als am längeren – ein Anzeichen dafür, dass die Anleger eine Verlangsamung des Wirtschaftswachstums befürchteten. Im Vereinigten Königreich gingen die Renditen britischer Staatsanleihen zurück. Dem lag das Umschwenken der BoE auf eine lockerere Geldpolitik zugrunde. Die Renditen auf europäische Staatsanleihen folgten einem ähnlichen Muster. Die japanische Regierung passte ihre Renditegrenze für 10-jährige Staatsanleihen an, was in der Folge zu einem starken Anstieg der Renditen führte. Die Renditen auf langfristige Anleihen sanken allerdings wieder, bedingt durch den Wertanstieg des japanischen Yen gegen Ende des Zwölfmonatszeitraums.

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

Die Aktien der Schwellenländer verbuchten ebenfalls Kursanstiege und profitierten von dem relativ stabilen globalen Wirtschaftsumfeld und der Verschnaufpause bei der Straffung der Geldpolitik. Als die Sorgen über eine mögliche globale Rezession abnahmen, schichteten manche Anleger wieder in Schwellenländeraktien um, was die Kurse in die Höhe trieb. Schwellenländeranleihen verzeichneten insgesamt positive Renditen, da die Anleger auf eine weniger restriktive Geldpolitik in den Industrieländern reagierte.

Die Rohstoffmärkte setzten ihre Stabilisierung fort, obwohl die zunehmenden geopolitischen Spannungen die Aussicht auf weitere Marktstörungen erhöhten. Die Preise für Rohöl der Sorte Brent stiegen zu Beginn des zwölfmonatigen Berichtszeitraums, da die Instabilität im Nahen Osten bei den Investoren für Besorgnis sorgte. Die Preise fielen jedoch wieder, als die weltweite Ölproduktion zunahm. Dabei leisteten sowohl die Vereinigten Staaten als auch Kanada besonders große Beiträge zur Gesamtproduktion. Die Erdgaspreise gingen zunächst aufgrund eines unerwartet milden Winters in Europa zurück, zogen aber gegen Ende des zwölfmonatigen Berichtszeitraums infolge von Versorgungsunterbrechungen durch extreme Wetterbedingungen im Golf von Mexiko wieder an. Der Goldpreis kletterte vor dem Hintergrund geopolitischer Spannungen, der Möglichkeit einer Reihe von Zinssenkungen in den USA und der gestiegenen Nachfrage von Investoren in Asien auf Rekordhöhen.

An den Devisenmärkten war die Performance des US-Dollars gegenüber den meisten anderen globalen Währungen negativ. Er verlor gegenüber dem britischen Pfund, dem Euro, dem japanischen Yen und dem chinesischen Yuan spürbar an Wert.

Überblick über die Fonds-Performance und die Veränderungen im Portfolio

BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund

Die EZB vollzog den Übergang von stabilen Zinssätzen hin zu einem Lockerungszyklus und läutete diesen im Juni 2024 mit einer Zinssenkung um 0,25 Prozentpunkte ein. Im September 2024 wurde der Zinssatz für die Einlagefazilität um weitere 0,25% auf 3.50% gesenkt. Der Hauptrefinanzierungssatz wurde auf 3,65% und der Spitzenrefinanzierungssatz auf 3,90% angepasst. Der Markt fasst zunehmend Vertrauen in eine Fortsetzung dieser Lockerung. Erwartet werden bis Ende 2024 noch Zinssenkungen um 55 Basispunkte und möglicherweise eine Senkung des Einlagezinses auf 2,86%. Zum Ende des dritten Quartals wurde die Wahrscheinlichkeit einer Zinssenkung um 25 Basispunkte im Oktober bei 94% gesehen.

Die Inflation war das gesamte Jahr 2024 über rückläufig. Sie fiel von 2,8% im Januar auf 2,5% im Juni und dann weiter auf 2,2% im August. Den Prognosen zufolge ist im September ein weiterer Rückgang auf 1,8% zu erwarten, d.h. der Druck auf die Verbraucherpreise dürfte nachlassen. Im August schwächte sich die Gesamtinflation, in erster Linie bedingt durch sinkende Energiepreise, auf 2,2% ab. Während die Kerninflation, welche die Preise für Lebensmittel, Energie, Alkohol und Tabak ausklammert, im August ebenfalls eine leichte Abschwächung erfuhr, blieb die Inflation im Dienstleistungssektor hartnäckig hoch.

Im Euroraum wuchs das BIP im zweiten Quartal 2024 um 0,20% gegenüber dem Vorquartal, was einem leichten Rückgang im Vergleich zum Wachstum von 0,30% im ersten Quartal entspricht. Dieses Wachstum fand statt, obwohl Deutschland, wo eine Erholung im Fertigungssektor weiter auf sich warten lässt, einen unerwarteten Rückgang verzeichnete.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund (Fortsetzung)

Im September wies der zusammengesetzte PMI (Composite Purchase Manager Index) mit einem Stand von 49,6 Punkten zum ersten Mal seit Februar einen Rückgang auf. Auffällig ist dabei, dass der Fertigungssektor stärkere Rückgänge, der Dienstleistungssektor dagegen nur eine Abschwächung verzeichnete.

Die Arbeitslosenquote fiel im Juli saisonbereinigt auf ein Rekordtief von 6,4% nach 6,5% im Juni.

Nach den Wahlen zum Europaparlament 2024 hat sich die politische Landschaft in Europa merklich verändert. Die Europäische Volkspartei konnte zwar ihren Status als größte Partei behaupten, hat aber verstärkt Konkurrenz von extrem rechten Fraktionen erhalten. Die Alternative für Deutschland und die französische Rassemblement National erzielten beträchtliche Zugewinne, was einen breiteren Trend der Unzufriedenheit der Wähler mit Regierungen der Mitte quer durch die Mitgliedstaaten widerspiegelt. Die Europawahlen werden oft als De-facto-Referenden für die nationale Politik gewertet. Bei den Koalitionsverhandlungen dürften die Auswirkungen dieser Verschiebungen die EU-Politik in wichtigen Themen wie Einwanderung und Wirtschaftspolitik beeinflussen.

In den letzten 12 Monaten haben wir die Anlagestrategie in Reaktion auf die sich verändernden Marktbedingungen und in Reaktion auf die Zinsentwicklungen und die Geldpolitik der EZB deutlich angepasst. Zunächst führten steigende Zinsen dazu, dass Staatsanleihen im Vergleich zum Repo-Markt zu hohen Preisen gehandelt wurden, was einen vorsichtigen Ansatz und eine Reduzierung der gewichteten durchschnittlichen Laufzeit des Fonds (WAM) von 14 auf 6 Tage erforderlich machte. Als Anfang 2024 die Zinsen zu sinken begannen, boten sich Gelegenheiten, Titel aufzunehmen, deren Verzinsung dem Repo-Niveau entsprach, wodurch sich die WAM auf 25 Tage erhöhte. Mitte 2024 wurden weitere Durationserhöhungen vorgenommen, und die WAM erreichte 48 Tage, nachdem die EZB die Möglichkeit von Zinssenkungen signalisiert hatte. Allerdings ließ die anhaltende Unsicherheit hinsichtlich der Inflation und der Arbeitsmarktbedingungen eine vorsichtigere Haltung angeraten erscheinen, die schließlich bis zum Quartalsende zu einer strategischen Verlagerung auf Reverse Repos und einer Reduzierung der WAM auf 34 Tage führte. Im dritten Quartal hegten wir trotz aggressiver Zinserhöhungen und der Erwartung mehrerer Zinssenkungen Befürchtungen hinsichtlich der Gesamtinflation und der Marktdynamik, was uns veranlasste, bevorzugt in Repogeschäfte zu investieren und damit die WAM weiter auf 15 Tage zu senken. Die Strategie war geprägt von einem vorsichtigen Balanceakt zwischen dem Ergreifen von Gelegenheiten zur Erhöhung der Duration und Wachsamkeit im Hinblick auf mögliche Marktvolatilität.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2024 und 30. September 2023 angegeben:

| 30. September 2024 | | 30. September 2023 | |
|--------------------------------|------------|--------------------------------|------------|
| Wertpapier | Gewichtung | Wertpapier | Gewichtung |
| Sonstige Kaufvereinbarungen | 46,24 % | Sonstige Repogeschäfte | 60,53 % |
| Government Agency-Repogeschäft | 24,53 % | Government Agency-Repogeschäft | 29,29 % |
| Treasury Debt | 22,44 % | Treasury Debt | 10,18 % |
| Sonstige Commercial Paper | 6,79 % | | |

BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund

Im vergangenen Jahr war unsere Anlagestrategie geprägt durch einen vorsichtigen, aber opportunistischen Ansatz unter Anpassung an die Veränderungen der Marktbedingungen und geopolitische Spannungen. Im vierten Quartal 2023 konzentrierten wir uns darauf, das Jahr mit einer Erhöhung unserer Allokation in Staatsanleihen zu beenden. Dies führte zu einem stetigen Rückgang der WAM von 30 Tagen, da wir es vorzogen, in Reaktion auf die zunehmenden geopolitischen Risiken die Liquidität bei 50% zu halten. Zu Beginn des ersten Quartals 2024 nutzten wir eine Verkaufswelle am Markt, um die WAM nach und nach auf 45 Tage zu erhöhen, während wir gleichzeitig unsere Liquiditätsposition aufrechterhielten. Mit Herannahen des zweiten Quartals erhöhten wir die WAM weiter auf 55 Tage und konzentrierten uns dabei vor dem Hintergrund erheblicher Unsicherheit im Hinblick auf Zinssenkungen seitens der EZB auf das Kurvensegment von 9 bis 12 Monaten. Diese Unsicherheit erhöhte sich noch durch einen angespannten Arbeitsmarkt und einen starken Dienstleistungssektor, was uns veranlasste, eine vorsichtige Haltung einzunehmen und verstärkt Liquidität vorzuhalten. Im dritten Quartal verlagerten wir mit steigenden Zinsen unseren Fokus auf das vordere Ende der Kurve und setzten auf kürzere Laufzeiten von 1 bis 4 Monaten. Gleichzeitig erhöht wir unser Engagement in zinsvariablen Anleihen. Diese strategische Anpassung ging einher mit deutlichen Zuflüssen, was zu einem Rückgang der WAM von 50 auf 41 Tage führte.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2024 und 30. September 2023 angegeben:

| 30. September 2024 | | 30. September 2023 | |
|--|------------|--|------------|
| Wertpapier | Gewichtung | Wertpapier | Gewichtung |
| Einlagenzertifikat | 33,60 % | Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 27,07 % |
| Commercial Paper von Finanzunternehmen | 22,30 % | Einlagenzertifikat | 26,23 % |
| Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 17,19 % | Commercial Paper von Finanzunternehmen | 21,79 % |
| Sonstige Repogeschäfte | 8,65 % | Forderungsbesicherte Commercial Paper | 8,77 % |
| Forderungsbesicherte Commercial Paper | 8,20 % | Sonstige Repogeschäfte | 6,28 % |
| Sonstige Commercial Paper | 4,63 % | Sonstige Papiere | 5,15 % |
| Government Agency-Repogeschäft | 4,32 % | Government Agency-Repogeschäft | 4,71 % |
| Sonstige Papiere | 1,06 % | | |

BlackRock ICS Euro Liquidity Fund

Im vergangenen Jahr war unsere Anlagestrategie geprägt durch einen vorsichtigen, aber opportunistischen Ansatz unter Anpassung an die Veränderungen der Marktbedingungen und geopolitische Spannungen. Im vierten Quartal 2023 konzentrierten wir uns darauf, das Jahr mit einer Erhöhung unserer Allokation in Staatsanleihen zu beenden. Dies führte zu einem stetigen Rückgang der WAM von 30 Tagen, da wir es vorzogen, in Reaktion auf die zunehmenden geopolitischen Risiken die Liquidität bei 50% zu halten. Zu Beginn des ersten Quartals 2024 nutzten wir eine Verkaufswelle am Markt, um die WAM nach und nach auf 45 Tage zu erhöhen, während wir gleichzeitig unsere Liquiditätsposition aufrechterhielten. Mit Herannahen des zweiten Quartals erhöhten wir die WAM weiter auf 55 Tage und konzentrierten uns dabei vor dem Hintergrund erheblicher Unsicherheit im Hinblick auf Zinssenkungen seitens der EZB auf das Kurvensegment von 9 bis 12 Monaten. Diese Unsicherheit erhöhte sich noch durch einen angespannten Arbeitsmarkt und einen starken Dienstleistungssektor, was uns veranlasste, eine vorsichtige Haltung einzunehmen und verstärkt Liquidität vorzuhalten. Im dritten Quartal verlagerten wir mit steigenden Zinsen unseren Fokus auf das vordere Ende der Kurve und setzten auf kürzere Laufzeiten von 1 bis 4 Monaten. Gleichzeitig erhöht wir unser Engagement in zinsvariablen Anleihen. Diese strategische Anpassung ging einher mit deutlichen Zuflüssen, was zu einem Rückgang der WAM von 50 auf 41 Tage führte.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS Euro Liquidity Fund (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2024 und 30. September 2023 angegeben:

| 30. September 2024 | | 30. September 2023 | |
|--|------------|--|------------|
| Wertpapier | Gewichtung | Wertpapier | Gewichtung |
| Einlagenzertifikat | 34,43 % | Einlagenzertifikat | 26,49 % |
| Commercial Paper von Finanzunternehmen | 26,20 % | Commercial Paper von Finanzunternehmen | 25,50 % |
| Sonstige Repogeschäfte | 8,57 % | Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 14,31 % |
| Sonstige Commercial Paper | 7,54 % | Forderungsbesicherte Commercial Paper | 7,83 % |
| Government Agency-Repogeschäft | 7,43 % | Treasury Debt | 5,81 % |
| Forderungsbesicherte Commercial Paper | 6,97 % | Sonstige Repogeschäfte | 5,78 % |
| Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 6,76 % | Sonstige Papiere | 5,50 % |
| Sonstige Papiere | 1,31 % | Government Agency-Repogeschäft | 5,38 % |
| Treasury Debt | 0,78 % | Sonstige Commercial Paper | 3,40 % |

BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund

Im vergangenen Jahr haben wir unsere Anlagestrategie auf die Optimierung der Renditen bei gleichzeitiger Steuerung der Risiken in einem dynamischen Marktumfeld fokussiert. Im vierten Quartal 2023 hielten wir die Duration bei 0,2 bis 0,25 Jahren und investierten in neue 2-jährige FRNs. Gleichzeitig verstärkten wir unser Engagement in A2/P2 Euro Commercial Paper, da sich das Angebot am Markt verbesserte. Ende Dezember lag die Duration des Fonds bei 0,19 Jahren und die Spread-Duration bei 0,69 Jahren. Beides trug positiv zur Performance bei. Im ersten Quartal 2024 verlagerten wir unseren Fokus auf kurzfristige A2/P2-Emittenten. Damit erhöhten wir unser Engagement in zinsvariablen Titeln von 47% auf rund 50,2% und erzielten bei sich verengenden Kreditspreads attraktive Renditen von rund 4,40%. Unsere Strategie beinhaltete eine Diversifizierung über verschiedene Laufzeiten, was zu einer Spread-Duration von 0,63 Jahren zum Quartalsende führte. Im zweiten Quartal verstärkten wir weiter den Schwerpunkt auf kurzfristigen A2/P2-Emittenten mit Laufzeiten von 1 bis 3 Monaten. Gleichzeitig erhöhten wir in Erwartung einer möglichen Zinssenkung durch die EZB das Engagement in 6- und 12-monatigen festverzinslichen Titeln. Dadurch hielten wir unsere Duration bis zum Quartalsende bei 0,25 Jahren und die Spread-Duration bei 0,60 Jahren. Im dritten Quartal 2024 schließlich hielten wir unsere Duration nahe an der Benchmark, indem wir 5- und 6-monatige auf Euro lautende Commercial Paper ins Portfolio aufnahmen und über 2-jährige FRNs unser Kreditengagement erhöhten. Hierdurch erreichten wir bis Ende September eine Duration von 0,23 Jahren und eine Spread-Duration von 0,52 Jahren. Die Strategie blieb in den letzten 12 Monaten fokussiert auf Diversifizierung und eine sorgfältige Steuerung der Kreditrisiken unter Anpassung an die Veränderungen der Marktbedingungen.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2024 und 30. September 2023 angegeben:

| 30. September 2024 | | 30. September 2023 | |
|---|------------|--|------------|
| Wertpapier | Gewichtung | Wertpapier | Gewichtung |
| Sonstige Papiere | 40,53 % | Commercial Paper von Finanzunternehmen | 39,36 % |
| Commercial Paper von Finanzunternehmen | 16,30 % | Sonstige Papiere | 24,02 % |
| Einlagenzertifikat | 13,78 % | Einlagenzertifikat | 8,92 % |
| Sonstige Commercial Paper | 11,67 % | Sonstige Commercial Paper | 8,56 % |
| Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 5,74 % | Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 8,49 % |
| Forderungsbesicherte Commercial Paper | 5,10 % | Forderungsbesicherte Commercial Paper | 7,55 % |
| Finanzierungsvereinbarung von Versicherungsgesellschaften | 4,83 % | Investmentgesellschaft | 3,10 % |
| Investmentgesellschaft | 2,03 % | | |

BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund

Die BoE hielt ihren Leitzins 2024 bei 5,25%, bis schließlich im August der geldpolitische Ausschuss („MPC“) mit 5:4 Stimmen für eine Senkung um 25 Basispunkte auf 5,00% votierte. Für einige Mitglieder, die angesichts des Nachlassens externer Schocks und der Fortschritte bei der Reduzierung der Inflationsrisiken eine leichte Lockerung der restriktiven Geldpolitik für angemessen hielten, war die Entscheidung sorgfältig abgestimmt. Vier Mitglieder waren allerdings anderer Meinung und meldeten Bedenken hinsichtlich der Inflation im Dienstleistungssektor, unerwartet positiver BIP-Daten und des hartnäckigen Inflationsdrucks im Inland an.

Der MPC erwartete für dieses Jahr aufgrund von Basiseffekten im Energiebereich einen Inflationsanstieg auf rund 2,75%, aber einen Rückgang auf 2% in zwei Jahren.

Zum Ende des Berichtszeitraums war der Verbraucherpreisindex („VPI“) von 4% im Januar 2024 auf 1,7% im September gefallen. Diese Zahl liegt unter der Prognose von 2,1%, die die BoE im August abgegeben hatte.

Das Vereinigte Königreich trat Ende 2023 in eine technische Rezession ein, zeigte aber im 1. Quartal 2024 Anzeichen einer Erholung mit einem BIP-Anstieg um 0,7%, gefolgt von 0,5% im 2. Quartal 2024. Die Arbeitslosenquote stieg im Jahresverlauf von 3,90% im vierten Quartal 2023 auf 4,17% im März 2024. Im Juni 2024 lag sie schließlich bei 4,33%.

Am 22. Mai beantragte Rishi Sunak beim britischen König die Genehmigung zur Auflösung des Parlaments und kündigte für den 4. Juli Neuwahlen an. Das Parlament wurde am 24. Mai vertagt und am 30. Mai aufgelöst, die Neuwahlen auf 25 Werkstage danach angesetzt. Die von Keir Starmer geführte Labour-Partei errang schließlich in den Parlamentswahlen einen deutlichen Sieg.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund (Fortsetzung)

Unsere Anlagestrategie war im vergangenen Jahr geprägt durch einen vorsichtigen Ansatz, bei dem wir in Reaktion auf Marktvolatilität und Wirtschaftslage Liquidität und kurzfristige Instrumente priorisierten. Im vierten Quartal 2023 setzten wir den Fokus auf kurzfristige Repo-Anlagen und fügten bei steigenden Repo-Zinsen und volatilen, von aktuellen Daten und Ankündigungen fiskalischer Anreize beeinflussten Kursen strategisch Schatzwechsel mit Laufzeiten von 1, 3 und 6 Monaten hinzu. Eine Senkung der Zielvorgaben für Schatzwechsel für das Haushaltsjahr durch das britische Amt für Schuldenmanagement (Debt Management Office, „DMO“) hatte keine wesentlichen Auswirkungen auf den Markt für Schatzwechsel, weil das DMO für Liquiditätsmanagementzwecke weiter Schatzwechsel begeben konnte. Im ersten Quartal 2024 knüpften wir an unsere vorsichtige Strategie an, indem wir unsere WAM von rund 20 Tagen auf 35 Tage erhöhten. Zu diesem Zweck nahmen wir britische Schatzwechsel mit verschiedenen kurzen Laufzeiten ins Portfolio auf. Diesen Trend setzten wir auch im zweiten Quartal fort und erhöhten die WAM auf 42 Tage. Gleichzeitig hielten wir eine bedeutende Allokation in Overnight-Repos und nahmen weitere britische Schatzwechsel mit Laufzeiten von 3 und 6 Monaten auf. Im dritten Quartal verlängerten wir strategisch unsere Duration durch Aufnahme von sechsmonatigen Schatzwechseln und ließen gleichzeitig Anlagen mit kürzerer Duration einfließen, als die Marktpreise die Erwartungen von Zinssenkungen widerspiegeln. Wir überwachten aktiv die Balance zwischen der Erhöhung der Duration und Anlagen in Overnight-Repos und nahmen Gelegenheiten für Anlagen in drei- und sechsmonatigen Schatzwechseln zu wettbewerbsfähigen Renditen wahr. Unsere Strategie war im Berichtszeitraum geprägt von einem umsichtigen Fokus auf ausreichend Liquidität, während wir uns gleichzeitig an die sich veränderten Marktbedingungen und -erwartungen anpassten.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2024 und 30. September 2023 angegeben:

| 30. September 2024 | | 30. September 2023 | |
|--------------------------------|------------|--------------------------------|------------|
| Wertpapier | Gewichtung | Wertpapier | Gewichtung |
| Treasury-Repogeschäft | 45,02 % | Sonstige Repogeschäfte | 60,53 % |
| Government Agency-Repogeschäft | 29,68 % | Government Agency-Repogeschäft | 29,29 % |
| Treasury Debt | 25,30 % | Treasury Debt | 10,18 % |

BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund

Im vergangenen Jahr war unsere Anlagestrategie geprägt von einem Fokus auf Liquidität und einem vorsichtigen Durationsmanagement in Reaktion auf die Entwicklungen der Marktbedingungen und Zentralbanksignale. Im vierten Quartal 2023 musste sich die BOE mit Veränderungen der Markterwartungen auseinandersetzen. Zunächst wurde für das erste Quartal 2024 eine Zinserhöhung um 25 Basispunkte erwartet, später kehrte sich vor dem Hintergrund der geopolitischen Spannungen diese Erwartung in eine Erwartung von Zinssenkungen bis Dezember 2024 um. Diese Rahmenbedingungen veranlassten uns zu einem weichen WAM-Ziel von 50 Tagen, während wir die Anlagen auf den 3- bis 6-monatigen Bereich konzentrierten, um angesichts unsicherer Kapitalflüsse von Seiten der Kunden die Liquidität zu steuern. Die Hinweise des MPC auf mögliche Zinserhöhungen verhinderten nicht, dass die Markterwartungen sich in Richtung deutlicher Zinssenkungen verschoben und schließlich Zinssenkungen in Höhe von 145 Basispunkten bis Dezember 2024 prognostiziert wurden. Im ersten Quartal 2024 hielten wir unsere WAM bei ca. 50 Tagen und nahmen selektiv hochwertige Wertpapiere, überwiegend im Laufzeitenbereich von 3 bis 9 Monaten, ins Portfolio auf, zogen aber auch fest- und variabel verzinsliche Wertpapiere mit Laufzeiten von bis zu einem Jahr in Erwägung. Dieser vorsichtige Ansatz erlaubte uns, die Rendite zu optimieren und gleichzeitig Liquidität zu priorisieren. Wir setzten diese Strategie auch im zweiten Quartal fort mit einem anhaltenden Fokus auf hochwertigen Namen und einem ähnlichen Laufzeitenprofil. Dabei bereiteten wir uns auf eine Neubewertung unserer Positionierung zu Beginn des dritten Quartals vor. Bis zum dritten Quartal 2024 dehnten wir im Vorfeld der August-Sitzung des MPC strategisch unsere Duration in das 6- bis 9-Monatssegment aus und erzielten damit Renditen zwischen 5,25% und 5,30%. Wir hielten die WAM bei rund 55 Tagen und konnten so von der Marktvolatilität profitieren. Gleichzeitig nahmen wir weitere Positionen im Laufzeitenbereich von 4 bis 6 Monaten ins Portfolio auf, außerdem einen 1-jährigen SONIA-Floater, da wir davon ausgingen, dass der MPC die Zinsen im September stabil halten würde. Unsere Strategie war flexibel mit Schwerpunkt auf Liquiditätsmanagement und sorgfältigen Durationsanpassungen in einer sich rapide verändernden Marktlandschaft.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2024 und 30. September 2023 angegeben:

| 30. September 2024 | | 30. September 2023 | |
|--|------------|--|------------|
| Wertpapier | Gewichtung | Wertpapier | Gewichtung |
| Einlagenzertifikat | 34,87 % | Einlagenzertifikat | 24,57 % |
| Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 16,96 % | Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 21,95 % |
| Treasury-Repogeschäft | 16,66 % | Treasury-Repogeschäft | 20,00 % |
| Government Agency-Repogeschäft | 11,15 % | Government Agency-Repogeschäft | 16,52 % |
| Sonstige Papiere | 8,62 % | Sonstige Papiere | 7,04 % |
| Commercial Paper von Finanzunternehmen | 7,75 % | Commercial Paper von Finanzunternehmen | 5,64 % |
| Forderungsbesicherte Commercial Paper | 2,41 % | Forderungsbesicherte Commercial Paper | 3,33 % |
| Sonstige Commercial Paper | 1,58 % | Sonstige Commercial Paper | 0,96 % |

BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund

Im vergangenen Jahr war unsere Anlagestrategie geprägt von einem Fokus auf Liquidität und einem vorsichtigen Durationsmanagement in Reaktion auf die Entwicklungen der Marktbedingungen und Zentralbanksignale. Im vierten Quartal 2023 musste sich die BOE mit Veränderungen der Markterwartungen auseinandersetzen. Zunächst wurde für das erste Quartal 2024 eine Zinserhöhung um 25 Basispunkte erwartet, später kehrte sich vor dem Hintergrund der geopolitischen Spannungen diese Erwartung in eine Erwartung von Zinssenkungen bis Dezember 2024 um. Diese Rahmenbedingungen veranlassten uns zu einem weichen WAM-Ziel von 50 Tagen, während wir die Anlagen auf den 3- bis 6-monatigen Bereich konzentrierten, um angesichts unsicherer Kapitalflüsse von Seiten der Kunden die Liquidität zu steuern. Die Hinweise des MPC auf mögliche Zinserhöhungen verhinderten nicht, dass die Markterwartungen sich in Richtung deutlicher Zinssenkungen verschoben und schließlich Zinssenkungen in Höhe von 145 Basispunkten bis Dezember 2024 prognostiziert wurden. Im ersten Quartal 2024 hielten wir unsere WAM bei ca. 50 Tagen und nahmen selektiv hochwertige Wertpapiere, überwiegend im Laufzeitenbereich von 3 bis 9 Monaten, ins Portfolio auf, zogen aber auch fest- und variabel verzinsliche Wertpapiere mit Laufzeiten von bis zu einem Jahr in Erwägung. Dieser vorsichtige Ansatz erlaubte uns, die Rendite zu optimieren und gleichzeitig Liquidität zu priorisieren. Wir setzten diese Strategie auch im zweiten Quartal fort mit einem anhaltenden Fokus auf hochwertigen Namen und einem ähnlichen Laufzeitenprofil. Dabei bereiteten wir uns auf eine Neubewertung unserer Positionierung zu Beginn des dritten Quartals vor. Bis zum dritten Quartal 2024 dehnten wir im Vorfeld der August-Sitzung des MPC strategisch unsere Duration in das 6- bis 9-Monatssegment aus und erzielten damit Renditen zwischen 5,25% und 5,30%. Wir hielten die WAM bei rund 55 Tagen und konnten so von der Marktvolatilität profitieren. Gleichzeitig nahmen wir weitere Positionen im Laufzeitenbereich von 4 bis 6 Monaten ins Portfolio auf, außerdem einen 1-jährigen SONIA Floater, da wir von ausgingen, dass der MPC die Zinsen im September stabil halten würde. Unsere Strategie war flexibel mit Schwerpunkt auf Liquiditätsmanagement und sorgfältigen Durationsanpassungen in einer sich rapide verändernden Marktlandschaft.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2024 und 30. September 2023 angegeben:

| 30. September 2024 | | 30. September 2023 | |
|---|------------|---|------------|
| Wertpapier | Gewichtung | Wertpapier | Gewichtung |
| Einlagenzertifikat | 43,26 % | Einlagenzertifikat | 39,52 % |
| Commercial Paper von Finanzunternehmen | 12,75 % | Commercial Paper von Finanzunternehmen | 18,00 % |
| Treasury-Repogeschäft | 12,55 % | Treasury-Repogeschäft | 13,30 % |
| Sonstige Papiere | 10,33 % | Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 11,80 % |
| Government Agency-Repogeschäft | 8,20 % | Sonstige Papiere | 10,36 % |
| Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 8,11 % | Forderungsbesicherte Commercial Paper | 2,62 % |
| Forderungsbesicherte Commercial Paper | 3,13 % | Government Agency-Repogeschäft | 2,04 % |
| Finanzierungsvereinbarung von Versicherungsgesellschaften | 1,21 % | Finanzierungsvereinbarung von Versicherungsgesellschaften | 1,47 % |
| Sonstige Commercial Paper | 0,46 % | Treasury Debt | 0,51 % |
| | | Sonstige Commercial Paper | 0,38 % |

BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund

Im vergangenen Jahr hat unsere Anlagestrategie in Erwartung möglicher Zinssenkungen durch die BoE zur Jahresmitte 2024 den Schwerpunkt auf eine lange Durationsposition gesetzt. Ab dem vierten Quartal 2023 erhöhten wir bei Marktrücksetzern strategisch die Duration und konzentrierten uns dabei insbesondere auf den mittleren Teil der Geldmarktkurve über Titel mit 6-monatiger Restlaufzeit, um das lange Durationsengagement auszubalancieren und gleichzeitig vor dem Hintergrund der geopolitischen Unsicherheiten und der Verwerfungen im Zusammenhang mit Wahlen das Durationsrisiko abzumildern. Dieser Ansatz führte zu einer Erhöhung der Fondsduration von 0,22 Jahren Ende September auf 0,27 Jahre im Dezember. Im ersten Quartal 2024 bauten wir diese Strategie weiter aus, indem wir die Duration verlängerten, insbesondere im 1-Jahres-Segment der Kurve, um uns gegen mögliche Zinssenkungen abzusichern. Ende März erhöhte sich die Duration des Fonds auf 0,32 Jahre. Wir investierten außerdem überschüssigen Liquidität in A2/P2-Kredite mit Laufzeiten von bis zu 3 Monaten, die bei minimalen Auswirkungen auf die Spread-Duration gute Renditen abwarfen. Gleichzeitig loteten wir währungsübergreifende Gelegenheiten aus. Im zweiten Quartal behielten wir unseren Fokus auf dem einjährigen Bereich der Kurve sowohl bei fest- als auch bei variabel verzinslichen Titeln bei und hielten damit eine Duration von 0,32 Jahren aufrecht, während wir weiter überschüssige Liquidität am vorderen Ende der Kurve einsetzten. Im dritten Quartal 2024 blieben wir unserer langen Durationsstrategie treu, dabei schwankte unsere Duration zwischen 0,28 und 0,36 Jahren. Zusätzlich nahmen wir einjährige Positionen ins Portfolio auf, um den negativen Carry zu begrenzen und gleichzeitig von Renditen nahe der Overnight Rate zu profitieren. Wir nahmen außerdem SONIA-Floater auf und hielten weiter Ausschau nach Anlagegelegenheiten in den USD/EUR-Cross-Currency-Märkten. Ende September stabilisierte sich unsere Duration bei 0,32 Jahren, während die Spread-Duration bei 0,43 Jahren lag. Dies spiegelte unser anhaltendes Engagement für ein ausgewogenes und opportunistisches Portfolio vor dem Hintergrund wechselnder Marktbedingungen wider.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2024 und 30. September 2023 angegeben:

| 30. September 2024 | | 30. September 2023 | |
|---|------------|--|------------|
| Wertpapier | Gewichtung | Wertpapier | Gewichtung |
| Einlagenzertifikat | 50,04 % | Einlagenzertifikat | 32,83 % |
| Sonstige Papiere | 17,36 % | Commercial Paper von Finanzunternehmen | 30,76 % |
| Commercial Paper von Finanzunternehmen | 13,47 % | Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 14,74 % |
| Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 8,48 % | Sonstige Commercial Paper | 11,04 % |
| Sonstige Commercial Paper | 6,92 % | Forderungsbesicherte Commercial Paper | 7,21 % |
| Forderungsbesicherte Commercial Paper | 2,01 % | Investmentgesellschaft | 3,42 % |
| Finanzierungsvereinbarung von Versicherungsgesellschaften | 1,74 % | | |

BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund

Die Strategie des Fonds zeichnete sich angesichts der volatilen Marktsituation und der Zinsänderungen das ganze Jahr über durch einen vorsichtigen Ansatz aus. Im vierten Quartal 2022 behielt der Fonds ein hohes Maß an Liquidität bei und konzentrierte sich auf festverzinsliche Anlagen mit kurzen Laufzeiten und einer WAM von 20 bis 25 Tagen. Auch im ersten Quartal 2023 setzte der Fonds seinen vorsichtigen Ansatz fort. Er hielt die WAM nahe der Marke von 30 Tagen und konzentrierte sich auf Anlagen mit einem höheren Rating. Im zweiten Quartal reagierte der Fonds auf die steiler werdende USD-LIBOR-Kurve, indem er eine neutrale Durationpositionierung mit einer WAM von nahezu 30 Tagen beibehielt. Zum Ende des dritten Quartals weitete der Fonds sein Durationsziel mit Umsicht aus, indem er in festverzinsliche Anlagen mit einer Laufzeit von mindestens drei Monaten reinvestierte und die WAM auf einen Kurs von 40-45 Tage brachte.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2024 und 30. September 2023 angegeben:

| 30. September 2024 | | 30. September 2023 | |
|--|------------|--|------------|
| Wertpapier | Gewichtung | Wertpapier | Gewichtung |
| Einlagenzertifikat | 34,83 % | Commercial Paper von Finanzunternehmen | 33,98 % |
| Commercial Paper von Finanzunternehmen | 29,81 % | Einlagenzertifikat | 25,85 % |
| Government Agency-Repogeschäft | 14,02 % | Government Agency-Repogeschäft | 22,26 % |
| Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 10,17 % | Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 7,78 % |
| Sonstige Commercial Paper | 5,14 % | Treasury-Repogeschäft | 3,04 % |
| Forderungsbesicherte Commercial Paper | 3,06 % | Sonstige Commercial Paper | 2,93 % |
| Treasury Debt | 1,54 % | Forderungsbesicherte Commercial Paper | 2,42 % |
| Sonstige Papiere | 1,08 % | Treasury Debt | 1,11 % |
| Treasury-Repogeschäft | 0,35 % | Sonstige Papiere | 0,64 % |

BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund

Zu Beginn des Berichtszeitraums deuteten expansive Kommentare der Fed darauf hin, dass der Zinszyklus in den USA den Zenit überschritten hatte und sich der Fokus in Richtung einer Lockerung der Geldpolitik verschob. Dies führte zu einem rapiden Renditerückgang bei längerfristigen Geldmarkttiteln und Anleihen. Im ersten Quartal 2024 erwarteten die Märkte Zinssenkungen von bis zu 160 Basispunkten für 2024, was eine Inversion der Geldmarktkurve im Bereich von 1 Monat bis 1 Jahr zur Folge hatte, getrieben von einem drastischen Rückgang der 1-jährigen Renditen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund (Fortsetzung)

Da die Märkte davon ausgingen, dass die Fed in der zweiten Jahreshälfte zu einer expansiveren Geldpolitik übergehen würde, war zu Beginn des Quartals eine Zinssenkung um 25 Basispunkte bis Ende 2024 schon voll eingepreist.

Die Märkte reagierten dann aber im Sommer schnell auf die Erwartung einer aggressiveren geldpolitischen Lockerung und preisten Mitte August bereits mehr als 3 Zinssenkungen bis zum Ende des Geschäftsjahres 2024 ein, was zu einer zusätzlichen Inversion der Geldmarktkurve führte. Diese Veränderungen erfolgten unter Berücksichtigung der grundsätzlichen Widerstandsfähigkeit der US-Wirtschaft, die die Fed dahingehend beeinflussen konnte, dass sie bei Zinssenkungen einen maßvolleren Ansatz wählen würde.

Nachdem der FOMC auf 8 aufeinanderfolgenden Sitzungen die Spanne der Federal Funds Rate unverändert bei 5,25%-5,50% belassen hatte, läutete der Ausschuss auf seiner September-Sitzung mit einer Senkung des Leitzinses um 50 Basispunkte den Prozess einer Normalisierung der Geldpolitik ein. Mit dieser Anpassung nach unten lag die neue Spanne zwischen 4,75% und 5,00%.

Darüber hinaus aktualisierte der Ausschuss seine vierteljährliche Zusammenfassung der Wirtschaftsprognosen („SEP“). Die SEP enthielt die Andeutung, dass eine Mehrheit der Ausschussmitglieder (10 von 19) Zinssenkungen um weitere 50 Basispunkte auf den verbleibenden zwei Sitzungen 2024 befürwortete. 7 Mitglieder unterstützten eine Zinssenkung um weitere 25 Basispunkte bis zum Jahresende, während 2 Mitglieder sich gegen weitere Zinssenkungen im Jahr 2024 aussprachen. Die Entscheidung für eine umfangreichere erste Zinssenkung kommentierte der Vorsitzende Jerome Powell mit den Worten: „Diese Entscheidung spiegelt unser wachsendes Vertrauen wider, dass mit einer angemessenen Neukalibrierung unserer geldpolitischen Positionierung die Stärke des Arbeitsmarktes in einem Kontext moderaten Wachstums und einer nachhaltig auf 2% sinkenden Inflation aufrechterhalten werden kann“. Er warnte jedoch davor, davon auszugehen, dass diese Zinssenkung um 50 Basispunkte ein Tempo vorgebe, das die geldpolitischen Entscheidungsträger im Zuge der weiteren Normalisierung der Geldpolitik beibehalten würden, und bekräftigte die Auffassung, dass der Ausschuss sich weiterhin an der Gesamtheit der eingehenden Daten orientieren werde, um das angemessene Tempo für die Zinssenkungen zu bestimmen, die erforderlich seien, um den Endsatz der Fed Funds Rate zu erreichen.

Die geldpolitischen Entscheidungsträger wiesen zwar darauf hin, dass sie die Risiken für Beschäftigung und Inflation als ausgewogener betrachteten, gleichzeitig merkte Powell jedoch in der begleitenden Pressekonferenz an, dass der Ausschuss sich „nachdrücklich für die Förderung einer maximalen Beschäftigung einsetzt“. Damit ließ er im Grunde die Tür offen für künftige umfangreiche Zinssenkungen, sollte der Arbeitsmarkt unerwartet Anzeichen einer deutliche Verschlechterung zeigen.

Im vierten Quartal 2023 passten wir unsere Anlagestrategie an die sich verändernden Marktbedingungen an und erhöhten im Oktober unser Engagement in umgekehrten Repogeschäften mit dem Ziel von Rendite- und Liquiditätsverbesserungen. Im November verlängerten wir die Portfolioduration, um die anhaltende Nachfrage nach Geldmarktfonds zu decken, und gingen im Dezember zu einer Barbell-Strategie über, indem wir in Erwartung einer entspannteren Geldpolitik die Repogeschäfte zugunsten von längerfristigen festverzinslichen Wertpapieren reduzierten. Mit Beginn des ersten Quartals 2024 strebten wir eine WAM von 45 Tagen und eine gewichtete durchschnittliche Laufzeit („WAL“) von 69 Tagen an mit einem ausgewogenen Verhältnis zwischen Repogeschäften und US-Staatsanleihen. Daraus ergab sich eine Allokation von 55% in US-Staatsanleihen und 43% in Repogeschäften. Im zweiten Quartal knüpften wir an unseren Barbell-Ansatz an und erhöhten die Allokation in US-Staatsanleihen auf 72%, während wir das Engagement in Repogeschäften auf 27% zurückfuhren und in Erwartung von mindestens einer Senkung der Fed Funds Rate ein festverzinsliches Risiko im 4- bis 6-Monatsbereich eingingen. Im dritten Quartal 2024 konzentrierten wir uns darauf, die Verlängerung der Duration mit einer soliden Liquidität in Einklang zu bringen, was zu einer Reduzierung der WAM von 42 Tagen auf 32 Tage und einer Erhöhung des Engagements in Repogeschäften auf 42% führte, um angesichts der Marktvolatilität die Liquidität zu verbessern. Gleichzeitig hielten wir an unserer Strategie fest, da der FOMC sich auf die Stützung des Arbeitsmarktes verlegte, und hielten aktiv nach attraktiven Anlagegelegenheiten Ausschau.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2024 und 30. September 2023 angegeben:

| 30. September 2024 | | 30. September 2023 | |
|--|------------|--|------------|
| Wertpapier | Gewichtung | Wertpapier | Gewichtung |
| Einlagenzertifikat | 39,38 % | Commercial Paper von Finanzunternehmen | 34,00 % |
| Commercial Paper von Finanzunternehmen | 38,50 % | Einlagenzertifikat | 30,72 % |
| Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 8,75 % | Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 14,59 % |
| Government Agency-Repogeschäft | 5,63 % | Government Agency-Repogeschäft | 12,99 % |
| Sonstige Commercial Paper | 3,22 % | Sonstige Commercial Paper | 3,25 % |
| Forderungsbesicherte Commercial Paper | 1,92 % | Forderungsbesicherte Commercial Paper | 1,71 % |
| Treasury Debt | 1,34 % | Treasury Debt | 1,24 % |
| Treasury-Repogeschäft | 0,73 % | Treasury-Repogeschäft | 1,09 % |
| Sonstige Papiere | 0,53 % | Sonstige Papiere | 0,41 % |

BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund

Die Strategie des Fonds zeichnete sich über das gesamte Jahr hinweg durch einen vorsichtigen Ansatz aus, insbesondere während des Zinserhöhungszyklus. Im vierten Quartal 2022 blieb der Fonds bei einer hohen täglichen Liquidität und konzentrierte sich auf Wertpapiere mit kurzen Laufzeiten. Diese defensive Haltung wurde auch im ersten Quartal 2023 beibehalten, wobei der Schwerpunkt auf sehr kurzen Laufzeiten lag. Im zweiten Quartal nutzte der Fonds die Preisadjustierungen am Markt und investierte in Emittenten mit einer hohen Bonität. Im dritten Quartal weitete der Fonds sein Durationsziel vorsichtig aus und konzentrierte sich auf festverzinsliche Wertpapiere mit längerer Laufzeit sowie auf ausgewählte zweijährige variabel verzinsliche Anlagen. Dadurch bedingt schloss der Fonds den Berichtszeitraum mit einer Duration von nahezu 0,25 Jahren.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2024 und 30. September 2023 angegeben:

| 30. September 2024 | | 30. September 2023 | |
|--|------------|--|------------|
| Wertpapier | Gewichtung | Wertpapier | Gewichtung |
| Einlagenzertifikat | 28,30 % | Einlagenzertifikat | 32,18 % |
| Commercial Paper von Finanzunternehmen | 27,33 % | Commercial Paper von Finanzunternehmen | 31,69 % |
| Sonstige Commercial Paper | 19,50 % | Sonstige Commercial Paper | 22,03 % |
| Sonstige Papiere | 15,68 % | Sonstige Papiere | 5,53 % |
| Investmentgesellschaft | 4,47 % | Investmentgesellschaft | 4,54 % |
| Sonstige Instrumente (Termineinlagen) | 2,92 % | Forderungsbesicherte Commercial Paper | 1,79 % |
| Forderungsbesicherte Commercial Paper | 1,21 % | Treasury Debt | 1,63 % |
| Finanzierungsvereinbarung von | | Finanzierungsvereinbarung von | |
| Versicherungsgesellschaften | 0,60 % | Versicherungsgesellschaften | 0,60 % |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund (Fortsetzung)

BlackRock ICS US Treasury Fund

Während des gesamten Jahres zeichnete sich der Fonds durch einen konservativen Ansatz aus, wobei der Schwerpunkt auf Liquidität lag. Im vierten Quartal 2022 erhöhte der Fonds seine Allokation zu Repogeschäften auf 61 % und reduzierte die Bestände an US-Staatsanleihen auf 35 %. Im ersten Quartal 2023 stieg der Anteil der Repos auf 90 %, während der Anteil der US-Staatsanleihen auf 10 % sank. Diese Umschichtung führte zu einer deutlichen Verringerung sowohl der WAM als auch der WAL. Der Fonds baute seine Duration im zweiten Quartal mit Bedacht aus, indem er mehr in kurzlaufende US-Staatsanleihen investierte. Im dritten Quartal kam es zu bemerkenswerten Verschiebungen in der Zusammensetzung des Fonds, wobei die WAM und die WAL Schwankungen ausgesetzt waren und das Engagement in Repogeschäften auf 56,63 % zurückging.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2024 und 30. September 2023 angegeben:

| 30. September 2024 | | 30. September 2023 | |
|-----------------------|------------|-----------------------|------------|
| Wertpapier | Gewichtung | Wertpapier | Gewichtung |
| Treasury Debt | 59,53 % | Treasury-Repogeschäft | 56,63 % |
| Treasury-Repogeschäft | 40,47 % | Treasury Debt | 43,37 % |

BlackRock Investment Management (UK) Limited
BlackRock Capital Management, Inc.
Oktober 2024

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES VERWALTUNGSRATS

Der Verwaltungsrat legt seinen Bericht zusammen mit dem geprüften Abschluss für das am 30. September 2024 beendete Geschäftsjahr vor.

Erklärung über die Obliegenheiten des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat ist verantwortlich für die Erstellung des Jahresberichts und des geprüften Jahresabschlusses gemäß den irischen Gesetzen und dem Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), dem im Vereinigten Königreich und der Republik Irland geltenden Rechnungslegungsstandard, herausgegeben vom Financial Reporting Council, und in Einklang mit den Bestimmungen des irischen Companies Act von 2014 in der jeweils gültigen Fassung und den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Vorschriften“).

Gemäß irischem Recht darf der Verwaltungsrat den geprüften Jahresabschluss erst genehmigen, wenn er sich vergewissert hat, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und Finanzlage des Unternehmens am Ende des Geschäftsjahres sowie der Gewinne oder Verluste des Unternehmens für das Geschäftsjahr vermittelt.

Bei der Erstellung dieser Abschlüsse ist der Verwaltungsrat gehalten:

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

Der Verwaltungsrat bestätigt, dass er bei der Erstellung des geprüften Jahresabschlusses die obigen Anforderungen erfüllt hat.

Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, angemessene Geschäftsbücher zu führen, die ausreichen um:

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

Die vom Verwaltungsrat ergriffenen Maßnahmen, um die Einhaltung der Verpflichtung des Unternehmens, angemessene Geschäftsbücher zu führen, sicherzustellen, sind die Ernennung der J.P. Morgan Administration Services (Ireland) Limited, sodass angemessene Geschäftsbücher geführt werden. Dementsprechend werden die Geschäftsbücher an folgender Adresse im Namen des Fondsverwalters geführt:

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

Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat dafür verantwortlich, das Vermögen des Unternehmens zu sichern und angemessene Maßnahmen zur Verhütung und Aufdeckung von betrügerischen Handlungen und sonstigen Unregelmäßigkeiten zu treffen. Gemäß der Gründungsurkunde des Unternehmens hat der Verwaltungsrat die Vermögenswerte des Unternehmens bei der Verwahrstelle in Verwahrung gegeben. Diesbezüglich hat der Verwaltungsrat gemäß den Bedingungen des Verwahrstellenvertrags die J.P. Morgan SE – Zweigniederlassung Dublin als Verwahrstelle bestellt. Deren Geschäftsadresse lautet wie folgt:

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

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

Entsprechenserklärung des Verwaltungsrats

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

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

Ergebnisse und Dividenden

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES VERWALTUNGSRATS (Fortsetzung)

Rückblick und zukünftige Entwicklungen

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

Risikomanagementziele und -strategien

Die Risiken, mit denen das Unternehmen konfrontiert ist, beziehen sich auf die von diesem gehaltenen Finanzinstrumente und sind in dem Abschnitt des Abschlusses über finanzielle Risiken dargelegt. Die Corporate-Governance-Erklärung des Unternehmens ist im Abschnitt Governance (Unternehmensführung) des Jahresabschlusses enthalten.

Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres

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

Beteiligungen und Geschäfte von Verwaltungsratsmitgliedern und Secretary

Die Verwaltungsratsmitglieder und der Secretary besaßen weder während noch am Ende des Geschäftsjahres Beteiligungen an den Anteilen des Unternehmens (2023: null).

Francis Drough ist nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied und ebenfalls ein Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe.

Kein Verwaltungsratsmitglied hatte zu irgendeinem Zeitpunkt während des Geschäftsjahres eine wesentliche Beteiligung an einem Vertrag mit Signifikanz für die Geschäftstätigkeit des Unternehmens (2023: null).

Unternehmensfortführung

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

Unabhängige Abschlussprüfer

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

Erklärung zu prüfungsrelevanten Informationen

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

Corporate Governance

Der Verwaltungsrat hat sich der Aufrechterhaltung der höchsten Corporate-Governance-Standards verpflichtet und zeichnet gegenüber den Anlegern für die Geschäftsführung des Unternehmens verantwortlich. Der Verwaltungsrat hat ein Corporate-Governance-Rahmenwerk eingeführt, das er in Bezug auf Investmentfonds für angemessen hält und das es dem Unternehmen ermöglichen wird, die betreffenden Bestimmungen des Corporate Governance Code for Collective Investment Schemes and Management Companies (Corporate Governance-Kodex für Investmentfonds und Verwaltungsgesellschaften) der Irish Funds Industry Association (der „Code“), der zum 1. Januar 2012 in Kraft trat, einzuhalten. Dieser Code ist zugänglich auf: <https://files.irishfunds.ie/1432820468-corporate-governance-code-for-collective-investment-schemes-and-management-companies.pdf>. Das Unternehmen hat diesen Code freiwillig übernommen, und wird den Code auf sämtliche Rechnungslegungszeiträume, die am oder nach dem Datum der Registrierung des Rechtsträgers beginnen, anwenden.

Für die Verwaltungsratsmitglieder

Verwaltungsratsmitglied

30. Januar 2025

Verwaltungsratsmitglied

30. Januar 2025

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DER VERWAHRSTELLE AN DIE ANTEILINHABER

Wir, die J.P. Morgan SE – Zweigniederlassung Dublin, ernannte Verwahrstelle für die Institutional Cash Series plc (das „Unternehmen“), legen diesen Bericht ausschließlich für die Anleger des Unternehmens als Gesamtheit für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024 (die „Rechnungsperiode“) vor. Dieser Bericht wird in Übereinstimmung mit den OGAW-Vorschriften – die Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 (Durchführungsverordnung Nr. 352 von 2011) in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Vorschriften“) erstellt. Durch Vorlage dieses Berichts übernehmen wir keine Verantwortung für einen anderen Zweck oder gegenüber anderen Personen, denen dieser Bericht gezeigt wird.

Gemäß unseren in den OGAW-Vorschriften festgelegten Pflichten als Verwahrstelle haben wir uns einen Überblick über die Geschäftstätigkeit des Unternehmens in der Rechnungsperiode verschafft und berichten den Anlegern des Fonds darüber wie folgt.

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

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

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

Für und im Namen von

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

30. Januar 2025

BERICHT DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS AN DIE VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER DES BLACKROCK ICS EURO GOVERNMENT LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND, DES BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND, DES BLACKROCK ICS STERLING GOVERNMENT LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND, DES BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND, DES BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND, DES BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND, DES BLACKROCK ICS US TREASURY FUND

Bericht über die Prüfung des Jahresabschlusses

Prüfvermerk

Wir haben den Jahresabschluss des BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund, des BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund, des BlackRock ICS Euro Liquidity Fund, des BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund, des BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund, des BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund, des BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund, des BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund, des BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund, des BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund, des BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund, des BlackRock ICS US Treasury Fund (die „Fonds“) für das am 30. September 2024 endende Geschäftsjahr geprüft. Der Jahresabschluss besteht aus der Gewinn- und Verlustrechnung, der Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens, der Bilanz, der Aufstellung der Vermögenswerte und den Anmerkungen zum Jahresabschluss, einschließlich der in Anmerkung 2 enthaltenen Zusammenfassung wesentlicher Bilanzierungsgrundsätze. Der Jahresabschluss wurde gemäß FRS 102, dem vom Financial Reporting Council herausgegebenen für das Vereinigte Königreich und die Republik Irland geltenden Bilanzierungsstandard, erstellt.

Unserer Auffassung nach:

- ein wahrheitsgetreues und angemessenes Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und Finanzlage der Fonds zum 30. September 2024 und seiner Ergebnisse für das dann endende Geschäftsjahr;
- wurde er gemäß den Bestimmungen von FRS 102, dem im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendende Bilanzierungsstandard, ordnungsgemäß aufgestellt;

Grundlage des Prüfvermerks

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

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

BERICHT DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS AN DIE VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER DES BLACKROCK ICS EURO GOVERNMENT LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND, DES BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND, DES BLACKROCK ICS STERLING GOVERNMENT LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND, DES BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND, DES BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND, DES BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND, DES BLACKROCK ICS US TREASURY FUND (FORTSETZUNG)

Schlussfolgerungen im Zusammenhang mit der fortgeführten Geschäftstätigkeit

Bei der Prüfung des Abschlusses sind wir zu dem Schluss gekommen, dass die Verwendung des Grundsatzes der fortgeführten Geschäftstätigkeit durch den Verwaltungsrat bei der Erstellung des Abschlusses angemessen ist.

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

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

Sonstige Angaben

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

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

Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

BERICHT DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS AN DIE VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER DES BLACKROCK ICS EURO GOVERNMENT LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND, DES BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND, DES BLACKROCK ICS STERLING GOVERNMENT LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND, DES BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND, DES BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND, DES BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND, DES BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND, DES BLACKROCK ICS US TREASURY FUND (FORTSETZUNG)

Jeweilige Aufgaben

Aufgaben des Verwaltungsrats im Zusammenhang mit dem Jahresabschluss

Wie in der Erklärung über Obliegenheiten des Verwaltungsrats auf Seite 13 näher erläutert, ist der Verwaltungsrat für die Aufstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit den geltenden Rechnungslegungsvorschriften zuständig und muss sich vergewissern, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt. Er ist außerdem für die nach seiner Auffassung erforderlichen internen Kontrollen verantwortlich, um eine Aufstellung von Abschlüssen zu ermöglichen, die keine wesentlichen Falschangaben enthalten, ob aufgrund von Betrug oder Irrtum.

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

Aufgaben der Abschlussprüfer im Zusammenhang mit der Abschlussprüfung

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

Eine ausführlichere Beschreibung unserer Aufgaben im Zusammenhang mit der Abschlussprüfung ist der Website der IAASA zu entnehmen unter: https://iaasa.ie/wp-content/uploads/docs/media/IAASA/Documents/audit-standards/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf. Diese Beschreibung ist Bestandteil unseres Berichts der Abschlussprüfer.

Der Zweck unserer Prüfungshandlungen und wem gegenüber wir verantwortlich sind

Dieser Bericht richtet sich ausschließlich an die Verwaltungsratsmitglieder der Fonds in ihrer Gesamtheit, in Übereinstimmung mit unserem Auftragsbestätigungsschreiben vom 8. März 2024. Unsere Prüfungsarbeit wurde so durchgeführt, dass wir den Verwaltungsratsmitgliedern der Fonds diejenigen Fakten mitteilen konnten, die ihnen in einem Bericht der Abschlussprüfer mitgeteilt werden müssen, nicht aber zu einem anderen Zweck. Soweit es das Gesetz zulässt, akzeptieren bzw. übernehmen wir die Verantwortung für unsere Prüfung, diesen Bericht bzw. die Meinungen, die wir uns gebildet haben, lediglich gegenüber den Fonds und den Verwaltungsratsmitgliedern der Fonds in ihrer Gesamtheit.

Ernst & Young Chartered Accountants

Dublin

Datum: XX. Januar 2025

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| | | BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS Euro Liquidity Fonds | | BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | |
|---|------|---|----------------|---|----------------|---------------------------------------|------------------|---|----------------|
| | | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Anm. | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Betriebliche Erträge | 5 | 99.653 | 21.197 | 264.041 | 167.434 | 2.228.157 | 1.145.285 | 196.139 | 150.477 |
| Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten | 7 | – | – | 3.129 | 840 | – | (381) | 7.098 | (16.696) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | | 99.653 | 21.197 | 267.170 | 168.274 | 2.228.157 | 1.144.904 | 203.237 | 133.781 |
| Betriebliche Aufwendungen | 6 | (3.680) | (892) | (4.858) | (4.450) | (63.209) | (47.527) | (3.361) | (3.762) |
| Betriebliche Nettoerträge/ (-aufwendungen) | | 95.973 | 20.305 | 262.312 | 163.824 | 2.164.948 | 1.097.377 | 199.876 | 130.019 |
| Finanzierungskosten: | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen | 8 | – | – | – | (818) | – | – | – | – |
| Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile | 9 | (27.928) | (4.325) | (21) | – | (445.052) | (99.195) | (6.105) | (652) |
| Finanzierungskosten insgesamt | | (27.928) | (4.325) | (21) | (818) | (445.052) | (99.195) | (6.105) | (652) |
| Nettogewinn/(-verlust) | | 68.045 | 15.980 | 262.291 | 163.006 | 1.719.896 | 998.182 | 193.771 | 129.367 |
| Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens | | 68.045 | 15.980 | 262.291 | 163.006 | 1.719.896 | 998.182 | 193.771 | 129.367 |

Außer den in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen Gewinnen und Verlusten gibt es im Geschäftsjahr keine anderen erfassten Gewinne oder Verluste.
Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| | Anm. | BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund 2024 | BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund 2023 | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund 2024 | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund 2023 | BlackRock ICS Sterling Liquidity Fonds 2024 | BlackRock ICS Sterling Liquidity Fonds 2023 | BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund 2024 | BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund 2023 |
|---|------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Betriebliche Erträge | 5 | 283.744 | 150.999 | 482.554 | 358.196 | 2.139.363 | 1.612.795 | 105.460 | 83.981 |
| Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten | 7 | – | – | 2.212 | 7.377 | – | – | 5.255 | 6.300 |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | | 283.744 | 150.999 | 484.766 | 365.573 | 2.139.363 | 1.612.795 | 110.715 | 90.281 |
| Betriebliche Aufwendungen | 6 | (6.677) | (4.283) | (6.187) | (5.805) | (40.077) | (39.183) | (1.479) | (1.433) |
| Betriebliche Nettoerträge/ (-aufwendungen) | | 277.067 | 146.716 | 478.579 | 359.768 | 2.099.286 | 1.573.612 | 109.236 | 88.848 |
| Finanzierungskosten: | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen | 8 | – | – | – | – | – | – | (391) | – |
| Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile | 9 | (55.591) | (14.929) | (186.412) | (167.885) | (1.775.926) | (1.394.416) | (20.826) | (20.545) |
| Finanzierungskosten insgesamt | | (55.591) | (14.929) | (186.412) | (167.885) | (1.775.926) | (1.394.416) | (21.217) | (20.545) |
| Nettogewinn/(-verlust) | | 221.476 | 131.787 | 292.167 | 191.883 | 323.360 | 179.196 | 88.019 | 68.303 |
| Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens | | 221.476 | 131.787 | 292.167 | 191.883 | 323.360 | 179.196 | 88.019 | 68.303 |

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

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| | | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fonds | | BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | | BlackRock ICS US Treasury Fund | |
|---|------|--|------------------|--|--------------------|--|----------------|--------------------------------|------------------|
| | | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Anm. | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Betriebliche Erträge | 5 | 226.406 | 182.133 | 3.877.587 | 2.735.344 | 310.817 | 229.542 | 1.323.445 | 863.938 |
| Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten | 7 | 2.993 | 1.323 | 71 | 34 | 18.444 | 7.958 | 1.193 | (4.681) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | | 229.399 | 183.456 | 3.877.658 | 2.735.378 | 329.261 | 237.500 | 1.324.638 | 859.257 |
| Betriebliche Aufwendungen | 6 | (1.879) | (1.557) | (82.678) | (66.451) | (5.662) | (4.504) | (34.746) | (27.171) |
| Betriebliche Nettoerträge/ (-aufwendungen) | | 227.520 | 181.899 | 3.794.980 | 2.668.927 | 323.599 | 232.996 | 1.289.892 | 832.086 |
| Finanzierungskosten: | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen | 8 | – | – | – | (2) | (1) | – | – | – |
| Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile | 9 | (172.271) | (161.604) | (2.904.123) | (2.135.272) | (4.793) | (4.174) | (1.181.253) | (788.642) |
| Finanzierungskosten insgesamt | | (172.271) | (161.604) | (2.904.123) | (2.135.274) | (4.794) | (4.174) | (1.181.253) | (788.642) |
| Nettogewinn/(-verlust) | | 55.249 | 20.295 | 890.857 | 533.653 | 318.805 | 228.822 | 108.639 | 43.444 |
| Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens | | 55.249 | 20.295 | 890.857 | 533.653 | 318.805 | 228.822 | 108.639 | 43.444 |

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

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| | BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund 2024 Tsd. EUR | BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund 2023 Tsd. EUR | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund 2024 Tsd. EUR | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund 2023 Tsd. EUR | BlackRock ICS Euro Liquidity Fonds 2024 Tsd. EUR | BlackRock ICS Euro Liquidity Fonds 2023 Tsd. EUR | BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund 2024 Tsd. EUR | BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund 2023 Tsd. EUR |
|--|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.501.327 | 39.412 | 6.357.471 | 4.911.186 | 46.145.021 | 35.552.647 | 5.095.997 | 5.175.821 |
| Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens | 68.045 | 15.980 | 262.291 | 163.006 | 1.719.896 | 998.182 | 193.771 | 129.367 |
| Geschäfte mit Anteilen: | | | | | | | | |
| Ausgabe von rückkaufbaren Anteilen | 13.941.400 | 3.875.298 | 47.969.379 | 48.338.025 | 263.640.694 | 230.511.462 | 3.792.125 | 4.577.394 |
| Rücknahme von rückkaufbaren Anteilen | (12.162.652) | (2.430.025) | (47.619.675) | (47.054.746) | (245.651.877) | (220.966.532) | (4.041.260) | (4.786.585) |
| Wiederangelegte Dividende | 8.102 | 662 | – | – | 178.985 | 49.262 | – | – |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen | 1.786.850 | 1.445.935 | 349.704 | 1.283.279 | 18.167.802 | 9.594.192 | (249.135) | (209.191) |
| Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 3.356.222 | 1.501.327 | 6.969.466 | 6.357.471 | 66.032.719 | 46.145.021 | 5.040.633 | 5.095.997 |

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)
Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| | BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund 2024 Tsd. GBP | BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund 2023 Tsd. GBP | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund 2024 Tsd. GBP | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund 2023 Tsd. GBP | BlackRock ICS Sterling Liquidity Fonds 2024 Tsd. GBP | BlackRock ICS Sterling Liquidity Fonds 2023 Tsd. GBP | BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund 2024 Tsd. GBP | BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund 2023 Tsd. GBP |
|--|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 4.657.984 | 2.776.444 | 9.486.416 | 8.096.237 | 35.332.178 | 33.509.587 | 2.394.871 | 1.621.682 |
| Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens | 221.476 | 131.787 | 292.167 | 191.883 | 323.360 | 179.196 | 88.019 | 68.303 |
| Geschäfte mit Anteilen: | | | | | | | | |
| Ausgabe von rückkaufbaren Anteilen | 23.804.498 | 18.142.100 | 37.386.404 | 40.106.462 | 226.184.234 | 220.101.505 | 1.148.606 | 1.623.342 |
| Rücknahme von rückkaufbaren Anteilen | (22.925.116) | (16.397.073) | (37.415.382) | (39.003.644) | (223.061.753) | (219.145.727) | (1.849.005) | (918.456) |
| Wiederangelegte Dividende | 11.043 | 4.726 | 109.139 | 95.478 | 903.996 | 687.617 | – | – |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen | 890.425 | 1.749.753 | 80.161 | 1.198.296 | 4.026.477 | 1.643.395 | (700.399) | 704.886 |
| Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 5.769.885 | 4.657.984 | 9.858.744 | 9.486.416 | 39.682.015 | 35.332.178 | 1.782.491 | 2.394.871 |

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)
Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund 2024 Tsd. USD | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund 2023 Tsd. USD | BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fonds 2024 Tsd. USD | BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fonds 2023 Tsd. USD | BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund 2024 Tsd. USD | BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund 2023 Tsd. USD | BlackRock ICS US Treasury Fund 2024 Tsd. USD | BlackRock ICS US Treasury Fund 2023 Tsd. USD |
|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 3.883.179 | 4.065.874 | 65.146.032 | 63.988.614 | 4.493.075 | 4.347.234 | 22.509.833 | 21.521.671 |
| Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens | 55.249 | 20.295 | 890.857 | 533.653 | 318.805 | 228.822 | 108.639 | 43.444 |
| Geschäfte mit Anteilen: | | | | | | | | |
| Ausgabe von rückkaufbaren Anteilen | 49.120.313 | 38.805.571 | 435.578.007 | 376.939.782 | 10.593.115 | 10.009.777 | 233.764.457 | 166.882.824 |
| Rücknahme von rückkaufbaren Anteilen | (48.750.172) | (39.058.538) | (421.118.517) | (377.317.681) | (8.513.740) | (10.092.758) | (227.864.052) | (166.260.950) |
| Wiederangelegte Dividende | 73.629 | 49.977 | 1.243.205 | 1.001.664 | – | – | 501.518 | 322.844 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen | 443.770 | (202.990) | 15.702.695 | 623.765 | 2.079.375 | (82.981) | 6.401.923 | 944.718 |
| Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 4.382.198 | 3.883.179 | 81.739.584 | 65.146.032 | 6.891.255 | 4.493.075 | 29.020.395 | 22.509.833 |

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BILANZ

Zum 30. September 2024

| | | BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | BlackRock ICS Euro Liquidity Fonds | BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | | | | |
|---|------|---|---|---------------------------------------|---|--------------------|--------------------|------------------|------------------|
| | Anm. | 2024 Tsd. EUR | 2023 Tsd. EUR | 2024 Tsd. EUR | 2023 Tsd. EUR | 2024 Tsd. EUR | 2023 Tsd. EUR | 2024 Tsd. EUR | 2023 Tsd. EUR |
| UMLAUFVERMÖGEN | | | | | | | | | |
| Zahlungsmittel | | 22.186 | 23.559 | 250.011 | 241.746 | 1.749.765 | 1.732.154 | 279.495 | 235.019 |
| Zahlungsmitteläquivalente | | – | – | – | – | – | – | 101.097 | – |
| Barsicherheiten | | 50 | 50 | – | – | 50 | 50 | 25 | 25 |
| Forderungen | 11 | 582 | 464 | 71.413 | 13.318 | 229.097 | 151.720 | 21.673 | 12.394 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 4 | 3.892.769 | 1.485.200 | 6.919.383 | 6.359.086 | 65.655.973 | 45.812.890 | 4.868.549 | 4.850.440 |
| Umlaufvermögen insgesamt | | 3.915.587 | 1.509.273 | 7.240.807 | 6.614.150 | 67.634.885 | 47.696.814 | 5.270.839 | 5.097.878 |
| KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN | | | | | | | | | |
| Verbindlichkeiten | 12 | (559.365) | (7.946) | (271.341) | (256.679) | (1.602.166) | (1.551.793) | (229.117) | (1.881) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet: | 4 | – | – | – | – | – | – | (1.089) | – |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt | | (559.365) | (7.946) | (271.341) | (256.679) | (1.602.166) | (1.551.793) | (230.206) | (1.881) |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | 14 | 3.356.222 | 1.501.327 | 6.969.466 | 6.357.471 | 66.032.719 | 46.145.021 | 5.040.633 | 5.095.997 |

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Für die Verwaltungsratsmitglieder

Verwaltungsratsmitglied

30. Januar 2025

Verwaltungsratsmitglied

30. Januar 2025

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BILANZ (Fortsetzung)
Zum 30. September 2024

| | | BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS Sterling Liquidity Fonds | | BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | |
|---|------|---|--------------------|---|-------------------|---|-------------------|---|------------------|
| | | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Anm. | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| UMLAUFVERMÖGEN | | | | | | | | | |
| Zahlungsmittel | | 135.180 | 135.549 | 325.937 | 325.617 | 1.701.825 | 1.700.184 | 100.407 | 101.130 |
| Zahlungsmitteläquivalente | | – | – | – | – | – | – | – | 85.000 |
| Forderungen | 11 | 5.769 | 6.196 | 72.559 | 30.157 | 131.720 | 285.061 | 8.694 | 4.280 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 4 | 6.552.465 | 5.745.150 | 9.882.815 | 9.732.644 | 38.922.214 | 33.983.478 | 1.733.283 | 2.401.068 |
| Umlaufvermögen insgesamt | | 6.693.414 | 5.886.895 | 10.281.311 | 10.088.418 | 40.755.759 | 35.968.723 | 1.842.384 | 2.591.478 |
| KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN | | | | | | | | | |
| Verbindlichkeiten | 12 | (923.529) | (1.228.911) | (422.567) | (602.002) | (1.073.744) | (636.545) | (59.893) | (195.749) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet: | 4 | – | – | – | – | – | – | – | (858) |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt | | (923.529) | (1.228.911) | (422.567) | (602.002) | (1.073.744) | (636.545) | (59.893) | (196.607) |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | | | | | | | | |
| | 14 | 5.769.885 | 4.657.984 | 9.858.744 | 9.486.416 | 39.682.015 | 35.332.178 | 1.782.491 | 2.394.871 |

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BILANZ (Fortsetzung)
Zum 30. September 2024

| | | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund 2024 | BlackRock ICS US Dollar Liquid Fonds 2023 | BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund 2024 | BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund 2023 | BlackRock ICS US Treasury Fund 2024 | BlackRock ICS US Treasury Fund 2023 | | |
|---|------|--|---|--|--|--|--|--------------------|-------------------|
| | Anm. | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | | |
| UMLAUFVERMÖGEN | | | | | | | | | |
| Zahlungsmittel | | 140.891 | 140.902 | 1.535.353 | 1.948.269 | 15.811 | 23.288 | 506.027 | 583.687 |
| Zahlungsmitteläquivalente | | – | – | – | – | 308.082 | 199.013 | – | – |
| Forderungen | 11 | 14.252 | 8.358 | 294.200 | 162.985 | 127.938 | 44.660 | 55.515 | 36.546 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 4 | 4.266.742 | 3.939.198 | 80.833.854 | 66.497.896 | 6.566.068 | 4.269.391 | 30.033.639 | 22.102.897 |
| Umlaufvermögen insgesamt | | 4.421.885 | 4.088.458 | 82.663.407 | 68.609.150 | 7.017.899 | 4.536.352 | 30.595.181 | 22.723.130 |
| KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN | | | | | | | | | |
| Verbindlichkeiten | 12 | (39.687) | (205.279) | (923.823) | (3.463.118) | (125.324) | (39.648) | (1.574.786) | (213.297) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet: | 4 | – | – | – | – | (1.320) | (3.629) | – | – |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt | | (39.687) | (205.279) | (923.823) | (3.463.118) | (126.644) | (43.277) | (1.574.786) | (213.297) |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | | | | | | | | |
| | 14 | 4.382.198 | 3.883.179 | 81.739.584 | 65.146.032 | 6.891.255 | 4.493.075 | 29.020.395 | 22.509.833 |

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS

1. Allgemeine Informationen

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

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

2.1 Grundlage für die Aufstellung des Abschlusses

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

Der Abschluss wird nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, modifiziert durch die erfolgswirksame Neubewertung der zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten und auf Basis der fortgeführten Geschäftstätigkeit.

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

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

Die wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze und Anmerkungen, die alle für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024 gelten, sind nachstehend aufgeführt.

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

2.2 Finanzinstrumente

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

2.2.1 Klassifizierung

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

2.2.2 Erfassung und Ausbuchung

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

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

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

2.2.3 Bewertung

Alle Finanzinstrumente werden erstmalig zum beizulegenden Zeitwert erfasst.

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

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

2.2.4 Bestimmung des beizulegenden Zeitwertes

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

- Anlagen in Schuldinstrumenten und börsengehandelten Derivaten, die an einem Markt oder einer Börse notiert oder gehandelt werden, werden auf der Grundlage der notierten Preise bewertet, die zu Abschlusszwecken der im Prospekt des Unternehmens beschriebenen Bewertungsmethode entsprechen. Je nach Art der zugrunde liegenden Anlage kann der Wert entweder zum Schlusskurs, zum Mittelkurs bei Handelsschluss oder zum Geldkurs am jeweiligen Markt ermittelt werden.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

2.2 Finanzinstrumente (Fortsetzung)

2.2.4 Bestimmung des beizulegenden Zeitwertes (Fortsetzung)

- Die Bewertung von Anlagen in börsengehandelte Fonds („ETF“), die an einem Markt oder einer Börse notiert, gelistet oder gehandelt werden, erfolgt auf der Grundlage der notierten Marktpreise bewertet, es sei denn, der Fonds handelt die von ihm gehaltenen Anteile in der Regel zum letzten NIW für diesen ETF. In solchen Fällen wird die Anlage in den ETF auf der Grundlage des letzten NIW des jeweiligen ETF bewertet.
- Anlagen in zentral geclearten Derivaten werden mittels Bewertungstechniken bewertet.
- Anlagen in Liquiditätspapieren wie beispielsweise Termineinlagen und umgekehrten Repogeschäften werden zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet. Angesichts der kurzfristigen Natur solcher Anlagen wird diese Methode als äquivalent zum beizulegenden Zeitwert betrachtet.

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

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

2.2.5 Finanzderivate und andere spezifische Instrumente

2.2.5.1 Terminkontrakte (Futures)

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

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

2.2.5.1 Devisenterminkontrakte

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

2.2.5.2 Umgekehrte Repogeschäfte

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

2.2.6 Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

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

2.2.7 Sachsicherheiten und Barsicherheiten

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

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

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

2.2.8 Rückkaufbare Anteile

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

Die rückkaufbaren Anteile können auf Wunsch der Inhaber zurückgenommen werden und erfüllen nicht die Bedingungen aus Section 22.4 von FRS 102 für eine Klassifizierung als Eigenkapital. Daher werden sie als finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert.

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

2.3 Fremdwährungen

2.3.1 Funktionale Währung und Darstellungswährung

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

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

Die Darstellungswährung der Abschlüsse des Unternehmens ist GBP.

2.3.2 Transaktionen und Salden

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

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

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

2.4 Kritische Bilanzschätzungen und -beurteilungen

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

2.4.1 Annahmen und Schätzungsunsicherheiten

2.4.1.1 Zeitwert der OTC-DFI

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

2.4.1.2 Zeitwert von nicht an einem aktiven Markt notierten Finanzinstrumenten

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

2.4.2 Beurteilungen

2.4.2.1 Bewertung als Anlageunternehmen

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

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

2.5 Zinserträge und Zinsaufwendungen

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

2.6 Gebühren und Aufwendungen

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

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

2.7 Negative Rendite bei finanziellen Vermögenswerten

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

2.8 Ausschüttungen

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

2.8 Ausschüttungen (Fortsetzung)

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

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

3. Finanzielle Risiken

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

3.1 Risikomanagementrahmen

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

3.2 Marktrisiko

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

Jeder Fonds ist durch seine Anlagen in Schuldinstrumenten und Derivaten einem Marktrisiko ausgesetzt.

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

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

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

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

| Name des Fonds | 2024 % | 2023 % |
|---|-----------|-----------|
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | 0,01 | 0,01 |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | 0,01 | 0,02 |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | 0,01 | 0,02 |
| BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | 0,02 | 0,02 |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | 0,00 | 0,00 |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | 0,01 | 0,02 |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund | 0,01 | 0,02 |
| BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | 0,03 | 0,04 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | 0,01 | 0,01 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | 0,01 | 0,01 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzielle Risiken (Fortsetzung)

3.2 Marktrisiko (Fortsetzung)

| Name des Fonds | 2024 % | 2023 % |
|---|-----------|-----------|
| BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | 0,02 | 0,02 |
| BlackRock ICS US Treasury Fund | 0,01 | 0,00 |

3.2.1 Aus dem Fremdwährungsrisiko entstehendes Marktrisiko

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

Bestehendes Fremdwährungsrisiko

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

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

Alle oder im Wesentlichen alle Anlagen der einzelnen Fonds lauten auf die funktionale Währung des jeweiligen Fonds und waren daher zum 30. September 2024 und zum 30. September 2023 keinem direkten Fremdwährungsrisiko ausgesetzt.

3.2.2 Aus dem Zinsrisiko entstehendes Marktrisiko

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

Bestehendes Zinsrisiko

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

Steuerung des Zinsrisikos

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

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

3.2.3 Aus dem Preisrisiko entstehendes Marktrisiko

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

Bestehendes Preisrisiko

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

Steuerung des Preisrisikos

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

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

3.3 Liquiditätsrisiko

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

Bestehendes Liquiditätsrisiko

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzielle Risiken (Fortsetzung)

3.3. Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Bestehende Liquiditätsrisiken (Fortsetzung)

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

Steuerung des Liquiditätsrisikos

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

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

Keiner der Vermögenswerte der Fonds unterliegt speziellen Liquiditätsvereinbarungen.

3.4 Kontrahentenausfallrisiko

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

Bestehendes Kontrahentenausfallrisiko

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

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

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

Steuerung des Kontrahentenausfallrisikos

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

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

Zum 30. September 2024 und 30. September 2023 bestanden keine überfälligen oder wertgeminderten Salden im Zusammenhang mit Transaktionen mit Kontrahenten.

3.4.1 DFI

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

3.4.1.1 Börsengehandelte DFI

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

3.4.1.2 OTC-DFI

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzielle Risiken (Fortsetzung)

3.4 Kontrahentenausfallrisiko (Fortsetzung)

3.4.1 DFI (Fortsetzung)

3.4.1.2 OTC-DFI (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

| | | | Niedrigstes Bonitätsrating eines einzelnen Kontrahenten | Höchstes Risiko gegenüber einem einzelnen Kontrahenten Tsd. | Im Zusammenhang mit dem maximalen Risiko erhaltene Gesamtsicherheiten Tsd. |
|---|----------------|------------------------------------|---|---|--|
| Zum 30. September 2024 | Währung | Gesamtzahl der Kontrahenten | | | |
| BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | EUR | 5 | A | 284 | – |
| BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | GBP | 5 | A- | 1.693 | – |
| BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | USD | 6 | A | 36 | – |

| | | | Niedrigstes Bonitätsrating eines einzelnen Kontrahenten | Höchstes Risiko gegenüber einem einzelnen Kontrahenten Tsd. | Im Zusammenhang mit dem maximalen Risiko erhaltene Gesamtsicherheiten Tsd. |
|---|----------------|------------------------------------|---|---|--|
| Zum 30. September 2023 | Währung | Gesamtzahl der Kontrahenten | | | |
| BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | GBP | 4 | A- | – | – |
| BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | USD | 6 | A | 370 | – |

3.4.2 Verwahrstelle

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

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

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

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

Das langfristige Rating der Muttergesellschaft der Verwahrstelle zum 30. September 2024 beträgt A+ (30. September 2023: A+) (Standard & Poor's Rating).

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzielle Risiken (Fortsetzung)

3.4 Kontrahentenausfallrisiko (Fortsetzung)

3.4.3 Emittentenausfallrisiko in Bezug auf Schuldinstrumente

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

Das Kreditrating für alle gehaltenen Schuldverschreibungen war Investment-Grade.

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

3.4.4 Emittentenausfallrisiko in Bezug auf umgekehrte Repogeschäfte

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

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

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

| Name des Fonds | Währung | Wert der | Wert der | Wert der | Wert der |
|---|---------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | | umgekehrten | erhaltenen | umgekehrten | erhaltenen |
| | | Repogeschäfte | Sicherheiten | Repogeschäfte | Sicherheiten |
| | | 30. September 2024 | 30. September 2023 | 30. September 2023 | 30. September 2023 |
| | | Tsd. | Tsd. | Tsd. | Tsd. |
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | EUR | 2.755.000 | 2.811.339 | 1.334.000 | 1.373.737 |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | EUR | 900.000 | 922.930 | 700.000 | 720.357 |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | EUR | 10.550.000 | 10.732.529 | 5.121.000 | 5.233.515 |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | GBP | 4.895.000 | 4.935.016 | 4.908.597 | 4.947.101 |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | GBP | 2.755.002 | 2.776.217 | 2.500.460 | 2.518.539 |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund | GBP | 8.100.001 | 8.168.557 | 5.230.562 | 5.253.513 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | USD | 615.000 | 623.511 | 998.120 | 1.020.627 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | USD | 5.159.000 | 5.301.486 | 9.380.100 | 9.570.557 |
| BlackRock ICS US Treasury Fund | USD | 12.166.000 | 12.294.492 | 12.531.000 | 12.728.208 |

Am 30. September 2024 und 30. September 2023 setzen sich die Sicherheiten überwiegend aus Schuldinstrumenten zusammen.

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie

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

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

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

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

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

- (i) für Schuldinstrumente die Verwendung von notierten Marktpreisen oder Händlernotierungen für ähnliche Instrumente;

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

- (ii) bei Devisentermingeschäften der Barwert zukünftiger Cashflows auf der Grundlage der Devisenterminkurse am Stichtag für die Bilanz; und
- (iii) für andere Finanzinstrumente: Discounted-Cashflow-Analysen.

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

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

Die folgenden Tabellen zeigen eine Analyse der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten der einzelnen Fonds zum 30. September 2024 und 30. September 2023:

| 30. September 2024 | Ebene 1 | Ebene 2 | Ebene 3 | Gesamt |
|--|----------|-------------------|----------|-------------------|
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet: | | | | |
| Commercial Papers | – | 264.335 | – | 264.335 |
| Anleihen | – | 873.434 | – | 873.434 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 2.755.000 | – | 2.755.000 |
| Gesamt 3.892.769 | – | 3.892.769 | – | 3.892.769 |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagenzertifikate | – | 2.511.140 | – | 2.511.140 |
| Commercial Papers | – | 2.243.467 | – | 2.243.467 |
| Termineinlagen | – | 1.192.748 | – | 1.192.748 |
| Anleihen | – | 72.028 | – | 72.028 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 900.000 | – | 900.000 |
| Gesamt 6.763.665 | – | 6.919.383 | – | 6.919.383 |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagenzertifikate | – | 23.737.365 | – | 23.737.365 |
| Commercial Papers | – | 25.549.995 | – | 25.549.995 |
| Termineinlagen | – | 4.459.172 | – | 4.459.172 |
| Anleihen | – | 1.359.441 | – | 1.359.441 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 10.550.000 | – | 10.550.000 |
| Gesamt 65.655.973 | – | 65.655.973 | – | 65.655.973 |
| BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagenzertifikate | – | 745.088 | – | 745.088 |
| Commercial Papers | – | 1.588.113 | – | 1.588.113 |
| Termineinlagen | – | 286.000 | – | 286.000 |
| Anleihen | – | 2.248.443 | – | 2.248.443 |
| Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten | – | 905 | – | 905 |
| Gesamt | – | 4.868.549 | – | 4.868.549 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet: | | | | |
| Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten | – | (1.089) | – | (1.089) |
| Gesamt | – | (1.089) | – | (1.089) |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet: | | | | |
| Anleihen | – | 1.657.465 | – | 1.657.465 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 4.895.000 | – | 4.895.000 |
| Gesamt 6.552.465 | – | 6.552.465 | – | 6.552.465 |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagenzertifikate | – | 3.415.895 | – | 3.415.895 |
| Commercial Papers | – | 1.162.979 | – | 1.162.979 |
| Termineinlagen | – | 1.680.130 | – | 1.680.130 |
| Anleihen | – | 868.809 | – | 868.809 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 2.755.002 | – | 2.755.002 |
| Gesamt | – | 9.882.815 | – | 9.882.815 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

| 30. September 2024 (Fortsetzung) | Ebene 1 | Ebene 2 | Ebene 3 | Gesamt |
|--|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagenzertifikate | – | 16.700.554 | – | 16.700.554 |
| Commercial Papers | – | 6.378.392 | – | 6.378.392 |
| Termineinlagen | – | 3.165.267 | – | 3.165.267 |
| Anleihen | – | 4.578.000 | – | 4.578.000 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 8.100.001 | – | 8.100.001 |
| Gesamt | – | 38.922.214 | – | 38.922.214 |
| BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagenzertifikate | – | 797.428 | – | 797.428 |
| Commercial Papers | – | 456.287 | – | 456.287 |
| Termineinlagen | – | 147.000 | – | 147.000 |
| Anleihen | – | 329.596 | – | 329.596 |
| Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten | – | 2.972 | – | 2.972 |
| Gesamt | – | 1.733.283 | – | 1.733.283 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagenzertifikate | – | 1.478.931 | – | 1.478.931 |
| Commercial Papers | – | 1.626.707 | – | 1.626.707 |
| Termineinlagen | – | 435.000 | – | 435.000 |
| Anleihen | – | 111.104 | – | 111.104 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 615.000 | – | 615.000 |
| Gesamt | – | 4.266.742 | – | 4.266.742 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagenzertifikate | – | 31.685.263 | – | 31.685.263 |
| Commercial Papers | – | 35.395.450 | – | 35.395.450 |
| Termineinlagen | – | 7.094.000 | – | 7.094.000 |
| Anleihen | – | 1.500.141 | – | 1.500.141 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 5.159.000 | – | 5.159.000 |
| Gesamt | – | 80.833.854 | – | 80.833.854 |
| BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagenzertifikate | – | 1.894.054 | – | 1.894.054 |
| Commercial Papers | – | 3.328.655 | – | 3.328.655 |
| Termineinlagen | – | 201.000 | – | 201.000 |
| Anleihen | – | 1.141.857 | – | 1.141.857 |
| Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten | – | 502 | – | 502 |
| Gesamt | – | 6.566.068 | – | 6.566.068 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten | – | (1.320) | – | (1.320) |
| Gesamt | – | (1.320) | – | (1.320) |
| BlackRock ICS US Treasury Fund | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Anleihen | – | 17.867.639 | – | 17.867.639 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 12.166.000 | – | 12.166.000 |
| Gesamt | – | 30.033.639 | – | 30.033.639 |
| 30. September 2023 | Ebene 1 | Ebene 2 | Ebene 3 | Gesamt |
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Anleihen | – | 151.200 | – | 151.200 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 1.334.000 | – | 1.334.000 |
| Gesamt | – | 1.485.200 | – | 1.485.200 |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagenzertifikate | – | 1.693.656 | – | 1.693.656 |
| Commercial Papers | – | 1.914.682 | – | 1.914.682 |
| Termineinlagen | – | 1.724.877 | – | 1.724.877 |
| Anleihen | – | 325.871 | – | 325.871 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 700.000 | – | 700.000 |
| Gesamt | – | 6.359.086 | – | 6.359.086 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

| 30. September 2023 (Fortsetzung) | Ebene 1 | Ebene 2 | Ebene 3 | Gesamt |
|--|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagezertifikate | – | 11.675.889 | – | 11.675.889 |
| Commercial Papers | – | 17.274.580 | – | 17.274.580 |
| Termineinlagen | – | 6.569.025 | – | 6.569.025 |
| Anleihen | – | 5.172.396 | – | 5.172.396 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 5.121.000 | – | 5.121.000 |
| Gesamt | – | 45.812.890 | – | 45.812.890 |
| BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagezertifikate | – | 1.119.957 | – | 1.119.957 |
| Commercial Papers | – | 1.264.613 | – | 1.264.613 |
| Termineinlagen | – | 412.517 | – | 412.517 |
| Anleihen | – | 2.053.353 | – | 2.053.353 |
| Gesamt | – | 4.850.440 | – | 4.850.440 |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Anleihen | – | 836.553 | – | 836.553 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 4.908.597 | – | 4.908.597 |
| Gesamt | – | 5.745.150 | – | 5.745.150 |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagezertifikate | – | 2.379.514 | – | 2.379.514 |
| Commercial Papers | – | 2.029.737 | – | 2.029.737 |
| Termineinlagen | – | 2.140.639 | – | 2.140.639 |
| Anleihen | – | 682.294 | – | 682.294 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 2.500.460 | – | 2.500.460 |
| Gesamt | – | 9.732.644 | – | 9.732.644 |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagezertifikate | – | 13.381.994 | – | 13.381.994 |
| Commercial Papers | – | 7.161.486 | – | 7.161.486 |
| Termineinlagen | – | 4.025.627 | – | 4.025.627 |
| Anleihen | – | 4.183.809 | – | 4.183.809 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 5.230.562 | – | 5.230.562 |
| Gesamt | – | 33.983.478 | – | 33.983.478 |
| BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagezertifikate | – | 1.128.504 | – | 1.128.504 |
| Commercial Papers | – | 905.982 | – | 905.982 |
| Termineinlagen | – | 366.570 | – | 366.570 |
| Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten | – | 12 | – | 12 |
| Gesamt | – | 2.401.068 | – | 2.401.068 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten | – | (858) | – | (858) |
| Gesamt | – | (858) | – | (858) |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagezertifikate | – | 985.280 | – | 985.280 |
| Commercial Papers | – | 1.560.688 | – | 1.560.688 |
| Termineinlagen | – | 307.000 | – | 307.000 |
| Anleihen | – | 88.110 | – | 88.110 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 998.120 | – | 998.120 |
| Gesamt | – | 3.939.198 | – | 3.939.198 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden | | | | |
| Zeitwert bewertet: | | | | |
| Einlagezertifikate | – | 19.913.401 | – | 19.913.401 |
| Commercial Papers | – | 26.133.271 | – | 26.133.271 |
| Termineinlagen | – | 9.720.000 | – | 9.720.000 |
| Anleihen | – | 1.351.124 | – | 1.351.124 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 9.380.100 | – | 9.380.100 |
| Gesamt | – | 66.497.896 | – | 66.497.896 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

| 30. September 2023 (Fortsetzung) | Ebene 1 | Ebene 2 | Ebene 3 | Gesamt |
|--|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet: | | | | |
| Bankakzepte | – | 124.102 | – | 124.102 |
| Einlagenzertifikate | – | 1.341.924 | – | 1.341.924 |
| Commercial Papers | – | 2.372.734 | – | 2.372.734 |
| Anleihen | – | 429.663 | – | 429.663 |
| Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten | – | 968 | – | 968 |
| Gesamt | – | 4.269.391 | – | 4.269.391 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet: | | | | |
| Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten | – | (3.629) | – | (3.629) |
| Gesamt | – | (3.629) | – | (3.629) |
| BlackRock ICS US Treasury Fund | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet: | | | | |
| Anleihen | – | 9.571.897 | – | 9.571.897 |
| Umgekehrte Repogeschäfte | – | 12.531.000 | – | 12.531.000 |
| Gesamt | – | 22.102.897 | – | 22.102.897 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

5. Betriebliche Erträge

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| | BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | | BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | |
|--|--|---------------|--|----------------|-----------------------------------|------------------|--|----------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten | 916 | 560 | 9.691 | 5.948 | 68.303 | 37.544 | 10.351 | 5.443 |
| Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten | 25.788 | 3.287 | 229.871 | 155.284 | 1.882.969 | 989.173 | 185.788 | 145.034 |
| Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften | 72.949 | 17.350 | 24.479 | 6.202 | 276.885 | 118.568 | – | – |
| Gesamt | 99.653 | 21.197 | 264.041 | 167.434 | 2.228.157 | 1.145.285 | 196.139 | 150.477 |

| | BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS Sterling Liquidity Fonds | | BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | |
|--|--|----------------|--|----------------|--|------------------|--|---------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten | 6.982 | 4.392 | 16.759 | 10.015 | 87.890 | 55.987 | 7.159 | 6.473 |
| Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten | 85.714 | 26.430 | 361.595 | 280.510 | 1.654.566 | 1.302.028 | 98.301 | 77.508 |
| Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften | 191.048 | 120.177 | 104.200 | 67.671 | 396.907 | 254.780 | – | – |
| Gesamt | 283.744 | 150.999 | 482.554 | 358.196 | 2.139.363 | 1.612.795 | 105.460 | 83.981 |

| | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fonds | | BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | | BlackRock ICS US Treasury Fund | |
|--|---|----------------|---|------------------|---|----------------|--------------------------------|----------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten | 7.503 | 6.403 | 101.951 | 87.992 | 14.492 | 10.687 | 26.325 | 28.062 |
| Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten | 175.347 | 136.086 | 3.443.788 | 2.355.421 | 296.325 | 218.855 | 758.299 | 196.058 |
| Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften | 43.556 | 39.644 | 331.848 | 291.931 | – | – | 538.821 | 639.818 |
| Gesamt | 226.406 | 182.133 | 3.877.587 | 2.735.344 | 310.817 | 229.542 | 1.323.445 | 863.938 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

6. Betriebliche Aufwendungen

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| | BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | | BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | |
|---------------------------------|--|--------------|--|----------------|-----------------------------------|-----------------|--|----------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Verzicht auf Managementgebühren | – | – | – | – | – | 213 | – | – |
| Managementgebühren | (3.680) | (892) | (4.858) | (4.450) | (63.209) | (47.740) | (3.361) | (3.762) |
| Gesamt | (3.680) | (892) | (4.858) | (4.450) | (63.209) | (47.527) | (3.361) | (3.762) |

| | BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS Sterling Liquidity Fonds | | BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | |
|---------------------------------|--|----------------|--|----------------|--|-----------------|--|----------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Verzicht auf Managementgebühren | – | – | – | – | – | 3 | – | – |
| Managementgebühren | (6.677) | (4.283) | (6.187) | (5.805) | (40.077) | (39.186) | (1.479) | (1.433) |
| Gesamt | (6.677) | (4.283) | (6.187) | (5.805) | (40.077) | (39.183) | (1.479) | (1.433) |

| | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fonds | | BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | | BlackRock ICS US Treasury Fund | |
|--------------------|---|----------------|---|-----------------|---|----------------|--------------------------------|-----------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Managementgebühren | (1.879) | (1.557) | (82.678) | (66.451) | (5.662) | (4.504) | (34.746) | (27.171) |
| Gesamt | (1.879) | (1.557) | (82.678) | (66.451) | (5.662) | (4.504) | (34.746) | (27.171) |

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

Die Verwaltungsgesellschaft hat mit dem Unternehmen vereinbart, die jährlichen Aufwendungen (wie im Verkaufsprospekt definiert) jeder Klasse eines Fonds auf maximal 1 % pro Jahr des NIW dieser Klasse oder auf einen geringeren Betrag – den die Verwaltungsgesellschaft für jede Klasse eines Fonds vereinbaren kann – zu begrenzen. Die Verwaltungsgesellschaft ist für die Abführung der jährlichen Aufwendungen der Fonds aus ihrem Honorar verantwortlich. Wenn die tatsächlichen Gebühren und Kosten den an die Verwaltungsgesellschaft gezahlten Betrag übersteigen, wird die Verwaltungsgesellschaft den Mehrbetrag aus ihrem Vermögen begleichen. Die Gebühr läuft auf täglicher Basis auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar.

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

6. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

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

| Anteilklasse | Managementgebühren (inkl. der Gebühren von Fondsverwalter, Verwahrstelle und Investmentmanager): % |
|--------------------------------|--|
| Anteilklasse Accumulating | 0,055 |
| Admin I Shares | 0,25 |
| Anteilklasse Admin II | 0,30 |
| Anteilklasse Admin III | 0,45 |
| Anteilklasse Admin IV | 0,70 |
| Anteilklasse Agency | 0,03 |
| Anteilklasse Aon Captives | 0,15 |
| Anteilklasse Core | 0,20 |
| Anteilklasse E (Dis) | 0,08 |
| Anteilklasse G Accumulating II | 0,25 |
| Anteilklasse G Accumulating | 0,20 |
| Anteilklasse G Distributing I | 0,15 |
| Anteilklasse G Distributing II | 0,25 |
| Anteilklasse G Distributing | 0,20 |
| Anteilklasse Heritage | 0,125 |
| Anteilklasse J (Acc) | 0,06 |
| Anteilklasse J (Dis) | 0,06 |
| Klasse N | 0,20 |
| Anteilklasse Premier | 0,10 |
| Anteilklasse S (Acc) | 0,10 |
| Anteilklasse Select | 0,15 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

7. Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| | BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | | BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | |
|---|--|----------|--|------------|-----------------------------------|--------------|--|-----------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren | – | – | 6 | 7 | – | (381) | 1.020 | (15.259) |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten | – | – | – | – | – | – | 1.856 | 11.382 |
| Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren | – | – | 3.123 | 833 | – | – | 8.162 | 984 |
| Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten | – | – | – | – | – | – | (184) | 5.029 |
| Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten | – | – | – | – | – | – | (3.756) | (18.832) |
| Gesamt | – | – | 3.129 | 840 | – | (381) | 7.098 | (16.696) |

| | BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS Sterling Liquidity Fonds | | BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | |
|---|--|----------|--|--------------|--|----------|--|--------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren | – | – | (2) | 18 | – | – | 155 | – |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten | – | – | – | – | – | – | 8.547 | 8.168 |
| Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren | – | – | 2.214 | 7.359 | – | – | 3.190 | 3.572 |
| Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten | – | – | – | – | – | – | 3.818 | 4.281 |
| Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten | – | – | – | – | – | – | (10.455) | (9.721) |
| Gesamt | – | – | 2.212 | 7.377 | – | – | 5.255 | 6.300 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fonds | BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | BlackRock ICS US Treasury Fund |
|---|--|--|--|--------------------------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren | 35 | (139) | 71 | 34 |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten | – | – | – | – |
| Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren | 2.958 | 1.462 | – | – |
| Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten | – | – | – | – |
| Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten | – | – | – | – |
| Gesamt | 2.993 | 1.323 | 71 | 34 |

8. Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

9. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile

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

Die im Geschäftsjahr beschlossenen Ausschüttungen waren wie folgt:

| | Institutional Cash Series Plc | | BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | |
|--------------------------------|-------------------------------|--------------------|--|----------------|--|----------|-----------------------------------|-----------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Anteilklasse Admin I (Dis) | (310) | (62) | – | – | – | – | – | – |
| Anteilklasse Admin II (Dis) | (1.904) | (1.508) | – | – | – | – | – | – |
| Anteilklasse Admin III (Dis) | (6.183) | (5.450) | (689) | – | – | – | (1) | – |
| Anteilklasse Admin IV (Dis) | (1) | – | – | – | – | – | – | – |
| Anteilklasse Agency (Dis) | (920.258) | (840.991) | (2) | (1) | – | – | (84) | – |
| Anteilklasse Aon Captives | (3.311) | (1.359) | – | – | – | – | – | – |
| Anteilklasse Core (Dis) | (880.513) | (600.510) | (10.745) | (1.071) | – | – | (37.231) | (9.194) |
| Anteilklasse E (Dis) | (1) | – | – | – | – | – | – | – |
| Anteilklasse G Distributing I | (204) | (166) | – | – | – | – | – | – |
| Anteilklasse G Distributing II | – | (2) | – | – | – | – | – | – |
| Anteilklasse G Distributing | (10.438) | (6.166) | – | – | – | – | – | – |
| Anteilklasse G Heritage (Dis) | (464) | (390) | – | – | – | – | – | – |
| Anteilklasse Heritage (Dis) | (923.290) | (713.088) | (5.699) | (2.466) | – | – | (62.965) | (28.069) |
| Anteilklasse J (Dis) | (4.809) | (3.734) | – | – | – | – | – | – |
| Klasse N | (2.844) | (1.793) | – | – | – | – | – | – |
| Anteilklasse Premier (Dis T1) | (10.075) | (748) | – | – | – | – | – | – |
| Anteilklasse Premier (Dis) | (2.841.273) | (1.888.333) | (10.792) | (786) | (21) | – | (342.533) | (61.196) |
| Anteilklasse Select (Dis) | (203.854) | (142.639) | (1) | (1) | – | – | (2.238) | (736) |
| Gesamt | (5.809.732) | (4.206.939) | (27.928) | (4.325) | (21) | – | (445.052) | (99.195) |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

9. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile (Fortsetzung)

| | BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | | BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS Sterling Liquidity Fonds | |
|--------------------------------|--|--------------|--|-----------------|--|------------------|--|--------------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Anteilklasse Admin I (Dis) | – | – | – | – | – | – | (133) | (60) |
| Anteilklasse Admin II (Dis) | – | – | – | – | – | – | (376) | (66) |
| Anteilklasse Admin III (Dis) | – | – | (365) | – | – | – | (885) | (821) |
| Anteilklasse Agency (Dis) | – | – | (2) | (1) | – | – | – | – |
| Anteilklasse Agency (Dis) | – | – | – | – | (132.211) | (128.935) | (362.478) | (333.748) |
| Anteilklasse Aon Captives | – | – | – | – | – | – | (1.855) | (466) |
| Anteilklasse Core (Dis) | – | – | (13.307) | (3.346) | (1.459) | (346) | (92.860) | (57.190) |
| Anteilklasse G Distributing I | – | – | – | – | – | – | (179) | (72) |
| Anteilklasse G Distributing II | – | – | – | – | – | – | – | (2) |
| Anteilklasse Heritage (Dis) | – | – | (10.281) | (2.020) | (11.062) | (5.856) | (348.105) | (295.607) |
| Anteilklasse J (Dis) | (1.698) | (649) | – | – | – | – | – | – |
| Anteilklasse Premier (Dis T1) | – | – | – | – | – | – | (10.075) | (748) |
| Anteilklasse Premier (Dis) | (4.407) | (3) | (24.687) | (9.312) | (41.680) | (32.748) | (884.533) | (650.217) |
| Anteilklasse Select (Dis) | – | – | (6.949) | (250) | – | – | – | – |
| Anteilklasse Select (Dis) | – | – | – | – | – | – | (74.447) | (55.419) |
| Gesamt | (6.105) | (652) | (55.591) | (14.929) | (186.412) | (167.885) | (1.775.926) | (1.394.416) |

| | BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | | BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | |
|-------------------------------|--|-----------------|---|------------------|--|--------------------|---|----------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Anteilklasse Admin I (Dis) | – | – | – | – | (224) | (2) | – | – |
| Anteilklasse Admin II (Dis) | – | – | – | – | (1.937) | (1.769) | – | – |
| Anteilklasse Admin III (Dis) | – | – | – | – | (4.389) | (5.341) | – | – |
| Anteilklasse Admin IV (Dis) | – | – | – | – | (1) | – | – | – |
| Anteilklasse Agency (Dis) | (16.115) | (18.127) | (161.904) | (151.708) | (312.518) | (265.723) | – | – |
| Anteilklasse Aon Captives | – | – | – | – | (1.846) | (1.095) | – | – |
| Anteilklasse Core (Dis) | – | – | (3.867) | (4.189) | (449.029) | (316.295) | – | – |
| Anteilklasse G Distributing I | – | – | – | – | (33) | (115) | – | – |
| Anteilklasse G Distributing | – | – | – | – | (12.457) | (7.474) | – | – |
| Anteilklasse G Heritage (Dis) | – | – | – | – | (502) | (368) | – | – |
| Anteilklasse Heritage (Dis) | – | – | (1.509) | (1.109) | (507.968) | (408.814) | – | – |
| Anteilklasse J (Dis) | (1.164) | (733) | – | – | – | – | (2.781) | (2.989) |
| Klasse N | – | – | – | – | (3.607) | (2.200) | – | – |
| Anteilklasse Premier (Dis) | (3.547) | (1.685) | (4.600) | (4.289) | (1.500.151) | (1.061.708) | (2.012) | (1.185) |
| Anteilklasse Select (Dis) | – | – | (391) | (309) | (109.461) | (64.368) | – | – |
| Gesamt | (20.826) | (20.545) | (172.271) | (161.604) | (2.904.123) | (2.135.272) | (4.793) | (4.174) |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

9. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile (Fortsetzung)

| BlackRock ICS US Treasury Fund | | |
|--------------------------------|--------------------|------------------|
| | 2024 | 2023 |
| | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Anteilklasse Admin III (Dis) | (1.118) | (338) |
| Anteilklasse Agency (Dis) | (44.712) | (24.435) |
| Anteilklasse Core (Dis) | (475.179) | (330.571) |
| Anteilklasse E (Dis) | (1) | – |
| Anteilklasse G Distributing | (780) | (91) |
| Anteilklasse G Heritage (Dis) | (87) | (111) |
| Anteilklasse Heritage (Dis) | (118.390) | (59.978) |
| Anteilklasse Premier (Dis) | (497.977) | (331.891) |
| Anteilklasse Select (Dis) | (43.009) | (41.227) |
| Gesamt | (1.181.253) | (788.642) |

10. Besteuerung

Irische Steuern

Nach der geltenden irischen Rechtslage und Rechtspraxis erfüllt das Unternehmen die Voraussetzungen eines Anlageorganismus gemäß der Definition in Section 739B des Taxes Consolidation Act von 1997 (in der jeweils gültigen Fassung). Auf dieser Grundlage unterliegt es keiner irischen Steuer auf seine Erträge oder Kapitalgewinne. Es kann jedoch bei Eintritt eines steuerlich relevanten Ereignisses („Chargeable Event“) eine Steuerpflicht in Irland entstehen. Ein steuerlich relevantes Ereignis umfasst Ausschüttungszahlungen an Anteilinhaber oder die Einlösung, Rücknahme, Annullierung oder Übertragung von Anteilen sowie das Halten von Anteilen am Ende eines jeden Achtjahreszeitraums, beginnend mit dem Erwerb der Anteile.

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

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

Ausländische Steuern

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

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

Die Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung („OECD“) hat Mustervorschriften für ein globales Mindeststeuersystem („zweite Säule“) herausgegeben, die für Rechnungsperioden gelten, welche am oder nach dem 31. Dezember 2023 beginnen. Wie bereits zum Ende des Jahres ist das Unternehmen weiterhin mit der Prüfung beschäftigt, ob die Fonds in den Geltungsbereich der zweiten Säule fallen und ob sie möglicherweise der Einkommenssteuer der zweiten Säule unterliegen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

11. Forderungen

Zum 30. September 2024

| | BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | | BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | |
|--|--|------------|--|---------------|-----------------------------------|----------------|--|---------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Zinsforderungen aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten | 2 | 8 | 24 | 80 | 168 | 570 | 80 | 744 |
| Zinsforderungen aus finanziellen Vermögenswerten | – | – | 18.929 | 12.989 | 167.054 | 93.263 | 10.895 | 11.650 |
| Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften | 215 | 410 | 81 | 214 | 905 | 1.537 | – | – |
| Noch nicht abgerechnete Anteilszeichnungen | 365 | 46 | 52.371 | 35 | 60.970 | 56.350 | 10.698 | – |
| Sonstige Forderungen | – | – | 8 | – | – | – | – | – |
| Gesamt | 582 | 464 | 71.413 | 13.318 | 229.097 | 151.720 | 21.673 | 12.394 |

| | BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS Sterling Liquidity Fonds | | BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | |
|--|--|--------------|--|---------------|--|----------------|--|--------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Zinsforderungen aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten | 18 | 58 | 44 | 139 | 231 | 727 | 41 | 444 |
| Zinsforderungen aus finanziellen Vermögenswerten | – | – | 24.285 | 22.826 | 109.820 | 128.204 | 4.065 | 2.014 |
| Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften | 546 | 1.644 | 321 | 874 | 989 | 2.106 | – | – |
| Noch nicht abgerechnete Anteilszeichnungen | 5.205 | 4.494 | 47.909 | 6.318 | 20.680 | 154.024 | 4.588 | 1.710 |
| Sonstige Forderungen | – | – | – | – | – | – | – | 112 |
| Gesamt | 5.769 | 6.196 | 72.559 | 30.157 | 131.720 | 285.061 | 8.694 | 4.280 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

11. Forderungen (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fonds | | BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | | BlackRock ICS US Treasury Fund | |
|--|---|--------------|---|----------------|---|---------------|--------------------------------|---------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Zinsforderungen aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten | 19 | 62 | 205 | 860 | 1.320 | 34 | 67 | 258 |
| Zinsforderungen aus finanziellen Vermögenswerten | 12.792 | 7.465 | 218.502 | 136.582 | 20.326 | 16.138 | 21.655 | 26.848 |
| Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften | 85 | 440 | 701 | 4.147 | – | – | 1.648 | 5.523 |
| Noch nicht abgerechnete Verkäufe von Wertpapieren | – | – | – | – | – | – | – | 3.561 |
| Noch nicht abgerechnete Anteilszeichnungen | 1.356 | 391 | 74.792 | 21.396 | 106.292 | 28.488 | 32.145 | 356 |
| Gesamt | 14.252 | 8.358 | 294.200 | 162.985 | 127.938 | 44.660 | 55.515 | 36.546 |

12. Verbindlichkeiten

Zum 30. September 2024

| | BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | | BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | |
|--|--|----------------|--|------------------|-----------------------------------|--------------------|--|----------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Zahlbare Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile | (2.982) | (1.330) | (11) | – | (57.778) | (25.361) | (2.662) | (847) |
| Zinsverbindlichkeiten für Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | – | – | (14) | (233) | (619) | (18) | – | (394) |
| Zahlbare Managementgebühren | (787) | (345) | (832) | (840) | (12.114) | (8.899) | (618) | (640) |
| Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren | (549.563) | – | (265.895) | (249.973) | (1.507.470) | (1.509.848) | (213.803) | – |
| Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen | (6.013) | (6.265) | (4.589) | (5.570) | (21.639) | (4.931) | (12.034) | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (20) | (6) | – | (63) | (2.546) | (2.736) | – | – |
| Gesamt | (559.365) | (7.946) | (271.341) | (256.679) | (1.602.166) | (1.551.793) | (229.117) | (1.881) |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

12. Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| | BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS Sterling Liquidity Fonds | | BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | |
|--|--|--------------------|--|------------------|--|------------------|--|------------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Zahlbare Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile | (5.955) | (2.668) | (13.549) | (17.231) | (135.829) | (134.324) | (3.264) | (17.974) |
| Zinsverbindlichkeiten für Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | (5) | – | – | (87) | – | (248) | – | – |
| Verzicht auf Managementgebühren | (3) | (3) | – | – | – | – | – | – |
| Zahlbare Managementgebühren | (1.281) | (924) | (1.163) | (1.019) | (6.688) | (5.913) | (255) | (276) |
| Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren | (900.000) | (1.225.284) | (400.000) | (574.876) | (893.994) | (485.542) | – | (177.499) |
| Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen | (16.253) | – | (7.852) | (8.789) | (37.095) | (10.396) | (56.374) | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (32) | (32) | (3) | – | (138) | (122) | – | – |
| Gesamt | (923.529) | (1.228.911) | (422.567) | (602.002) | (1.073.744) | (636.545) | (59.893) | (195.749) |

| | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | | BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fonds | | BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | | BlackRock ICS US Treasury Fund | |
|--|---|------------------|---|--------------------|---|-----------------|--------------------------------|------------------|
| | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 | 2024 | 2023 |
| | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Zahlbare Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile | (14.222) | (15.073) | (265.960) | (230.871) | (3.713) | (2.447) | (102.594) | (91.713) |
| Zinsverbindlichkeiten für Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | – | (16) | – | (205) | – | – | – | (1) |
| Verzicht auf Managementgebühren | – | – | – | – | – | – | (104) | (104) |
| Zahlbare Managementgebühren | (346) | (264) | (15.343) | (11.542) | (1.112) | (791) | (6.226) | (8.755) |
| Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren | (24.997) | (189.896) | (564.046) | (3.139.110) | (65.492) | (31.836) | (1.440.644) | (98.289) |
| Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen | (122) | (30) | (77.400) | (80.437) | (55.007) | (4.573) | (23.884) | (14.420) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | – | – | (1.074) | (953) | – | (1) | (1.334) | (15) |
| Gesamt | (39.687) | (205.279) | (923.823) | (3.463.118) | (125.324) | (39.648) | (1.574.786) | (213.297) |

13. Anteilkapital

Genehmigtes Anteilkapital

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

13. Anteilkapital (Fortsetzung)

Zeichneranteile

Derzeit sind 3 Zeichneranteile ausgegeben, und sie werden zum 30. September 2024 und 30. September 2023 von der Verwaltungsgesellschaft und von Nominees der Verwaltungsgesellschaft gehalten. Sie gehören nicht zum NIW des Unternehmens. Sie werden im Abschluss somit nur in dieser Anmerkung erwähnt. Nach Auffassung des Verwaltungsrats spiegeln diese Angaben die Art der Anlagetätigkeit des Unternehmens wider.

Stimmrechte

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

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert

Zum 30. September 2024

| | | 2024 | 2023 | 2022 |
|---|----------|-------------|-------------|----------|
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | | | | |
| Anteilklasse Admin III (Acc T0)¹ | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 11.894 | – | – |
| Anteile im Umlauf | | 116.075 | – | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 102,4699 | – | – |
| Anteilklasse Admin III (Dis)¹ | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 82.216 | – | – |
| Anteile im Umlauf | | 82.216.068 | – | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 1,00 | – | – |
| Anteilklasse Agency (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 16.289 | 15.636 | 15.291 |
| Anteile im Umlauf | | 157.234 | 156.790 | 156.986 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 103,5999 | 99,7243 | 97,4032 |
| Anteilklasse Agency (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 40 | 40 | – |
| Anteile im Umlauf | | 40.000 | 40.000 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 1,00 | 1,00 | – |
| Anteilklasse Core (Acc T0)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 158.884 | 79.438 | – |
| Anteile im Umlauf | | 1.509.233 | 782.574 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 105,2748 | 101,5086 | – |
| Anteilklasse Core (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 66.445 | 61.733 | 9.595 |
| Anteile im Umlauf | | 649.926 | 626.248 | 99.488 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 102,2340 | 98,5766 | 96,4456 |
| Anteilklasse Core (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 389.458 | 165.655 | – |
| Anteile im Umlauf | | 389.457.754 | 165.654.656 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 1,00 | 1,00 | – |
| Anteilklasse G Accumulating | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 12.306 | 8.632 | 13 |
| Anteile im Umlauf | | 12.171 | 8.854 | 14 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 1.011,1294 | 974,9560 | 953,8279 |
| Anteilklasse G Accumulating T0 | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 399.053 | 152.703 | 10 |
| Anteile im Umlauf | | 3.850.700 | 1.528.199 | 101 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 103,6312 | 99,9238 | 97,7560 |
| Anteilklasse Heritage (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 150.359 | 135.400 | 373 |
| Anteile im Umlauf | | 1.450.481 | 1.355.648 | 3.820 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 103,6617 | 99,8784 | 97,6461 |
| Anteilklasse Heritage (Acc)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 189.379 | 34.467 | – |
| Anteile im Umlauf | | 1.785.943 | 337.356 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 106,0389 | 102,1688 | – |
| Anteilklasse Heritage (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 132.373 | 181.345 | – |
| Anteile im Umlauf | | 132.372.846 | 181.344.659 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 1,00 | 1,00 | – |
| Anteilklasse Premier (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 1.107.449 | 438.890 | 13.938 |
| Anteile im Umlauf | | 10.677.999 | 4.393.159 | 142.742 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 103,7131 | 99,9030 | 97,6458 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

| | | 2024 | 2023 | 2022 |
|---|----------|-------------|------------|------------|
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund (Fortsetzung) | | | | |
| Anteilklasse Premier (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 116.613 | 129.831 | 187 |
| Anteile im Umlauf | | 1.150.344 | 1.329.581 | 1.958 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 101,3719 | 97,6479 | 95,4416 |
| Anteilklasse Premier (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 481.919 | 69.148 | – |
| Anteile im Umlauf | | 481.919.261 | 69.148.388 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 1,00 | 1,00 | – |
| Anteilklasse Select (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 41.505 | 28.369 | 5 |
| Anteile im Umlauf | | 400.304 | 283.899 | 52 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 103,6845 | 99,9254 | 97,7137 |
| Anteilklasse Select (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 40 | 40 | – |
| Anteile im Umlauf | | 40.000 | 40.000 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 1,00 | 1,00 | – |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | | | | |
| Anteilklasse Admin III (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 1.094 | 1.283 | 758 |
| Anteile im Umlauf | | 10.930 | 13.282 | 8.024 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 100,0768 | 96,5846 | 94,5054 |
| Anteilklasse Agency (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 2.964.326 | 2.740.933 | 2.614.184 |
| Anteile im Umlauf | | 28.283.118 | 27.211.016 | 26.634.964 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,8090 | 100,7288 | 98,1485 |
| Anteilklasse Core (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 73.000 | 34.526 | 58.411 |
| Anteile im Umlauf | | 702.020 | 344.884 | 597.807 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 103,9863 | 100,1077 | 97,7087 |
| Anteilklasse Core (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 74.832 | 83.479 | 39.592 |
| Anteile im Umlauf | | 729.879 | 845.769 | 410.976 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 102,5264 | 98,7022 | 96,3369 |
| Anteilklasse Heritage (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 33.593 | 114.120 | 19.711 |
| Anteile im Umlauf | | 322.128 | 1.137.574 | 201.454 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,2836 | 100,3189 | 97,8417 |
| Anteilklasse Heritage (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 32.462 | 176.780 | 121.286 |
| Anteile im Umlauf | | 310.082 | 1.755.385 | 1.234.840 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,6870 | 100,7070 | 98,2201 |
| Anteilklasse Premier (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 2.347.993 | 2.113.055 | 1.178.746 |
| Anteile im Umlauf | | 22.467.186 | 21.023.474 | 12.027.663 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,5077 | 100,5093 | 98,0030 |
| Anteilklasse Premier (Acc T2) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 52.857 | 8.184 | 11 |
| Anteile im Umlauf | | 497.318 | 80.068 | 110 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 106,2848 | 102,2184 | 99,6691 |
| Anteilklasse Premier (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 1.369.826 | 1.084.542 | 878.418 |
| Anteile im Umlauf | | 13.086.913 | 10.773.579 | 8.949.161 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,6714 | 100,6668 | 98,1565 |
| Anteilklasse Premier (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 3.414 | 40 | – |
| Anteile im Umlauf | | 34.132 | 400 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 100,0278 | 99,9812 | – |
| Anteilklasse Select (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 16.042 | 504 | – |
| Anteile im Umlauf | | 151.067 | 4.928 | 2 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 106,1915 | 102,1797 | 99,9733 |
| Anteilklasse Select (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 27 | 26 | 69 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

| | | 2024 | 2023 | 2022 |
|---|----------|---------------|-------------|------------|
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Fortsetzung) | | | | |
| Anteilklasse Select (Acc) (Fortsetzung) | | | | |
| Anteile im Umlauf | | 249 | 249 | 687 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 106,5613 | 102,5400 | 99,8808 |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | | | | |
| Anteilklasse Admin I (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 1.578 | 1.521 | – |
| Anteile im Umlauf | | 15.147 | 15.147 | 1 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,1909 | 100,4185 | 99,0185 |
| Anteilklasse Admin I (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 101.546 | 31.565 | 1.353 |
| Anteile im Umlauf | | 1.001.920 | 323.141 | 14.178 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 101,3516 | 97,6820 | 95,4332 |
| Anteilklasse Admin II (Acc T0)¹ | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 1.753 | – | – |
| Anteile im Umlauf | | 17.246 | – | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 101,6990 | – | – |
| Anteilklasse Admin II (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 14.702 | 11.953 | 2.404 |
| Anteile im Umlauf | | 140.637 | 118.580 | 24.394 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,5356 | 100,8010 | 98,5295 |
| Anteilklasse Admin III (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 15.507 | 861 | – |
| Anteile im Umlauf | | 147.369 | 8.476 | 3 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 105,2248 | 101,6176 | 99,2627 |
| Anteilklasse Admin III (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 9.528 | 4.884 | 7.668 |
| Anteile im Umlauf | | 89.908 | 47.725 | 76.538 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 105,9700 | 102,3372 | 100,1808 |
| Anteilklasse Admin III (Dis)¹ | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 40 | – | – |
| Anteile im Umlauf | | 40.000 | – | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 1,00 | – | – |
| Anteilklasse Admin IV (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 10.151 | 6.818 | 280 |
| Anteile im Umlauf | | 103.862 | 72.062 | 3.020 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 97,7323 | 94,6177 | 92,8553 |
| Anteilklasse Agency (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 3.504.803 | 2.513.310 | 2.512.351 |
| Anteile im Umlauf | | 33.462.385 | 24.952.195 | 25.586.495 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,7386 | 100,7250 | 98,1905 |
| Anteilklasse Agency (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 170.008 | 138.911 | 161.039 |
| Anteile im Umlauf | | 1.594.914 | 1.355.114 | 1.611.524 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 106,5936 | 102,5089 | 99,9295 |
| Anteilklasse Agency (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 25.001 | 1 | – |
| Anteile im Umlauf | | 25.001.000 | 1.000 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 1,00 | 1,00 | – |
| Anteilklasse Aon Captives (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 7 | 7 | 7 |
| Anteile im Umlauf | | 68 | 68 | 68 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,2424 | 100,3745 | 97,9804 |
| Anteilklasse Core (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 1.316.244 | 655.574 | 1.800.041 |
| Anteile im Umlauf | | 12.663.701 | 6.547.545 | 18.410.717 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 103,9384 | 100,1251 | 97,7713 |
| Anteilklasse Core (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 878.361 | 782.461 | 731.850 |
| Anteile im Umlauf | | 6.169.271 | 5.705.008 | 5.464.460 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 142,3768 | 137,1533 | 133,9291 |
| Anteilklasse Core (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 1.296.034 | 479.510 | – |
| Anteile im Umlauf | | 1.296.034.042 | 479.510.071 | – |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

| | | 2024 | 2023 | 2022 |
|--|----------|----------------|---------------|-------------|
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund (Fortsetzung) | | | | |
| Anteilklasse Core (Dis) (Fortsetzung) | | | | |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 1,00 | 1,00 | – |
| Anteilklasse G Accumulating T0 | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 4.166.206 | 4.464.122 | 2.046.538 |
| Anteile im Umlauf | | 39.944.230 | 44.430.597 | 20.860.906 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,3006 | 100,4741 | 98,1040 |
| Anteilklasse Heritage (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 2.212.191 | 1.902.277 | 3.405.848 |
| Anteile im Umlauf | | 21.206.571 | 18.944.332 | 34.760.595 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,3163 | 100,4140 | 97,9802 |
| Anteilklasse Heritage (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 379.948 | 282.547 | 222.214 |
| Anteile im Umlauf | | 3.647.150 | 2.817.595 | 2.270.993 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,1766 | 100,2796 | 97,8490 |
| Anteilklasse Heritage (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 1.819.908 | 1.673.255 | – |
| Anteile im Umlauf | | 1.819.907.831 | 1.673.254.918 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 1,00 | 1,00 | – |
| Anteilklasse Premier (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 27.718.559 | 23.588.425 | 22.869.920 |
| Anteile im Umlauf | | 265.395.155 | 234.686.111 | 233.247.856 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,4426 | 100,5105 | 98,0499 |
| Anteilklasse Premier (Acc T2) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 367 | 965 | 1 |
| Anteile im Umlauf | | 3.454 | 9.439 | 10 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 106,2123 | 102,2136 | 99,6860 |
| Anteilklasse Premier (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 4.064.505 | 2.718.222 | 1.074.812 |
| Anteile im Umlauf | | 38.899.174 | 27.032.352 | 10.957.103 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,4882 | 100,5544 | 98,0927 |
| Anteilklasse Premier (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 17.591.660 | 6.274.921 | – |
| Anteile im Umlauf | | 17.591.660.237 | 6.274.921.384 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 1,00 | 1,00 | – |
| Anteilklasse Select (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 465.913 | 289.338 | 84.096 |
| Anteile im Umlauf | | 4.470.194 | 2.883.216 | 858.603 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,2265 | 100,3527 | 97,9447 |
| Anteilklasse Select (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 248.187 | 251.942 | 632.225 |
| Anteile im Umlauf | | 2.418.466 | 2.549.832 | 6.555.870 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 102,6215 | 98,8073 | 96,4364 |
| Anteilklasse Select (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 20.012 | 71.628 | – |
| Anteile im Umlauf | | 20.012.161 | 71.628.331 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 1,00 | 1,00 | – |
| BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | | | | |
| Anteilklasse Admin III | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 16.991 | 7.031 | 4.479 |
| Anteile im Umlauf | | 168.240 | 72.326 | 47.003 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 100,9930 | 97,2096 | 95,2943 |
| Anteilklasse Agency | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 1.819.943 | 1.913.720 | 2.135.626 |
| Anteile im Umlauf | | 15.557.806 | 17.067.574 | 19.511.010 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 116,9794 | 112,1260 | 109,4575 |
| Anteilklasse Core | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 30.365 | 17.028 | 1.041 |
| Anteile im Umlauf | | 256.672 | 149.914 | 9.375 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 118,3029 | 113,5873 | 111,0721 |
| Anteilklasse Heritage (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | – | – | – |
| Anteile im Umlauf | | 2 | 2 | 2 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 99,7100 | 99,5750 | 99,8800 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

| | | 2024 | 2023 | 2022 |
|---|----------|-------------|-------------|------------|
| BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund (Fortsetzung) | | | | |
| Anteilklasse Heritage | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 13.410 | 17.995 | 21.183 |
| Anteile im Umlauf | | 127.087 | 177.755 | 214.139 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 105,5191 | 101,2367 | 98,9209 |
| Anteilklasse J (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 494.643 | 437.500 | 105.555 |
| Anteile im Umlauf | | 4.671.998 | 4.309.849 | 1.064.859 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 105,8741 | 101,5118 | 99,1255 |
| Anteilklasse J (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 28.133 | 53.227 | 4.821 |
| Anteile im Umlauf | | 281.328 | 532.945 | 48.660 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 99,9993 | 99,8726 | 99,0708 |
| Anteilklasse Premier (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 101.695 | 202 | – |
| Anteile im Umlauf | | 1.018.770 | 2.027 | 1 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 99,8211 | 99,6967 | 100,0000 |
| Anteilklasse Premier | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 2.447.579 | 2.632.550 | 2.887.487 |
| Anteile im Umlauf | | 23.449.940 | 26.295.458 | 29.524.467 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,3747 | 100,1142 | 97,7998 |
| Anteilklasse Select | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. EUR | 87.874 | 16.744 | 15.629 |
| Anteile im Umlauf | | 842.904 | 167.359 | 159.837 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 104,2515 | 100,0467 | 97,7826 |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | | | | |
| Anteilklasse Admin III (Dis)¹ | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 38.474 | – | – |
| Anteile im Umlauf | | 38.474.426 | – | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | – | – |
| Anteilklasse Agency (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 364.889 | 311.142 | 789.106 |
| Anteile im Umlauf | | 3.311.083 | 2.972.991 | 7.839.897 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 110,2022 | 104,6561 | 100,6526 |
| Anteilklasse Agency (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 40 | 40 | – |
| Anteile im Umlauf | | 40.000 | 40.000 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | – |
| Anteilklasse Core (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 686.786 | 965.521 | 391.797 |
| Anteile im Umlauf | | 6.260.897 | 9.252.653 | 3.897.347 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 109,6944 | 104,3507 | 100,5292 |
| Anteilklasse Core (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 31.953 | 35.819 | 7.563 |
| Anteile im Umlauf | | 284.220 | 334.919 | 73.404 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 112,4253 | 106,9486 | 103,0319 |
| Anteilklasse Core (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 531.627 | 42.108 | – |
| Anteile im Umlauf | | 531.626.659 | 42.107.978 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | – |
| Anteilklasse Heritage (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 293.042 | 461.685 | 694.759 |
| Anteile im Umlauf | | 2.666.095 | 4.418.820 | 6.907.534 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 109,9141 | 104,4815 | 100,5800 |
| Anteilklasse Heritage (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 155.674 | 146.944 | 184.397 |
| Anteile im Umlauf | | 1.372.460 | 1.362.854 | 1.776.558 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 113,4271 | 107,8209 | 103,7946 |
| Anteilklasse Heritage (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 149.002 | 180.353 | – |
| Anteile im Umlauf | | 149.001.982 | 180.352.615 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | – |
| Anteilklasse Premier (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 580.115 | 540.871 | 448.023 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

| | | 2024 | 2023 | 2022 |
|---|----------|-------------|-------------|------------|
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund (Fortsetzung) | | | | |
| Anteilklasse Premier (Acc T0) (Fortsetzung) | | | | |
| Anteile im Umlauf | | 5.274.305 | 5.174.488 | 4.453.588 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 109,9888 | 104,5264 | 100,5981 |
| Anteilklasse Premier (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 1.935.245 | 1.291.441 | 251.143 |
| Anteile im Umlauf | | 17.172.463 | 12.058.506 | 2.436.558 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 112,6947 | 107,0979 | 103,0730 |
| Anteilklasse Premier (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 708.554 | 345.526 | – |
| Anteile im Umlauf | | 708.554.277 | 345.525.620 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | – |
| Anteilklasse Select (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 235.221 | 41.469 | 9.656 |
| Anteile im Umlauf | | 2.141.483 | 397.071 | 96.019 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 109,8404 | 104,4375 | 100,5600 |
| Anteilklasse Select (Dis)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 59.263 | 295.066 | – |
| Anteile im Umlauf | | 59.263.059 | 295.065.991 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | – |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | | | | |
| Anteilklasse Agency (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 1.511.056 | 1.161.757 | 229.997 |
| Anteile im Umlauf | | 13.580.690 | 11.008.790 | 2.270.226 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 111,2650 | 105,5299 | 101,3102 |
| Anteilklasse Agency (Acc)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 104.986 | 88.112 | – |
| Anteile im Umlauf | | 968.879 | 857.349 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 108,3584 | 102,7731 | – |
| Anteilklasse Agency (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 1.949.798 | 3.398.445 | 4.084.207 |
| Anteile im Umlauf | | 19.495.681 | 33.988.006 | 40.880.430 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 100,0118 | 99,9895 | 99,9061 |
| Anteilklasse Core (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 63.280 | 3.084 | – |
| Anteile im Umlauf | | 585.227 | 30.021 | 1 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 108,1297 | 102,7302 | 100,1500 |
| Anteilklasse Core (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 36.006 | 25.473 | 40.012 |
| Anteile im Umlauf | | 360.034 | 254.760 | 400.507 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 100,0083 | 99,9863 | 99,9042 |
| Anteilklasse Heritage (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 18.921 | 16.909 | 4.032 |
| Anteile im Umlauf | | 170.767 | 160.749 | 39.893 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 110,7991 | 105,1876 | 101,0770 |
| Anteilklasse Heritage (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 20.903 | 24.793 | 16.807 |
| Anteile im Umlauf | | 188.647 | 235.687 | 166.266 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 110,8072 | 105,1954 | 101,0850 |
| Anteilklasse Heritage (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 297.721 | 105.659 | 165.177 |
| Anteile im Umlauf | | 2.976.864 | 1.056.699 | 1.653.319 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 100,0115 | 99,9895 | 99,9063 |
| Anteilklasse J (Acc T3) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 922.093 | 730.736 | 821.654 |
| Anteile im Umlauf | | 8.351.218 | 6.975.715 | 8.167.870 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 110,4142 | 104,7543 | 100,5959 |
| Anteilklasse J (Dis T3)³ | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | – | – | 1 |
| Anteile im Umlauf | | – | – | 10 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | – | – | 99,9100 |
| Anteilklasse Premier (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 924.447 | 1.720.126 | 1.339.737 |
| Anteile im Umlauf | | 8.334.906 | 16.340.252 | 13.247.587 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 110,9127 | 105,2692 | 101,1370 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

| | | 2024 | 2023 | 2022 |
|---|----------|---------------|---------------|---------------|
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund (Fortsetzung) | | | | |
| Anteilklasse Premier (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 3.058.213 | 1.646.639 | 727.357 |
| Anteile im Umlauf | | 27.572.487 | 15.641.794 | 7.192.060 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 110,9153 | 105,2717 | 101,1333 |
| Anteilklasse Premier (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 951.320 | 564.685 | 667.256 |
| Anteile im Umlauf | | 9.520.217 | 5.652.261 | 6.684.523 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 99,9263 | 99,9042 | 99,8210 |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund | | | | |
| Anteilklasse Admin I (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 21.072 | 10.181 | 835 |
| Anteile im Umlauf | | 188.030 | 95.576 | 8.145 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 112,0695 | 106,5208 | 102,5561 |
| Anteilklasse Admin I (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 2.653 | 2.131 | 600 |
| Anteile im Umlauf | | 2.653.099 | 2.130.637 | 600.002 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Admin II (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 15.390 | 9.753 | 11.570 |
| Anteile im Umlauf | | 131.897 | 87.899 | 108.248 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 116,6813 | 110,9597 | 106,8830 |
| Anteilklasse Admin II (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 6.797 | 1.668 | 1.288 |
| Anteile im Umlauf | | 6.797.254 | 1.667.817 | 1.287.779 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Admin III (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 2.102 | 1.017 | 1.270 |
| Anteile im Umlauf | | 17.724 | 9.001 | 11.655 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 118,5834 | 112,9374 | 108,9509 |
| Anteilklasse Admin III (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 20.883 | 20.697 | 16.311 |
| Anteile im Umlauf | | 20.883.235 | 20.696.851 | 16.310.923 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Admin IV (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 5.108 | 2.137 | 1.033 |
| Anteile im Umlauf | | 43.722 | 19.159 | 9.585 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 116,8309 | 111,5463 | 107,7457 |
| Anteilklasse Agency (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 264.623 | 101.279 | 109.634 |
| Anteile im Umlauf | | 2.206.186 | 890.306 | 1.003.210 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 119,9458 | 113,7572 | 109,2831 |
| Anteilklasse Agency (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 6.809.177 | 6.635.468 | 6.735.948 |
| Anteile im Umlauf | | 6.809.176.939 | 6.635.468.260 | 6.735.948.318 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Aon Captives | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 2.173 | 1.350 | 7.305 |
| Anteile im Umlauf | | 2.172.597 | 1.350.469 | 7.304.637 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Core (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 375.899 | 306.493 | 415.850 |
| Anteile im Umlauf | | 2.014.245 | 1.728.747 | 2.437.460 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 186,6202 | 177,2920 | 170,6100 |
| Anteilklasse Core (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 1.697.193 | 1.693.254 | 1.351.183 |
| Anteile im Umlauf | | 1.697.193.440 | 1.693.253.984 | 1.351.182.688 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse G Distributing I | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 3.503 | 1.753 | 1.739 |
| Anteile im Umlauf | | 3.502.536 | 1.753.154 | 1.739.476 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse G Distributing II | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | – | – | – |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

| | | 2024 | 2023 | 2022 |
|--|----------|----------------|----------------|----------------|
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund (Fortsetzung) | | | | |
| Anteilklasse G Distributing II (Fortsetzung) | | | | |
| Anteile im Umlauf | | 381 | 381 | 381 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Heritage (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 387.034 | 360.160 | 273.015 |
| Anteile im Umlauf | | 3.347.445 | 3.281.367 | 2.586.782 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 115,6207 | 109,7592 | 105,5423 |
| Anteilklasse Heritage (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 5.960.789 | 6.021.717 | 6.085.533 |
| Anteile im Umlauf | | 5.960.789.498 | 6.021.717.447 | 6.085.532.706 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Premier (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 5.737.836 | 4.171.814 | 2.852.527 |
| Anteile im Umlauf | | 49.471.164 | 37.899.363 | 26.956.252 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 115,9834 | 110,0761 | 105,8206 |
| Anteilklasse Premier (Dis T1)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 302.273 | 74.403 | – |
| Anteile im Umlauf | | 302.273.134 | 74.402.647 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | – |
| Anteilklasse Premier (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 15.970.225 | 14.228.205 | 14.065.547 |
| Anteile im Umlauf | | 15.970.224.281 | 14.228.205.372 | 14.065.547.055 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse S (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 205.843 | 206.052 | 208.817 |
| Anteile im Umlauf | | 1.791.991 | 1.890.075 | 1.992.471 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 114,8683 | 109,0178 | 104,8033 |
| Anteilklasse Select (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 419.254 | 20.372 | 30.976 |
| Anteile im Umlauf | | 3.643.432 | 186.442 | 294.747 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 115,0712 | 109,2648 | 105,0931 |
| Anteilklasse Select (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 1.472.188 | 1.462.274 | 1.338.606 |
| Anteile im Umlauf | | 1.472.187.803 | 1.462.274.209 | 1.338.605.799 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | | | | |
| Anteilklasse Agency (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 43.857 | 694.812 | 87.011 |
| Anteile im Umlauf | | 436.626 | 6.932.817 | 872.036 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 100,4451 | 100,2207 | 99,7793 |
| Anteilklasse Agency | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 397.575 | 424.090 | 520.334 |
| Anteile im Umlauf | | 2.665.422 | 3.002.975 | 3.842.575 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 149,1601 | 141,2232 | 135,4128 |
| Anteilklasse Core | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 5.817 | 6.318 | 7.524 |
| Anteile im Umlauf | | 40.275 | 46.127 | 57.193 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 144,4306 | 136,9695 | 131,5565 |
| Anteilklasse Heritage (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | – | – | – |
| Anteile im Umlauf | | 1 | 1 | 1 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 100,0000 | 100,0000 | 100,0000 |
| Anteilklasse Heritage | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 12.938 | 15.708 | 14.099 |
| Anteile im Umlauf | | 116.507 | 149.267 | 139.586 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 111,0459 | 105,2362 | 101,0023 |
| Anteilklasse J (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 30.634 | 224.717 | 85.013 |
| Anteile im Umlauf | | 276.193 | 2.139.335 | 843.810 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 110,9153 | 105,0407 | 100,7494 |
| Anteilklasse J (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 26.298 | 14.618 | 30.721 |
| Anteile im Umlauf | | 262.062 | 146.000 | 307.982 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

| | | 2024 | 2023 | 2022 |
|---|----------|------------|------------|------------|
| BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund (Fortsetzung) | | | | |
| J Shares (Dis) (Fortsetzung) | | | | |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 100,3497 | 100,1215 | 99,7504 |
| Anteilklasse Premier (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 52.616 | 84.639 | 23.337 |
| Anteile im Umlauf | | 524.306 | 845.334 | 233.944 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 100,3536 | 100,1253 | 99,7543 |
| Anteilklasse Premier | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 1.184.021 | 865.580 | 834.568 |
| Anteile im Umlauf | | 10.345.030 | 7.982.178 | 8.020.821 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 114,4533 | 108,4391 | 104,0502 |
| Anteilklasse Select | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. GBP | 28.735 | 64.389 | 19.075 |
| Anteile im Umlauf | | 200.383 | 473.698 | 146.179 |
| Nettoinventarwert je Anteil | GBP | 143,3978 | 135,9274 | 130,4913 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | | | | |
| Anteilklasse Agency (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 485.067 | 204.109 | 116.508 |
| Anteile im Umlauf | | 4.265.196 | 1.896.999 | 1.135.634 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 113,7268 | 107,5956 | 102,5925 |
| Anteilklasse Agency (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 3.083.788 | 3.183.574 | 3.592.897 |
| Anteile im Umlauf | | 30.804.619 | 31.824.265 | 35.931.537 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 100,1080 | 100,0361 | 99,9929 |
| Anteilklasse Core (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 4.616 | – | – |
| Anteile im Umlauf | | 43.342 | 1 | 1 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 106,4923 | 102,1010 | 102,4848 |
| Anteilklasse Core (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 1.565 | 11.210 | 2.008 |
| Anteile im Umlauf | | 13.873 | 104.858 | 19.668 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 112,8099 | 106,9102 | 102,1117 |
| Anteilklasse Core (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 65.638 | 53.770 | 123.521 |
| Anteile im Umlauf | | 655.724 | 537.551 | 1.235.385 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 100,1004 | 100,0285 | 99,9857 |
| Anteilklasse Heritage (Acc T0)¹ | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 206 | – | – |
| Anteile im Umlauf | | 1.994 | – | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 103,0827 | – | – |
| Anteilklasse Heritage (Acc)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 30.696 | 9.948 | – |
| Anteile im Umlauf | | 273.462 | 93.582 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 112,2488 | 106,2986 | – |
| Anteilklasse Heritage (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 27.236 | 51.955 | 37.282 |
| Anteile im Umlauf | | 272.081 | 519.401 | 372.874 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 100,1010 | 100,0293 | 99,9857 |
| Anteilklasse Premier (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 292.904 | 217.030 | 12.206 |
| Anteile im Umlauf | | 2.585.561 | 2.023.562 | 119.276 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 113,2845 | 107,2517 | 102,3360 |
| Anteilklasse Premier (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 294.877 | 87.751 | 95.196 |
| Anteile im Umlauf | | 2.603.628 | 818.379 | 930.448 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 113,2562 | 107,2259 | 102,3115 |
| Anteilklasse Premier (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 91.851 | 51.502 | 76.206 |
| Anteile im Umlauf | | 917.582 | 514.873 | 762.165 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 100,1013 | 100,0294 | 99,9861 |
| Anteilklasse Select (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 3.754 | 12.329 | 10.050 |
| Anteile im Umlauf | | 37.501 | 123.250 | 100.511 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 100,1007 | 100,0290 | 99,9859 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

| | | 2024 | 2023 | 2022 |
|---|----------|---------------|---------------|---------------|
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | | | | |
| Anteilklasse Admin I (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 278.189 | 107.453 | 23.213 |
| Anteile im Umlauf | | 2.356.180 | 959.251 | 216.837 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 118,0678 | 112,0175 | 107,0544 |
| Anteilklasse Admin I (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 4.201 | 1 | 1 |
| Anteile im Umlauf | | 4.200.669 | 669 | 669 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Admin II (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 139.469 | 106.973 | 128.105 |
| Anteile im Umlauf | | 1.168.848 | 944.457 | 1.182.875 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 119,3220 | 113,2640 | 108,2997 |
| Anteilklasse Admin II (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 37.793 | 35.960 | 48.467 |
| Anteile im Umlauf | | 37.793.456 | 35.959.678 | 48.467.159 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Admin III (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 58.128 | 26.643 | 27.894 |
| Anteile im Umlauf | | 482.795 | 232.776 | 254.495 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 120,3999 | 114,4583 | 109,6055 |
| Anteilklasse Admin III (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 64.399 | 248.140 | 127.033 |
| Anteile im Umlauf | | 64.398.997 | 248.140.281 | 127.033.436 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Admin IV (Acc T0)¹ | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 41 | – | – |
| Anteile im Umlauf | | 400 | – | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 103,5186 | – | – |
| Anteilklasse Admin IV (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 83.541 | 49.756 | 33.992 |
| Anteile im Umlauf | | 704.033 | 439.982 | 313.114 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 118,6603 | 113,0863 | 108,5619 |
| Anteilklasse Admin IV (Dis)¹ | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 40 | – | – |
| Anteile im Umlauf | | 40.000 | – | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | – | – |
| Anteilklasse Agency (Acc T0)² | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 480.083 | 44.059 | – |
| Anteile im Umlauf | | 4.391.801 | 425.759 | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 109,3134 | 103,4843 | – |
| Anteilklasse Agency (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 133.143 | 46.421 | 41.129 |
| Anteile im Umlauf | | 1.100.842 | 405.431 | 376.691 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 120,9469 | 114,4975 | 109,1848 |
| Anteilklasse Agency (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 7.108.834 | 5.637.119 | 4.453.050 |
| Anteile im Umlauf | | 7.108.833.816 | 5.637.118.694 | 4.453.050.048 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Aon Captives | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 106.327 | 30.612 | 83.332 |
| Anteile im Umlauf | | 106.326.639 | 30.611.549 | 83.332.227 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Core (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 832.045 | 243.324 | 30.025 |
| Anteile im Umlauf | | 7.423.606 | 2.289.371 | 295.745 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 112,0809 | 106,2844 | 101,5247 |
| Anteilklasse Core (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 1.707.003 | 1.028.866 | 664.070 |
| Anteile im Umlauf | | 10.022.874 | 6.370.578 | 4.304.590 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 170,3107 | 161,5028 | 154,2702 |
| Anteilklasse Core (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 9.523.286 | 7.071.428 | 9.204.469 |
| Anteile im Umlauf | | 9.523.286.165 | 7.071.428.047 | 9.204.469.124 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

| | | 2024 | 2023 | 2022 |
|---|----------|----------------|----------------|----------------|
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund (Fortsetzung) | | | | |
| Anteilklasse Core (Dis) (Fortsetzung) | | | | |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Klasse FA³ | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | – | – | – |
| Anteile im Umlauf | | – | – | 100 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | – | – | 1,00 |
| Anteilklasse G Accumulating II | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 3.689 | 2.888 | 2.065 |
| Anteile im Umlauf | | 3.117 | 2.572 | 1.925 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1.183,3416 | 1.122,7024 | 1.072,9596 |
| Anteilklasse G Accumulating | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 242.687 | 227.762 | 148.987 |
| Anteile im Umlauf | | 19.866 | 19.661 | 13.464 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 12.216,3579 | 11.584,5625 | 11.065,7752 |
| Anteilklasse G Distributing I | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 624 | 596 | 7.052 |
| Anteile im Umlauf | | 624.065 | 595.679 | 7.051.544 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse G Distributing II³ | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | – | – | – |
| Anteile im Umlauf | | – | – | 209 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | – | – | 1,0000 |
| Anteilklasse G Distributing | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 251.717 | 189.004 | 115.970 |
| Anteile im Umlauf | | 251.717.036 | 189.004.098 | 115.970.183 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse G Heritage (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 3.422 | 7.054 | 11.046 |
| Anteile im Umlauf | | 307 | 668 | 1.096 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 11.141,9898 | 10.557,8534 | 10.077,5058 |
| Anteilklasse G Heritage (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 11.827 | 12.485 | 1.984 |
| Anteile im Umlauf | | 11.827.144 | 12.484.745 | 1.984.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Heritage (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 238.072 | 23.887 | 21.404 |
| Anteile im Umlauf | | 2.100.202 | 222.380 | 208.766 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 113,3566 | 107,4137 | 102,5268 |
| Anteilklasse Heritage (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 3.464.302 | 2.337.951 | 622.550 |
| Anteile im Umlauf | | 28.877.068 | 20.566.478 | 5.737.485 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 119,9672 | 113,6778 | 108,5058 |
| Anteilklasse Heritage (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 9.202.420 | 9.015.693 | 12.753.662 |
| Anteile im Umlauf | | 9.202.420.085 | 9.015.693.110 | 12.753.662.010 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Klasse N | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 67.970 | 57.428 | 75.645 |
| Anteile im Umlauf | | 67.970.485 | 57.428.095 | 75.645.421 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Premier (Acc T0) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 6.689.935 | 4.856.497 | 3.518.665 |
| Anteile im Umlauf | | 58.928.760 | 45.157.960 | 34.286.253 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 113,5258 | 107,5446 | 102,6261 |
| Anteilklasse Premier (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 4.904.139 | 3.197.967 | 3.423.343 |
| Anteile im Umlauf | | 40.873.281 | 28.134.951 | 31.561.066 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 119,9840 | 113,6653 | 108,4673 |
| Anteilklasse Premier (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 33.053.452 | 28.179.753 | 26.256.604 |
| Anteile im Umlauf | | 33.053.451.211 | 28.179.752.804 | 26.256.600.880 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Select (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 243.700 | 161.758 | 187.068 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

| | | 2024 | 2023 | 2022 |
|---|----------|---------------|---------------|---------------|
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund (Fortsetzung) | | | | |
| Anteilklasse Select (Acc) (Fortsetzung) | | | | |
| Anteile im Umlauf | | 2.039.394 | 1.428.207 | 1.729.965 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 119,4962 | 113,2597 | 108,1337 |
| Anteilklasse Select (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 2.805.106 | 2.198.556 | 1.977.789 |
| Anteile im Umlauf | | 2.805.105.985 | 2.198.556.049 | 1.977.788.998 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | | | | |
| Anteilklasse Agency | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 5.064 | 164.243 | 2.100.952 |
| Anteile im Umlauf | | 41.032 | 1.410.420 | 18.943.634 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 123,4214 | 116,4499 | 110,9054 |
| Anteilklasse Core | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 20.132 | 33.798 | 10.057 |
| Anteile im Umlauf | | 180.203 | 319.955 | 99.793 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 111,7171 | 105,6328 | 100,7742 |
| Anteilklasse Heritage (CHF Hedged) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. CHF | 25.595 | 67.342 | 8.451 |
| Anteile im Umlauf | | 252.693 | 675.248 | 85.323 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 101,2883 | 99,7297 | 99,0456 |
| Anteilklasse Heritage (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | – | – | – |
| Anteile im Umlauf | | 1 | 1 | 1 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 99,4300 | 100,0000 | 100,0000 |
| Anteilklasse Heritage (SGD Hedged) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. SGD | 21.800 | 9.543 | 23.762 |
| Anteile im Umlauf | | 200.547 | 91.280 | 235.911 |
| Nettoinventarwert je Anteil | SGD | 108,7016 | 104,5490 | 100,7226 |
| Anteilklasse Heritage | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 232.916 | 560.426 | 761.644 |
| Anteile im Umlauf | | 2.006.984 | 5.111.124 | 7.286.698 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 116,0525 | 109,6483 | 104,5252 |
| Anteilklasse J (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 358.241 | 138.568 | 238.006 |
| Anteile im Umlauf | | 3.188.523 | 1.306.166 | 2.354.965 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 112,3532 | 106,0873 | 101,0658 |
| Anteilklasse J (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 86.500 | 56.602 | 22.544 |
| Anteile im Umlauf | | 864.989 | 567.238 | 226.135 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 100,0011 | 99,7848 | 99,6935 |
| Anteilklasse Premier (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 46.363 | 35.081 | 17.571 |
| Anteile im Umlauf | | 462.178 | 350.467 | 175.696 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 100,3151 | 100,0980 | 100,0063 |
| Anteilklasse Premier | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 5.769.816 | 3.101.392 | 758.528 |
| Anteile im Umlauf | | 47.414.635 | 26.980.865 | 6.923.778 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 121,6885 | 114,9478 | 109,5541 |
| Anteilklasse Select | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 324.877 | 322.359 | 412.786 |
| Anteile im Umlauf | | 2.620.019 | 2.750.826 | 3.694.157 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 123,9981 | 117,1861 | 111,7403 |
| BlackRock ICS US Treasury Fund | | | | |
| Anteilklasse Admin III (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 68.162 | 9.383 | 11.198 |
| Anteile im Umlauf | | 68.162.223 | 9.383.144 | 11.197.933 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Agency (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 14.210 | 5.552 | 21.285 |
| Anteile im Umlauf | | 120.548 | 49.668 | 199.130 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 117,8782 | 111,7792 | 106,8922 |
| Anteilklasse Agency (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 1.187.521 | 655.919 | 627.069 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

| | | 2024 | 2023 | 2022 |
|---|----------|----------------|---------------|---------------|
| BlackRock ICS US Treasury Fund (Fortsetzung) | | | | |
| Anteilklasse (Dis) (Fortsetzung) | | | | |
| Anteile im Umlauf | | 1.187.521.099 | 655.919.271 | 627.069.203 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Core (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 259.250 | 237.703 | 173.465 |
| Anteile im Umlauf | | 2.228.023 | 2.150.664 | 1.638.433 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 116,3586 | 110,5255 | 105,8727 |
| Anteilklasse Core (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 10.377.352 | 9.059.377 | 8.618.565 |
| Anteile im Umlauf | | 10.377.352.093 | 9.059.377.437 | 8.618.565.001 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Klasse FA³ | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | – | – | – |
| Anteile im Umlauf | | – | – | 100 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | – | – | 1,00 |
| Anteilklasse E (Dis)¹ | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 40 | – | – |
| Anteile im Umlauf | | 40.000 | – | – |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | – | – |
| Anteilklasse G Accumulating | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 31.191 | 4.899 | 1.414 |
| Anteile im Umlauf | | 2.770 | 458 | 138 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 11.260,2565 | 10.695,7795 | 10.245,5133 |
| Anteilklasse G Distributing | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 17.612 | 1.996 | 581 |
| Anteile im Umlauf | | 17.612.313 | 1.995.673 | 581.110 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse G Heritage (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 7.114 | 20.090 | 5.793 |
| Anteile im Umlauf | | 642 | 1.909 | 575 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 11.086,8133 | 10.523,1528 | 10.072,6184 |
| Anteilklasse G Heritage (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 1.582 | 948 | 708 |
| Anteile im Umlauf | | 1.582.400 | 948.471 | 708.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Heritage (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 379.208 | 314.235 | 31.191 |
| Anteile im Umlauf | | 3.252.198 | 2.839.324 | 294.435 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 116,6004 | 110,6724 | 105,9341 |
| Anteilklasse Heritage (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 2.036.851 | 2.056.143 | 1.546.466 |
| Anteile im Umlauf | | 2.036.851.433 | 2.056.143.313 | 1.546.465.776 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Klasse N | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | – | – | – |
| Anteile im Umlauf | | 100 | 100 | 100 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Premier (Acc) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 2.008.892 | 1.088.949 | 304.282 |
| Anteile im Umlauf | | 17.151.169 | 9.797.468 | 2.860.849 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 117,1286 | 111,1460 | 106,3609 |
| Anteilklasse Premier (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 12.255.600 | 8.011.130 | 9.683.767 |
| Anteile im Umlauf | | 12.255.599.069 | 8.011.129.708 | 9.683.765.667 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |
| Anteilklasse Select (Dis) | | | | |
| Nettoinventarwert | Tsd. USD | 375.810 | 1.043.508 | 495.887 |
| Anteile im Umlauf | | 375.809.811 | 1.043.507.887 | 495.887.056 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 1,00 | 1,00 | 1,00 |

¹Die Anteilklasse wurde während des Geschäftsjahres aufgelegt. Daher liegen keine Vergleichsdaten vor.

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

³Die Anteilklasse wurde während des vorherigen Geschäftsjahres geschlossen.

15. Wechselkurse

Zum 30. September 2024 und zum 30. September 2023 galten folgende Wechselkurse:

| | 30. September 2024 | 30. September 2023 |
|----------------|--------------------|--------------------|
| EUR = 1 | | |
| CAD | 1,5077 | 1,4314 |
| GBP | 0,8320 | 0,8674 |
| USD | 1,1161 | 1,0588 |
| GBP = 1 | | |
| CAD | 1,8121 | 1,6502 |
| EUR | 1,2019 | 1,1528 |
| USD | 1,3414 | 1,2206 |
| USD = 1 | | |
| CAD | 1,3510 | 1,3520 |
| CHF | 0,8436 | 0,9148 |
| EUR | 0,8960 | 0,9445 |
| GBP | 0,7455 | 0,8193 |
| SGD | 1,2820 | 1,3649 |

Die durchschnittlichen Wechselkurse am Ende des Geschäftsjahres waren:

| | 30. September 2024 | 30. September 2023 |
|----------------|--------------------|--------------------|
| GBP = 1 | | |
| EUR | 1,1694 | 1,1490 |
| USD | 1,2681 | 1,2268 |

16. Transaktionen mit nahestehenden Parteien

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

Die folgenden Unternehmen waren im Geschäftsjahr zum 30. September 2024 dem Unternehmen nahestehende Parteien:

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

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

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

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

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

Die an die Verwaltungsgesellschaft und den Investmentmanager im Laufe des Geschäftsjahres gezahlten Gebühren, die Natur dieser Transaktionen und die zum Ende des Geschäftsjahres offenen Salden finden sich jeweils in den Anmerkungen 6 und 12.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

16. Transaktionen mit nahestehenden Parteien (Fortsetzung)

Die Verwaltungsratsmitglieder zum 30. September 2024 sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt:

| Verwaltungsratsmitglieder | Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe | Verwaltungsratsmitglied bei verbundenen Unternehmen von BlackRock und/oder von BlackRock verwalteten Fonds |
|---------------------------|----------------------------------|--|
| Barry O'Dwyer | Nein | Ja |
| Francis Drought | Ja | Ja |
| Nicola Grenham | Nein | Ja |
| Tom McGrath | Ja | Ja |

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

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

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

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

| Investitionen | Vom Fonds gezahlte Gebühr |
|--|--|
| Investmentgesellschaft - in Irland von der CBI zugelassene OGAW | |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0) | Jahresaufwand auf 0,03 % des NIW begrenzt ¹ |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Dis) | Jahresaufwand auf 0,03 % des NIW begrenzt ¹ |

¹Die Verwaltungsgesellschaft dieser Anlagen ist für die Abführung der jährlichen Aufwendungen der Fonds aus ihrem Honorar verantwortlich. Wenn die tatsächlichen Gebühren und Kosten den an die Verwaltungsgesellschaft gezahlten Betrag übersteigen, wird die Verwaltungsgesellschaft den Mehrbetrag aus ihrem Vermögen begleichen.

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

Bedeutende Anleger

Die folgenden Anleger sind:

- von der BlackRock-Gruppe verwaltete Fonds oder verbundene Unternehmen von BlackRock, Inc. („BlackRock nahestehende Anleger“) oder
- Anleger (mit Ausnahme der in Punkt (a) oben genannten), die 20 % oder mehr der im Umlauf befindlichen stimmberechtigten Anteile des Unternehmens gehalten haben und demzufolge als dem Unternehmen nahestehende Parteien gelten („bedeutende Anleger“).

Zum 30. September 2024

| Name des Fonds | Gesamtanteil der von BlackRock nahestehenden Anlegern gehaltenen Anteile in % | Gesamtanteil der von bedeutenden Anlegern, die keine nahestehenden Anleger von BlackRock sind, gehaltenen Anteile in % | Anzahl der bedeutenden Anleger, die keine BlackRock nahestehenden Anleger sind |
|---|---|--|--|
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | 1,81 | null | null |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | 2,92 | null | null |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | – ¹ | 24,10 | 1 |
| BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | – ¹ | null | null |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | – ¹ | null | null |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | 0,29 | 24,59 | 1 |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund | 1,24 | null | null |
| BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | – ¹ | 33,42 | 1 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | 1,07 | null | null |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | 0,05 | null | null |
| BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | – ¹ | 63,71 | 1 |
| BlackRock ICS US Treasury Fund | – ¹ | null | null |

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

16. Transaktionen mit nahestehenden Parteien (Fortsetzung)

Bedeutende Anleger (Fortsetzung) Zum 30. September 2023

| Name des Fonds | Gesamtanteil der von BlackRock nahestehenden Anlegern gehaltenen Anteile in % | Gesamtanteil der von bedeutenden Anlegern, die keine nahestehenden Anleger von BlackRock sind, gehaltenen Anteile in % | Anzahl der bedeutenden Anleger, die keine BlackRock nahestehenden Anleger sind |
|---|---|--|--|
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | 0,05 | 38,77 | 1 |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | 3,21 | null | null |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | 0,01 | 20,97 | 1 |
| BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | – ¹ | null | null |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | 0,02 | 32,62 | 1 |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | 0,24 | null | null |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund | 0,83 | null | null |
| BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | – ¹ | 51,41 | 2 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | 8,91 | null | null |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | 0,02 | null | null |
| BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | – ¹ | 70,83 | 1 |
| BlackRock ICS US Treasury Fund | – ¹ | null | null |

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

Die Fonds haben zum Ende des Geschäftsjahres keine Rückstellungen für Forderungen gegenüber nahestehenden Parteien erfasst (30. September 2023: null).

Es wurden im Geschäftsjahr keine Abschreibungen für Forderungen oder Verbindlichkeiten gegenüber nahestehenden Parteien vorgenommen (30. September 2023: null).

Es wurden im Geschäftsjahr gegenüber nahestehenden Parteien keine besicherten oder unbesicherten Verpflichtungen oder Garantien eingegangen (30. September 2023: null).

17. Verpflichtungen und Eventualverbindlichkeiten

Zum 30. September 2024 und 30. September 2023 bestanden keine wesentlichen Verpflichtungen oder Eventualverbindlichkeiten.

18. Gesetzlich vorgeschriebene Angaben

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

| | 2024 Tsd. EUR | 2023 Tsd. EUR |
|--|------------------|------------------|
| Honorar der Verwaltungsratsmitglieder | 65 | 65 |
| Prüfungsgebühren (einschließlich Kosten) im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses | 120 | 117 |
| Nicht prüfungsbezogene Gebühren | 77 | 75 |

Die Honorare der Verwaltungsratsmitglieder wird die Summe von 50.000 GBP jährlich je Verwaltungsratsmitglied ohne Genehmigung des Verwaltungsrates nicht überschreiten.

19. Ereignisse nach dem Stichtag

Am 8. November 2024 wurden alle Anteile der Klasse Core (Acc) des BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund aufgelegt.

Am 31. Dezember 2024 trat Tom McGrath als nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied des Unternehmens zurück.

Abgesehen von den oben aufgeführten gab es nach Ablauf des Geschäftsjahres keine Ereignisse, die sich nach Auffassung des Verwaltungsrats auf den Jahresabschluss für das am 30. September 2024 beendete Geschäftsjahr ausgewirkt haben könnten.

20. Genehmigungsdatum

Am 30. Januar 2025 wurde der Jahresabschluss vom Verwaltungsrat genehmigt.

BLACKROCK ICS EURO GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| Österreich (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 35.000.000 | EUR | Republic of Austria, 0.00%, 21/10/2024 | 34.934 | 1,04 |
| 5.000.000 | EUR | Republic of Austria, 0.00%, 24/10/2024 | 4.989 | 0,15 |
| 100.000.000 | EUR | Republic of Austria, 0.00%, 04/11/2024 | 99.674 | 2,97 |
| | | Österreich - Gesamt | 139.597 | 4,16 |
| Niederlande (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 125.000.000 | EUR | Kingdom of the Netherlands, 0.00%, 23/10/2024 | 124.738 | 3,71 |
| | | Niederlande - Gesamt | 124.738 | 3,71 |
| | | Anlagen in Commercial Papers - Gesamt | 264.335 | 7,87 |

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|-----------------|---------|---------------|----------------------|-------------------------------|
| ANLEIHEN | | | | |

Staatsanleihen (30. September 2023: 8,44 %)

| | | | | |
|---|-----|--|----------------|--------------|
| Österreich (30. September 2023: 3,95 %) | | | | |
| | | | - | - |
| Belgien (30. September 2023: 0,02 %) | | | | |
| 50.000.000 | EUR | Belgium Treasury Bill, 0.00%, 09/01/2025 ¹ | 49.537 | 1,48 |
| | | Belgien - Gesamt | 49.537 | 1,48 |
| Frankreich (30. September 2023: 4,46 %) | | | | |
| 100.000 | EUR | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 02/10/2024 ¹ | 100 | 0,01 |
| 100.000 | EUR | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 09/10/2024 ¹ | 100 | - |
| 125.000.000 | EUR | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 16/10/2024 ¹ | 124.810 | 3,72 |
| 100.000 | EUR | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 23/10/2024 ¹ | 100 | - |
| 100.000 | EUR | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 30/10/2024 ¹ | 100 | - |
| 316.500.000 | EUR | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 14/11/2024 ¹ | 315.105 | 9,39 |
| 50.000.000 | EUR | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 20/11/2024 ¹ | 49.758 | 1,48 |
| 100.000 | EUR | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 27/11/2024 ¹ | 99 | - |
| 50.000.000 | EUR | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 04/12/2024 ¹ | 49.696 | 1,48 |
| 50.000.000 | EUR | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 11/12/2024 ¹ | 49.648 | 1,48 |
| 50.000.000 | EUR | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 08/01/2025 ¹ | 49.563 | 1,48 |
| | | Frankreich - Gesamt | 639.079 | 19,04 |
| Deutschland (30. September 2023: 0,01 %) | | | | |
| | | | - | - |
| | | Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt | 688.616 | 20,52 |

Supranationale Wertpapiere (30. September 2023: 1,63 %)

| | | | | |
|------------|-----|--|--------|------|
| 50.000.000 | EUR | European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 17/10/2024 ¹ | 49.919 | 1,49 |
| 60.000.000 | EUR | European Union Bill, 0.00%, 04/10/2024 ¹ | 59.982 | 1,79 |
| 75.000.000 | EUR | European Union Bill, 0.00%, 08/11/2024 ¹ | 74.719 | 2,22 |
| 100.000 | EUR | European Union Bill, 0.00%, 06/12/2024 ¹ | 99 | - |

BLACKROCK ICS EURO GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | | | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|-----------|------------------------|----------------------|-------------------------------|
| ANLEIHEN (Fortsetzung) | | | | | | |
| Supranationale Wertpapiere (Fortsetzung) | | | | | | |
| 100.000 | EUR | European Union Bill, 0.00%, 10/01/2025 ¹ | | | 99 | – |
| Anlagen in supranationalen Wertpapieren - Gesamt | | | | | 184.818 | 5,50 |
| Anlagen in Anleihen - Gesamt | | | | | 873.434 | 26,02 |
| Bestand | Währung | Kontrahent | Zinssätze | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
| Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2023: 88,86 %) | | | | | | |
| Australien (30. September 2023: 0,00 %) | | | | | | |
| 200.000.000 | EUR | National Australia Bank Ltd. | 3,39 % | 01.10.2024 | 200.000 | 5,96 |
| Australien - Gesamt | | | | | 200.000 | 5,96 |
| Kanada (30. September 2023: 13,26 %) | | | | | | |
| Frankreich (30. September 2023: 41,96 %) | | | | | | |
| 200.000.000 | EUR | BNP Paribas SA | 3,42 % | 01.10.2024 | 200.000 | 5,96 |
| | | Credit Agricole Corporate and Investment | | | | |
| 150.000.000 | EUR | Bank | 3,45 % | 01.10.2024 | 150.000 | 4,47 |
| 250.000.000 | EUR | Natixis SA | 3,46 % | 01.10.2024 | 250.000 | 7,45 |
| 200.000.000 | EUR | Societe Generale SA | 3,42 % | 01.10.2024 | 200.000 | 5,96 |
| Frankreich - Gesamt | | | | | 800.000 | 23,84 |
| Japan (30. September 2023: 13,32 %) | | | | | | |
| 150.000.000 | EUR | MUFG Securities EMEA plc | 3,40 % | 01.10.2024 | 150.000 | 4,47 |
| Japan - Gesamt | | | | | 150.000 | 4,47 |
| Spanien (30. September 2023: 13,32 %) | | | | | | |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 6,66 %) | | | | | | |
| 200.000.000 | EUR | Bank of Nova Scotia plc | 3,45 % | 01.10.2024 | 200.000 | 5,96 |
| 150.000.000 | EUR | Canadian Imperial Bank of Commerce | 3,40 % | 01.10.2024 | 150.000 | 4,47 |
| 150.000.000 | EUR | Canadian Imperial Bank of Commerce | 3,40 % | 02.10.2024 | 150.000 | 4,47 |
| 150.000.000 | EUR | Goldman Sachs International | 3,43 % | 01.10.2024 | 150.000 | 4,47 |
| 150.000.000 | EUR | Goldman Sachs International | 3,45 % | 02.10.2024 | 150.000 | 4,47 |
| 200.000.000 | EUR | J.P. Morgan Securities plc | 3,42 % | 01.10.2024 | 200.000 | 5,96 |
| 200.000.000 | EUR | J.P. Morgan Securities plc | 3,43 % | 02.10.2024 | 200.000 | 5,96 |
| 200.000.000 | EUR | NatWest Markets plc | 3,45 % | 01.10.2024 | 200.000 | 5,96 |
| 200.000.000 | EUR | Santander UK plc | 3,42 % | 01.10.2024 | 200.000 | 5,96 |
| Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | | | 1.600.000 | 47,68 |

BLACKROCK ICS EURO GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Kontrahent | Zinssätze | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---------------------------|-----------|------------------------|----------------------|-------------------------------|
| Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung) | | | | | | |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 0,34 %) | | | | | | |
| 5.000.000 | EUR | BofA Securities Europe SA | 3,38 % | 01.10.2024 | 5.000 | 0,15 |
| Vereinigte Staaten - Gesamt | | | | | 5.000 | 0,15 |
| Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt | | | | | 2.755.000 | 82,10 |
| | | | | | Zeitwert | % des Netto- |
| | | | | | Tsd. EUR | inventarwerts |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt | | | | | 3.892.769 | 115,99 |
| Barmittel und Barsicherheiten | | | | | 22.236 | 0,66 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | | | | (558.783) | (16,65) |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert | | | | | 3.356.222 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | | | | % des |
| Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | | | | | Gesamt- |
| Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden | | | | | | vermögens |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c) | | | | | | 22,31 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | | 70,36 |
| Gesamtvermögen | | | | | | 6,75 |
| | | | | | | 0,58 |
| | | | | | | 100,00 |

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

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (30. September 2023: 26,64 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 10.500.000 | EUR | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 05/06/2025 | 10.293 | 0,15 |
| 56.500.000 | EUR | National Australia Bank Ltd., 3.84%, 02/01/2025 | 56.519 | 0,81 |
| 46.000.000 | EUR | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 02/01/2025 | 45.606 | 0,65 |
| 55.000.000 | EUR | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 03/02/2025 | 54.385 | 0,78 |
| 55.500.000 | EUR | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 05/03/2025 | 54.751 | 0,79 |
| 68.000.000 | EUR | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 15/05/2025 | 66.737 | 0,96 |
| 19.000.000 | EUR | National Australia Bank Ltd., 3.67%, 05/09/2025 | 18.997 | 0,27 |
| Australien - Gesamt | | | 307.288 | 4,41 |
| Belgien (30. September 2023: 4,37 %) | | | | |
| 46.000.000 | EUR | KBC Bank NV, 0.00%, 03/01/2025 | 45.605 | 0,65 |
| Belgien - Gesamt | | | 45.605 | 0,65 |
| Kanada (30. September 2023: 4,47 %) | | | | |
| 27.000.000 | EUR | Bank of Montreal, 3.84%, 04/10/2024 | 27.000 | 0,39 |
| 50.000.000 | EUR | Bank of Montreal, 0.00%, 25/10/2024 | 49.881 | 0,72 |
| 15.000.000 | EUR | Royal Bank of Canada, 0.00%, 05/06/2025 | 14.701 | 0,21 |
| 31.000.000 | EUR | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 26/02/2025 | 30.600 | 0,44 |
| 32.000.000 | EUR | Toronto-Dominion Bank (The), 3.71%, 23/05/2025 | 32.000 | 0,46 |
| 125.500.000 | EUR | Toronto-Dominion Bank (The), 3.73%, 18/08/2025 | 125.489 | 1,80 |
| 95.000.000 | EUR | Toronto-Dominion Bank (The), 3.74%, 19/09/2025 | 95.000 | 1,36 |
| Kanada - Gesamt | | | 374.671 | 5,38 |
| Finnland (30. September 2023: 0,57 %) | | | | |
| | | | - | - |
| Frankreich (30. September 2023: 4,66 %) | | | | |
| 227.000.000 | EUR | Credit Agricole SA, 0.00%, 02/01/2025 | 225.050 | 3,23 |
| 7.000.000 | EUR | Credit Agricole SA, 0.00%, 07/02/2025 | 6.919 | 0,10 |
| 61.000.000 | EUR | Credit Agricole SA, 3.66%, 03/03/2025 | 61.000 | 0,87 |
| Frankreich - Gesamt | | | 292.969 | 4,20 |
| Japan (30. September 2023: 7,16 %) | | | | |
| 7.500.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 01/10/2024 | 7.499 | 0,11 |
| 25.000.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 07/10/2024 | 24.983 | 0,36 |
| 16.000.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 09/10/2024 | 15.986 | 0,23 |
| 10.000.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 10/10/2024 | 9.991 | 0,14 |
| 35.000.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 03/12/2024 | 34.791 | 0,50 |
| 17.000.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 05/12/2024 | 16.895 | 0,24 |
| 17.500.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 03/02/2025 | 17.302 | 0,25 |
| 60.000.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 16/10/2024 | 59.909 | 0,86 |
| 20.000.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 23/10/2024 | 19.957 | 0,29 |
| 40.000.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 18/11/2024 | 39.816 | 0,57 |
| 18.000.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 25/11/2024 | 17.906 | 0,26 |
| 20.000.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 04/12/2024 | 19.879 | 0,29 |
| 66.500.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 02/01/2025 | 65.930 | 0,95 |
| 25.000.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 03/01/2025 | 24.783 | 0,36 |
| 18.500.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 18.335 | 0,26 |
| 40.000.000 | EUR | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 13/11/2024 | 39.834 | 0,57 |
| 25.000.000 | EUR | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 18/11/2024 | 24.885 | 0,36 |
| 27.000.000 | EUR | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 03/02/2025 | 26.692 | 0,38 |
| 72.500.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 14/10/2024 | 72.404 | 1,04 |
| 50.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 02/01/2025 | 49.571 | 0,71 |
| 30.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 03/01/2025 | 29.740 | 0,43 |
| 50.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 07/01/2025 | 49.550 | 0,71 |
| 38.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 08/01/2025 | 37.655 | 0,54 |
| 15.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 09/01/2025 | 14.862 | 0,21 |
| 10.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 13/01/2025 | 9.905 | 0,14 |

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| Japan (Fortsetzung) | | | | |
| 18.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 15/10/2024 | 17.974 | 0,26 |
| 18.500.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 16/10/2024 | 18.472 | 0,26 |
| 18.500.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 15/11/2024 | 18.420 | 0,26 |
| 5.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 22/11/2024 | 4.975 | 0,07 |
| 10.500.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 12/12/2024 | 10.429 | 0,15 |
| 46.500.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 10/01/2025 | 46.069 | 0,66 |
| 10.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 10/01/2025 | 9.907 | 0,14 |
| 8.500.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 14/01/2025 | 8.418 | 0,12 |
| 45.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 17/01/2025 | 44.557 | 0,64 |
| Japan - Gesamt | | | 928.281 | 13,32 |
| Niederlande (30. September 2023: 0,40 %) | | | | |
| 75.000.000 | EUR | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 06/12/2024 | 74.525 | 1,07 |
| 44.500.000 | EUR | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 02/01/2025 | 44.118 | 0,63 |
| 25.000.000 | EUR | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 02/01/2025 | 24.785 | 0,36 |
| Niederlande - Gesamt | | | 143.428 | 2,06 |
| Norwegen (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 170.000.000 | EUR | DNB Bank ASA, 3.90%, 04/11/2024 | 170.043 | 2,44 |
| Norwegen - Gesamt | | | 170.043 | 2,44 |
| Südkorea (30. September 2023: 0,57 %) | | | | |
| 5.000.000 | EUR | KEB Hana Bank, 0.00%, 11/10/2024 | 4.995 | 0,07 |
| 20.000.000 | EUR | KEB Hana Bank, 0.00%, 25/11/2024 | 19.893 | 0,29 |
| 3.500.000 | EUR | KEB Hana Bank, 0.00%, 02/12/2024 | 3.479 | 0,05 |
| 10.000.000 | EUR | KEB Hana Bank, 0.00%, 13/12/2024 | 9.930 | 0,14 |
| 15.000.000 | EUR | KEB Hana Bank, 0.00%, 29/01/2025 | 14.831 | 0,21 |
| 10.000.000 | EUR | KEB Hana Bank, 0.00%, 24/02/2025 | 9.864 | 0,14 |
| 4.000.000 | EUR | Kookmin Bank, 0.00%, 24/10/2024 | 3.991 | 0,06 |
| 4.500.000 | EUR | Kookmin Bank, 0.00%, 25/11/2024 | 4.477 | 0,07 |
| 58.500.000 | EUR | Kookmin Bank, 0.00%, 09/01/2025 | 57.962 | 0,83 |
| 7.000.000 | EUR | Kookmin Bank, 3.69%, 17/06/2025 | 7.000 | 0,10 |
| Südkorea - Gesamt | | | 136.422 | 1,96 |
| Schweiz (30. September 2023: 1,23 %) | | | | |
| 30.000.000 | EUR | UBS AG, 3.74%, 11/07/2025 | 30.001 | 0,43 |
| Schweiz - Gesamt | | | 30.001 | 0,43 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 2,82 %) | | | | |
| 11.500.000 | EUR | Mizuho International plc, 0.00%, 07/10/2024 | 11.492 | 0,16 |
| 4.000.000 | EUR | Mizuho International plc, 0.00%, 05/12/2024 | 3.976 | 0,06 |
| 50.000.000 | EUR | Standard Chartered Bank, 3.68%, 25/07/2025 | 50.000 | 0,72 |
| Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | 65.468 | 0,94 |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 0,39 %) | | | | |
| 17.000.000 | EUR | Citibank NA, 0.00%, 23/10/2024 | 16.964 | 0,24 |
| Vereinigte Staaten - Gesamt | | | 16.964 | 0,24 |
| Anlagen in Einlagenzertifikaten - Gesamt | | | 2.511.140 | 36,03 |
| Commercial Papers (30. September 2023: 30,12 %) | | | | |
| Finnland (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 26.000.000 | EUR | Nordea Bank Abp, 0.00%, 17/12/2024 | 25.813 | 0,37 |

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Finnland (Fortsetzung) | | | | |
| 62.000.000 | EUR | Nordea Bank Abp, 0.00%, 10/03/2025 | 61.133 | 0,88 |
| | | Finnland - Gesamt | 86.946 | 1,25 |
| Frankreich (30. September 2023: 20,08 %) | | | | |
| 30.000.000 | EUR | Antalis SA, 0.00%, 02/10/2024 | 29.994 | 0,43 |
| 22.000.000 | EUR | Antalis SA, 0.00%, 07/10/2024 | 21.985 | 0,32 |
| 22.000.000 | EUR | Antalis SA, 0.00%, 16/10/2024 | 21.966 | 0,31 |
| 27.000.000 | EUR | Antalis SA, 0.00%, 21/10/2024 | 26.945 | 0,39 |
| 77.000.000 | EUR | Antalis SA, 0.00%, 28/10/2024 | 76.791 | 1,10 |
| 30.000.000 | EUR | Antalis SA, 0.00%, 04/11/2024 | 29.906 | 0,43 |
| 57.000.000 | EUR | AXA Banque, 0.00%, 02/01/2025 | 56.699 | 0,81 |
| 100.000.000 | EUR | AXA Banque, 0.00%, 03/03/2025 | 99.019 | 1,42 |
| 9.500.000 | EUR | AXA Banque SACA, 3.64%, 16/01/2025 | 9.501 | 0,14 |
| 100.000.000 | EUR | Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.80%, 04/11/2024 | 100.014 | 1,43 |
| 135.000.000 | EUR | Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 06/01/2025 | 133.794 | 1,92 |
| 7.000.000 | EUR | BPCE SA, 0.00%, 01/10/2024 | 6.999 | 0,10 |
| 33.000.000 | EUR | BPCE SA, 0.00%, 24/10/2024 | 32.926 | 0,47 |
| 75.000.000 | EUR | BPCE SA, 3.82%, 08/11/2024 | 75.012 | 1,08 |
| 70.000.000 | EUR | BPCE SA, 0.00%, 02/01/2025 | 69.397 | 1,00 |
| 27.000.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, 0.00%, 24/10/2024 | 26.940 | 0,39 |
| 10.000.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, 0.00%, 25/10/2024 | 9.977 | 0,14 |
| 29.000.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, 0.00%, 02/01/2025 | 28.751 | 0,41 |
| 45.000.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, 0.00%, 28/02/2025 | 44.406 | 0,64 |
| 57.500.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, 0.00%, 04/03/2025 | 56.724 | 0,81 |
| 18.000.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, 3.71%, 22/08/2025 | 17.999 | 0,26 |
| 10.000.000 | EUR | Satellite, 0.00%, 23/01/2025 | 9.892 | 0,14 |
| 7.500.000 | EUR | Satellite SASU, 0.00%, 03/10/2024 | 7.498 | 0,11 |
| 6.000.000 | EUR | Satellite SASU, 0.00%, 04/11/2024 | 5.980 | 0,09 |
| 10.000.000 | EUR | Satellite SASU, 0.00%, 10/01/2025 | 9.955 | 0,14 |
| | | Frankreich - Gesamt | 1.009.070 | 14,48 |
| Deutschland (30. September 2023: 0,63 %) | | | | |
| 49.000.000 | EUR | Deutsche Bahn AG, 0.00%, 28/10/2024 | 48.872 | 0,70 |
| 25.000.000 | EUR | Deutsche Bahn AG, 0.00%, 28/10/2024 | 24.935 | 0,36 |
| 8.000.000 | EUR | Deutsche Bahn AG, 0.00%, 28/10/2024 | 7.979 | 0,11 |
| 60.000.000 | EUR | Deutsche Bank AG, 0.00%, 07/10/2024 | 59.961 | 0,86 |
| 19.500.000 | EUR | Deutsche Bank AG, 0.00%, 02/01/2025 | 19.334 | 0,28 |
| 34.000.000 | EUR | DZ Bank AG, 0.00%, 21/11/2024 | 33.834 | 0,49 |
| 56.000.000 | EUR | DZ Bank AG, 0.00%, 25/11/2024 | 55.706 | 0,80 |
| | | Deutschland - Gesamt | 250.621 | 3,60 |
| Irland (30. September 2023: 3,82 %) | | | | |
| 10.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 15/10/2024 | 9.986 | 0,14 |
| 67.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 22/10/2024 | 66.858 | 0,96 |
| 80.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 04/11/2024 | 79.730 | 1,14 |
| 30.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 04/11/2024 | 29.899 | 0,43 |
| 50.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 12/11/2024 | 49.793 | 0,72 |
| 35.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 20/11/2024 | 34.828 | 0,50 |
| 17.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 27/11/2024 | 16.905 | 0,24 |
| | | Irland - Gesamt | 287.999 | 4,13 |
| Japan (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 9.500.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 07/10/2024 | 9.494 | 0,14 |
| | | Japan - Gesamt | 9.494 | 0,14 |
| Luxemburg (30. September 2023: 1,39 %) | | | | |
| 6.000.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 10/10/2024 | 5.994 | 0,08 |

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Luxemburg (Fortsetzung) | | | | |
| 1.442.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 14/10/2024 | 1.440 | 0,02 |
| 4.245.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 13/11/2024 | 4.227 | 0,06 |
| 16.169.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 18/11/2024 | 16.093 | 0,23 |
| 16.000.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 25/11/2024 | 15.914 | 0,23 |
| 10.000.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 11/12/2024 | 9.932 | 0,14 |
| 13.000.000 | EUR | Clearstream Banking SA, 0.00%, 02/10/2024 | 12.997 | 0,19 |
| 13.000.000 | EUR | Clearstream Banking SA, 0.00%, 23/10/2024 | 12.974 | 0,19 |
| 7.500.000 | EUR | Clearstream Banking SA, 0.00%, 23/10/2024 | 7.484 | 0,11 |
| 4.500.000 | EUR | Nestle Finance International Ltd., 0.00%, 02/01/2025 | 4.461 | 0,06 |
| 10.000.000 | EUR | Sunderland Receivables SA, 0.00%, 22/11/2024 | 9.949 | 0,14 |
| | | Luxemburg - Gesamt | 101.465 | 1,45 |
| | | Niederlande (30. September 2023: 0,00 %) | | |
| 61.000.000 | EUR | ING Bank NV, 3.67%, 27/05/2025 | 61.003 | 0,87 |
| | | Niederlande - Gesamt | 61.003 | 0,87 |
| | | Schweden (30. September 2023: 0,38 %) | | |
| 51.000.000 | EUR | Svenska Handelsbanken AB, 0.00%, 01/11/2024 | 50.842 | 0,73 |
| 41.000.000 | EUR | Svenska Handelsbanken AB, 0.00%, 30/01/2025 | 40.554 | 0,58 |
| 9.000.000 | EUR | Svenska Handelsbanken AB, 0.00%, 11/04/2025 | 8.855 | 0,13 |
| | | Schweden - Gesamt | 100.251 | 1,44 |
| | | Schweiz (30. September 2023: 0,12 %) | | |
| 5.000.000 | EUR | UBS AG, 0.00%, 13/01/2025 | 4.953 | 0,07 |
| | | Schweiz - Gesamt | 4.953 | 0,07 |
| | | Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 3,54 %) | | |
| 20.000.000 | EUR | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 14/11/2024 | 19.915 | 0,29 |
| 50.000.000 | EUR | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 04/12/2024 | 49.667 | 0,71 |
| 111.000.000 | EUR | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 05/12/2024 | 110.252 | 1,58 |
| 59.000.000 | EUR | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 09/12/2024 | 58.581 | 0,84 |
| 45.000.000 | EUR | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 13/12/2024 | 44.664 | 0,64 |
| 37.000.000 | EUR | Santander UK plc, 0.00%, 02/01/2025 | 36.682 | 0,53 |
| 2.000.000 | EUR | Standard Chartered Bank, 0.00%, 17/02/2025 | 1.975 | 0,03 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 321.736 | 4,62 |
| | | Vereinigte Staaten (30. September 2023: 0,16 %) | | |
| 10.000.000 | EUR | Mont Blanc Capital Corp., 0.00%, 16/12/2024 | 9.929 | 0,14 |
| | | Vereinigte Staaten - Gesamt | 9.929 | 0,14 |
| | | Anlagen in Commercial Papers - Gesamt | 2.243.467 | 32,19 |
| | | Termineinlagen (30. September 2023: 27,13 %) | | |
| | | Belgien (30. September 2023: 2,28 %) | - | - |
| | | Kanada (30. September 2023: 1,57 %) | - | - |
| | | Frankreich (30. September 2023: 7,53 %) | | |
| 45.137.108 | EUR | BRED Banque Populaire, 3.38%, 01/10/2024 | 45.137 | 0,65 |
| 200.226.774 | EUR | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 3.40%, 01/10/2024 | 200.227 | 2,87 |
| | | Frankreich - Gesamt | 245.364 | 3,52 |

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Termineinlagen (Fortsetzung) | | | | |
| Deutschland (30. September 2023: 8,66 %) | | | | |
| 468.620.943 | EUR | DZ Bank AG, 3.40%, 01/10/2024 | 468.621 | 6,72 |
| | | Deutschland - Gesamt | 468.621 | 6,72 |
| Japan (30. September 2023: 7,09 %) | | | | |
| 220.763.613 | EUR | MUFG Bank Ltd., 3.40%, 01/10/2024 | 220.763 | 3,17 |
| 258.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 3.45%, 01/10/2024 | 258.000 | 3,70 |
| | | Japan - Gesamt | 478.763 | 6,87 |
| | | Anlagen in Termineinlagen - Gesamt | 1.192.748 | 17,11 |

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---------|---------|---------------|----------------------|-------------------------------|
|---------|---------|---------------|----------------------|-------------------------------|

ANLEIHEN

Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2023: 5,13 %)

| | | | | |
|---|-----|---|---------------|-------------|
| | | Kanada (30. September 2023: 4,66 %) | - | - |
| Luxemburg (30. September 2023: 0,47 %) | | | | |
| 42.000.000 | EUR | Purple Protected Asset, FRN, 3.49%, 18/09/2025 | 42.028 | 0,60 |
| 30.000.000 | EUR | SG Issuer SA, 3.50%, 04/10/2024 ¹ | 30.000 | 0,43 |
| | | Luxemburg - Gesamt | 72.028 | 1,03 |
| | | Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt | 72.028 | 1,03 |
| | | Anlagen in Anleihen - Gesamt | 72.028 | 1,03 |

| Bestand | Währung | Kontrahent | Zins- sätze | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|----------------|------------------------|----------------------|-------------------------------|
| Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2023: 11,01 %) | | | | | | |
| Frankreich (30. September 2023: 4,72 %) | | | | | | |
| 300.000.000 | EUR | BNP Paribas SA | 3,42 % | 01.10.2024 | 300.000 | 4,31 |
| | | Frankreich - Gesamt | | | 300.000 | 4,31 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 6,29 %) | | | | | | |
| 50.000.000 | EUR | Goldman Sachs International | 3,43 % | 01.10.2024 | 50.000 | 0,72 |
| 50.000.000 | EUR | Goldman Sachs International | 3,45 % | 02.10.2024 | 50.000 | 0,72 |
| 500.000.000 | EUR | NatWest Markets plc | 3,45 % | 01.10.2024 | 500.000 | 7,17 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | 600.000 | 8,61 |
| | | Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt | | | 900.000 | 12,92 |

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---|----------------------|--|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt | 6.919.383 | 99,28 |
| Zahlungsmittel | 250.011 | 3,59 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | (199.928) | (2,87) |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert | 6.969.466 | 100,00 |
| | | % des Gesamt- vermögens |
| Analyse des Gesamtvermögens | | |
| Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | 0,58 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | | 12,84 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c) | | 82,14 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 4,44 |
| Gesamtvermögen | | 100,00 |

¹ Nullkupon-Anleihe.

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (30. September 2023: 25,30 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 89.000.000 | EUR | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 05/06/2025 | 86.851 | 0,13 |
| 55.000.000 | EUR | National Australia Bank Ltd., 3.63%, 19/11/2024 | 55.000 | 0,08 |
| 442.500.000 | EUR | National Australia Bank Ltd., 3.84%, 02/01/2025 | 442.500 | 0,67 |
| 353.000.000 | EUR | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 02/01/2025 | 349.664 | 0,53 |
| 443.500.000 | EUR | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 03/02/2025 | 438.068 | 0,66 |
| 443.000.000 | EUR | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 05/03/2025 | 436.286 | 0,66 |
| 525.000.000 | EUR | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 15/05/2025 | 513.399 | 0,78 |
| 478.500.000 | EUR | National Australia Bank Ltd., 3.67%, 05/09/2025 | 478.500 | 0,73 |
| Australien - Gesamt | | | 2.800.268 | 4,24 |
| Belgien (30. September 2023: 2,13 %) | | | | |
| 400.000.000 | EUR | KBC Bank NV, 3.76%, 10/10/2024 | 400.000 | 0,61 |
| 452.500.000 | EUR | KBC Bank NV, 0.00%, 03/01/2025 | 448.503 | 0,68 |
| Belgien - Gesamt | | | 848.503 | 1,29 |
| Kanada (30. September 2023: 4,01 %) | | | | |
| 197.000.000 | EUR | Bank of Montreal, 3.84%, 04/10/2024 | 197.000 | 0,30 |
| 113.000.000 | EUR | Bank of Montreal, 3.85%, 11/10/2024 | 113.000 | 0,17 |
| 448.500.000 | EUR | Bank of Montreal, 0.00%, 25/10/2024 | 447.427 | 0,68 |
| 100.000.000 | EUR | Bank of Montreal, 3.66%, 16/09/2025 | 100.000 | 0,15 |
| 582.000.000 | EUR | Royal Bank of Canada, 0.00%, 05/06/2025 | 567.982 | 0,86 |
| 617.000.000 | EUR | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 26/02/2025 | 608.120 | 0,92 |
| 188.000.000 | EUR | Toronto-Dominion Bank (The), 3.71%, 23/05/2025 | 188.000 | 0,29 |
| 300.000.000 | EUR | Toronto-Dominion Bank (The), 3.74%, 08/08/2025 | 300.000 | 0,45 |
| 872.000.000 | EUR | Toronto-Dominion Bank (The), 3.73%, 18/08/2025 | 872.000 | 1,32 |
| 742.000.000 | EUR | Toronto-Dominion Bank (The), 3.74%, 19/09/2025 | 742.000 | 1,12 |
| Kanada - Gesamt | | | 4.135.529 | 6,26 |
| Finnland (30. September 2023: 0,55 %) | | | | |
| 300.000.000 | EUR | Nordea Bank Abp, 3.64%, 12/06/2025 | 300.000 | 0,46 |
| Finnland - Gesamt | | | 300.000 | 0,46 |
| Frankreich (30. September 2023: 4,47 %) | | | | |
| 819.500.000 | EUR | Credit Agricole SA, 0.00%, 02/01/2025 | 811.589 | 1,23 |
| 398.500.000 | EUR | Credit Agricole SA, 0.00%, 03/01/2025 | 394.791 | 0,60 |
| 499.000.000 | EUR | Credit Agricole SA, 3.73%, 06/01/2025 | 499.000 | 0,76 |
| 393.000.000 | EUR | Credit Agricole SA, 0.00%, 07/02/2025 | 388.205 | 0,59 |
| 537.000.000 | EUR | Credit Agricole SA, 3.66%, 03/03/2025 | 537.000 | 0,81 |
| Frankreich - Gesamt | | | 2.630.585 | 3,99 |
| Japan (30. September 2023: 9,73 %) | | | | |
| 117.500.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 01/10/2024 | 117.500 | 0,18 |
| 25.000.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 03/10/2024 | 24.995 | 0,04 |
| 100.000.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 07/10/2024 | 99.938 | 0,15 |
| 83.000.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 09/10/2024 | 82.932 | 0,13 |
| 90.000.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 10/10/2024 | 89.922 | 0,14 |
| 150.000.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 15/10/2024 | 149.785 | 0,23 |
| 88.000.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 03/12/2024 | 87.457 | 0,13 |
| 58.000.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 05/12/2024 | 57.631 | 0,09 |
| 207.500.000 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 03/02/2025 | 205.093 | 0,31 |
| 250.000.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 04/10/2024 | 249.925 | 0,38 |
| 400.000.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 07/10/2024 | 399.764 | 0,61 |
| 135.000.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 16/10/2024 | 134.804 | 0,20 |
| 278.500.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 23/10/2024 | 277.913 | 0,42 |
| 355.000.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 18/11/2024 | 353.365 | 0,53 |
| 138.000.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 25/11/2024 | 137.212 | 0,21 |

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| Japan (Fortsetzung) | | | | |
| 180.000.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 04/12/2024 | 178.898 | 0,27 |
| 281.000.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 02/01/2025 | 278.517 | 0,42 |
| 173.500.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 03/01/2025 | 171.950 | 0,26 |
| 181.500.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 179.839 | 0,27 |
| 300.000.000 | EUR | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 27/01/2025 | 296.748 | 0,45 |
| 360.000.000 | EUR | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 13/11/2024 | 358.396 | 0,54 |
| 225.000.000 | EUR | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 18/11/2024 | 223.925 | 0,34 |
| 200.000.000 | EUR | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 04/12/2024 | 198.752 | 0,30 |
| 100.000.000 | EUR | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 09/12/2024 | 99.327 | 0,15 |
| 272.000.000 | EUR | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 03/02/2025 | 268.805 | 0,41 |
| 725.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 14/10/2024 | 724.034 | 1,10 |
| 348.500.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 02/01/2025 | 345.420 | 0,52 |
| 170.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 03/01/2025 | 168.480 | 0,25 |
| 424.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 07/01/2025 | 420.074 | 0,64 |
| 360.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 08/01/2025 | 356.668 | 0,54 |
| 234.500.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 09/01/2025 | 232.285 | 0,35 |
| 357.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 13/01/2025 | 353.514 | 0,54 |
| 135.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 07/10/2024 | 134.917 | 0,20 |
| 150.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 08/10/2024 | 149.893 | 0,23 |
| 100.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 15/10/2024 | 99.858 | 0,15 |
| 81.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 16/10/2024 | 80.877 | 0,12 |
| 20.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 24/10/2024 | 19.953 | 0,03 |
| 50.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 14/11/2024 | 49.782 | 0,08 |
| 131.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 15/11/2024 | 130.416 | 0,20 |
| 45.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 22/11/2024 | 44.768 | 0,07 |
| 109.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 12/12/2024 | 108.241 | 0,16 |
| 50.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 49.543 | 0,07 |
| 108.500.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 10/01/2025 | 107.478 | 0,16 |
| 90.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 10/01/2025 | 89.148 | 0,13 |
| 91.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 14/01/2025 | 90.100 | 0,14 |
| 227.500.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 17/01/2025 | 225.186 | 0,34 |
| 175.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 21/01/2025 | 173.170 | 0,26 |
| 138.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 21/01/2025 | 136.549 | 0,21 |
| | | Japan - Gesamt | 9.013.747 | 13,65 |
| Niederlande (30. September 2023: 0,37 %) | | | | |
| 521.000.000 | EUR | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 06/12/2024 | 517.668 | 0,78 |
| 473.500.000 | EUR | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 02/01/2025 | 469.055 | 0,71 |
| 454.000.000 | EUR | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 02/01/2025 | 449.782 | 0,68 |
| 249.000.000 | EUR | Cooperatieve Rabobank UA, 3.70%, 29/07/2025 | 249.000 | 0,38 |
| | | Niederlande - Gesamt | 1.685.505 | 2,55 |
| Norwegen (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 771.000.000 | EUR | DNB Bank ASA, 3.90%, 04/11/2024 | 771.000 | 1,17 |
| | | Norwegen - Gesamt | 771.000 | 1,17 |
| Südkorea (30. September 2023: 0,31 %) | | | | |
| 20.000.000 | EUR | KEB Hana Bank, 0.00%, 11/10/2024 | 19.978 | 0,03 |
| 9.500.000 | EUR | KEB Hana Bank, 0.00%, 25/11/2024 | 9.445 | 0,01 |
| 26.500.000 | EUR | KEB Hana Bank, 0.00%, 02/12/2024 | 26.328 | 0,04 |
| 15.000.000 | EUR | KEB Hana Bank, 0.00%, 10/01/2025 | 14.847 | 0,02 |
| 25.000.000 | EUR | KEB Hana Bank, 0.00%, 29/01/2025 | 24.697 | 0,04 |
| 26.500.000 | EUR | KEB Hana Bank, 0.00%, 12/02/2025 | 26.151 | 0,04 |
| 30.000.000 | EUR | KEB Hana Bank, 0.00%, 24/02/2025 | 29.582 | 0,05 |
| 30.000.000 | EUR | KEB Hana Bank, 0.00%, 27/03/2025 | 29.524 | 0,05 |
| 35.500.000 | EUR | Kookmin Bank, 0.00%, 24/10/2024 | 35.414 | 0,05 |
| 35.500.000 | EUR | Kookmin Bank, 0.00%, 25/11/2024 | 35.297 | 0,05 |
| 20.000.000 | EUR | Kookmin Bank, 0.00%, 09/01/2025 | 19.798 | 0,03 |

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Einlagezertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| 68.000.000 | EUR | Südkorea (Fortsetzung) Kookmin Bank, 3.69%, 17/06/2025 | 68.000 | 0,10 |
| | | Südkorea - Gesamt | 339.061 | 0,51 |
| 75.000.000 | EUR | Schweden (30. September 2023: 0,00 %) Kingdom of Sweden, 0.00%, 14/10/2024 ¹ | 74.906 | 0,11 |
| | | Schweden - Gesamt | 74.906 | 0,11 |
| 319.000.000 | EUR | Schweiz (30. September 2023: 1,12 %) UBS AG, 3.74%, 11/07/2025 | 319.000 | 0,48 |
| | | Schweiz - Gesamt | 319.000 | 0,48 |
| 58.500.000 | EUR | Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 2,23 %) Mizuho International plc, 0.00%, 07/10/2024 | 58.465 | 0,09 |
| 70.000.000 | EUR | Mizuho International plc, 0.00%, 10/10/2024 | 69.935 | 0,11 |
| 25.000.000 | EUR | Mizuho International plc, 0.00%, 08/11/2024 | 24.904 | 0,04 |
| 36.000.000 | EUR | Mizuho International plc, 0.00%, 05/12/2024 | 35.761 | 0,05 |
| 498.000.000 | EUR | Standard Chartered Bank, 3.68%, 25/07/2025 | 498.000 | 0,75 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 687.065 | 1,04 |
| 132.500.000 | EUR | Vereinigte Staaten (30. September 2023: 0,38 %) Citibank NA, 0.00%, 23/10/2024 | 132.196 | 0,20 |
| | | Vereinigte Staaten - Gesamt | 132.196 | 0,20 |
| Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt | | | 23.737.365 | 35,95 |
| Commercial Papers (30. September 2023: 37,43 %) | | | | |
| 22.000.000 | EUR | Australien (30. September 2023: 0,00 %) Toyota Finance Australia Ltd., 0.00%, 09/01/2025 | 21.792 | 0,03 |
| | | Australien - Gesamt | 21.792 | 0,03 |
| 50.000.000 | EUR | Österreich (30. September 2023: 0,00 %) Oesterreichische Kontrollbank AG, 0.00%, 13/01/2025 | 49.512 | 0,08 |
| 465.000.000 | EUR | Republic of Austria, 0.00%, 21/10/2024 | 464.119 | 0,70 |
| 495.000.000 | EUR | Republic of Austria, 0.00%, 24/10/2024 | 493.899 | 0,75 |
| 100.000.000 | EUR | Republic of Austria, 0.00%, 04/11/2024 | 99.674 | 0,15 |
| | | Österreich - Gesamt | 1.107.204 | 1,68 |
| 100.000.000 | EUR | Kanada (30. September 2023: 0,00 %) PSP Capital, Inc., 0.00%, 01/10/2024 | 100.000 | 0,15 |
| 100.000.000 | EUR | PSP Capital, Inc., 0.00%, 21/11/2024 | 99.484 | 0,15 |
| 100.000.000 | EUR | PSP Capital, Inc., 0.00%, 08/01/2025 | 99.011 | 0,15 |
| 48.000.000 | EUR | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 03/10/2024 | 47.990 | 0,08 |
| | | Kanada - Gesamt | 346.485 | 0,53 |
| | | Dänemark (30. September 2023: 0,96 %) | - | - |
| 249.000.000 | EUR | Finnland (30. September 2023: 0,00 %) Kuntarahoitus OYJ, 0.00%, 02/12/2024 | 247.517 | 0,37 |
| 223.000.000 | EUR | Nordea Bank Abp, 0.00%, 17/12/2024 | 221.280 | 0,34 |
| 534.500.000 | EUR | Nordea Bank Abp, 0.00%, 10/03/2025 | 526.139 | 0,80 |
| | | Finnland - Gesamt | 994.936 | 1,51 |

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Frankreich (30. September 2023: 16,67 %) | | | | |
| 500.000.000 | EUR | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 20/11/2024 | 497.604 | 0,75 |
| 996.000.000 | EUR | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 17/01/2025 | 986.015 | 1,49 |
| 156.000.000 | EUR | Antalis SA, 0.00%, 02/10/2024 | 155.984 | 0,24 |
| 281.000.000 | EUR | Antalis SA, 0.00%, 07/10/2024 | 280.839 | 0,43 |
| 23.000.000 | EUR | Antalis SA, 0.00%, 16/10/2024 | 22.966 | 0,03 |
| 265.000.000 | EUR | Antalis SA, 0.00%, 21/10/2024 | 264.485 | 0,40 |
| 35.000.000 | EUR | Antalis SA, 0.00%, 21/10/2024 | 34.932 | 0,05 |
| 262.000.000 | EUR | Antalis SA, 0.00%, 28/10/2024 | 261.313 | 0,40 |
| 156.000.000 | EUR | Antalis SA, 0.00%, 04/11/2024 | 155.511 | 0,24 |
| 190.000.000 | EUR | AXA Banque SACA, 3.64%, 16/01/2025 | 190.000 | 0,29 |
| 897.000.000 | EUR | Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.80%, 04/11/2024 | 897.000 | 1,36 |
| 863.000.000 | EUR | Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 06/01/2025 | 854.362 | 1,29 |
| 491.000.000 | EUR | BPCE SA, 0.00%, 01/10/2024 | 491.000 | 0,74 |
| 266.000.000 | EUR | BPCE SA, 0.00%, 24/10/2024 | 265.364 | 0,40 |
| 674.000.000 | EUR | BPCE SA, 3.82%, 08/11/2024 | 674.000 | 1,02 |
| 452.000.000 | EUR | BPCE SA, 0.00%, 02/01/2025 | 447.666 | 0,68 |
| 60.000.000 | EUR | Eurotitrisation - SAT Magenta, 0.00%, 21/10/2024 | 59.880 | 0,09 |
| 222.000.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, 0.00%, 24/10/2024 | 221.474 | 0,34 |
| 190.000.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, 0.00%, 25/10/2024 | 189.530 | 0,29 |
| 250.000.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, 0.00%, 02/01/2025 | 247.594 | 0,37 |
| 55.000.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, 0.00%, 03/01/2025 | 54.469 | 0,08 |
| 25.000.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, 0.00%, 18/02/2025 | 24.680 | 0,04 |
| 258.000.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, 0.00%, 28/02/2025 | 254.060 | 0,38 |
| 496.000.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, 0.00%, 04/03/2025 | 488.203 | 0,74 |
| 280.500.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, 3.71%, 22/08/2025 | 280.500 | 0,42 |
| 32.000.000 | EUR | Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST SA, 0.00%, 01/10/2024 | 32.000 | 0,05 |
| 32.000.000 | EUR | Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST SA, 0.00%, 02/10/2024 | 31.998 | 0,05 |
| 34.000.000 | EUR | Satellite, 0.00%, 26/11/2024 | 33.811 | 0,05 |
| 40.000.000 | EUR | Satellite, 0.00%, 23/01/2025 | 39.569 | 0,06 |
| 72.500.000 | EUR | Satellite SASU, 0.00%, 03/10/2024 | 72.486 | 0,11 |
| 40.000.000 | EUR | Satellite SASU, 0.00%, 17/10/2024 | 39.935 | 0,06 |
| 21.500.000 | EUR | Satellite SASU, 0.00%, 25/10/2024 | 21.450 | 0,03 |
| 34.000.000 | EUR | Satellite SASU, 0.00%, 04/11/2024 | 33.877 | 0,05 |
| 10.000.000 | EUR | Satellite SASU, 0.00%, 10/01/2025 | 9.903 | 0,02 |
| 12.500.000 | EUR | Satellite SASU, 0.00%, 16/01/2025 | 12.373 | 0,02 |
| | | Frankreich - Gesamt | 8.626.833 | 13,06 |
| Deutschland (30. September 2023: 4,57 %) | | | | |
| 75.000.000 | EUR | Deutsche Bahn AG, 0.00%, 28/10/2024 | 74.806 | 0,11 |
| 71.500.000 | EUR | Deutsche Bahn AG, 0.00%, 28/10/2024 | 71.303 | 0,11 |
| 455.000.000 | EUR | Deutsche Bank AG, 0.00%, 07/10/2024 | 454.712 | 0,69 |
| 230.000.000 | EUR | Deutsche Bank AG, 0.00%, 02/01/2025 | 227.852 | 0,34 |
| 260.000.000 | EUR | DZ Bank AG, 0.00%, 21/11/2024 | 258.627 | 0,39 |
| 434.500.000 | EUR | DZ Bank AG, 0.00%, 25/11/2024 | 432.026 | 0,65 |
| 500.000.000 | EUR | Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 0.00%, 03/10/2024 | 499.903 | 0,76 |
| 995.000.000 | EUR | Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 0.00%, 14/10/2024 | 993.747 | 1,50 |
| 250.000.000 | EUR | Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.00%, 09/10/2024 | 249.805 | 0,38 |
| 250.000.000 | EUR | Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.00%, 16/10/2024 | 249.642 | 0,38 |
| 250.000.000 | EUR | Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.00%, 23/10/2024 | 249.478 | 0,38 |
| 250.000.000 | EUR | Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.00%, 30/10/2024 | 249.317 | 0,38 |
| 60.000.000 | EUR | Toyota Kreditbank GmbH, 0.00%, 13/01/2025 | 59.414 | 0,09 |
| | | Deutschland - Gesamt | 4.070.632 | 6,16 |
| Irland (30. September 2023: 3,93 %) | | | | |
| 134.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 15/10/2024 | 133.809 | 0,20 |
| 200.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 21/10/2024 | 199.596 | 0,30 |
| 60.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 22/10/2024 | 59.870 | 0,09 |
| 32.500.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 22/10/2024 | 32.429 | 0,05 |
| 438.500.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 04/11/2024 | 436.982 | 0,66 |

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Irland (Fortsetzung) | | | | |
| 217.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 04/11/2024 | 216.213 | 0,33 |
| 25.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 04/11/2024 | 24.909 | 0,04 |
| 308.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 05/11/2024 | 306.903 | 0,46 |
| 200.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 05/11/2024 | 199.287 | 0,30 |
| 50.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 08/11/2024 | 49.798 | 0,08 |
| 193.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 12/11/2024 | 192.190 | 0,29 |
| 170.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 12/11/2024 | 169.287 | 0,26 |
| 225.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 20/11/2024 | 223.808 | 0,34 |
| 65.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 20/11/2024 | 64.656 | 0,10 |
| 80.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 27/11/2024 | 79.518 | 0,12 |
| 63.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 27/11/2024 | 62.621 | 0,09 |
| 40.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 09/12/2024 | 39.731 | 0,06 |
| 10.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 17/12/2024 | 9.925 | 0,02 |
| | | Irland - Gesamt | 2.501.532 | 3,79 |
| Japan (30. September 2023: 1,40 %) | | | | |
| 80.500.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 07/10/2024 | 80.449 | 0,12 |
| | | Japan - Gesamt | 80.449 | 0,12 |
| Luxemburg (30. September 2023: 1,68 %) | | | | |
| 52.968.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 10/10/2024 | 52.919 | 0,08 |
| 13.000.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 14/10/2024 | 12.983 | 0,02 |
| 99.164.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 15/10/2024 | 99.022 | 0,15 |
| 26.661.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 22/10/2024 | 26.604 | 0,04 |
| 10.051.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 23/10/2024 | 10.029 | 0,01 |
| 40.000.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 13/11/2024 | 39.832 | 0,06 |
| 171.868.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 18/11/2024 | 171.057 | 0,26 |
| 10.825.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 22/11/2024 | 10.770 | 0,02 |
| 14.308.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 25/11/2024 | 14.231 | 0,02 |
| 80.021.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 11/12/2024 | 79.464 | 0,12 |
| 65.000.000 | EUR | Clearstream Banking SA, 0.00%, 02/10/2024 | 64.993 | 0,10 |
| 67.500.000 | EUR | Clearstream Banking SA, 0.00%, 23/10/2024 | 67.358 | 0,10 |
| 65.000.000 | EUR | Clearstream Banking SA, 0.00%, 23/10/2024 | 64.870 | 0,10 |
| 45.000.000 | EUR | Nestle Finance International Ltd., 0.00%, 02/01/2025 | 44.604 | 0,07 |
| 48.500.000 | EUR | Sunderland Receivables SA, 0.00%, 30/10/2024 | 48.359 | 0,07 |
| 9.000.000 | EUR | Sunderland Receivables SA, 0.00%, 31/10/2024 | 8.973 | 0,01 |
| 50.000.000 | EUR | Sunderland Receivables SA, 0.00%, 12/11/2024 | 49.790 | 0,08 |
| 40.000.000 | EUR | Sunderland Receivables SA, 0.00%, 21/11/2024 | 39.798 | 0,06 |
| 40.000.000 | EUR | Sunderland Receivables SA, 0.00%, 22/11/2024 | 39.794 | 0,06 |
| 25.000.000 | EUR | Sunderland Receivables SA, 0.00%, 03/12/2024 | 24.845 | 0,04 |
| | | Luxemburg - Gesamt | 970.295 | 1,47 |
| Niederlande (30. September 2023: 3,78 %) | | | | |
| 500.000.000 | EUR | BNG Bank NV, 0.00%, 09/12/2024 | 496.707 | 0,75 |
| 537.000.000 | EUR | ING Bank NV, 3.67%, 27/05/2025 | 537.000 | 0,81 |
| 500.000.000 | EUR | Kingdom of the Netherlands, 0.00%, 01/10/2024 | 500.000 | 0,76 |
| 1.000.000.000 | EUR | Kingdom of the Netherlands, 0.00%, 08/10/2024 | 999.332 | 1,52 |
| 1.225.000.000 | EUR | Kingdom of the Netherlands, 0.00%, 23/10/2024 | 1.222.439 | 1,85 |
| 498.000.000 | EUR | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 15/11/2024 | 495.845 | 0,75 |
| 498.000.000 | EUR | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 29/11/2024 | 495.177 | 0,75 |
| | | Niederlande - Gesamt | 4.746.500 | 7,19 |
| Supranational (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 100.000.000 | EUR | European Stability Mechanism, 0.00%, 01/10/2024 | 100.000 | 0,15 |
| | | Supranational - Gesamt | 100.000 | 0,15 |

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Schweden (30. September 2023: 0,37 %) | | | | |
| 427.500.000 | EUR | Svenska Handelsbanken AB, 0.00%, 01/11/2024 | 426.141 | 0,64 |
| 355.500.000 | EUR | Svenska Handelsbanken AB, 0.00%, 30/01/2025 | 351.276 | 0,53 |
| 91.000.000 | EUR | Svenska Handelsbanken AB, 0.00%, 11/04/2025 | 89.436 | 0,14 |
| | | Schweden - Gesamt | 866.853 | 1,31 |
| Schweiz (30. September 2023: 0,11 %) | | | | |
| 42.500.000 | EUR | UBS AG, 0.00%, 13/01/2025 | 42.052 | 0,06 |
| | | Schweiz - Gesamt | 42.052 | 0,06 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 3,87 %) | | | | |
| 39.000.000 | EUR | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 14/11/2024 | 38.834 | 0,06 |
| 172.000.000 | EUR | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 04/12/2024 | 170.915 | 0,26 |
| 99.500.000 | EUR | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 04/12/2024 | 98.879 | 0,15 |
| 79.000.000 | EUR | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 05/12/2024 | 78.506 | 0,12 |
| 125.000.000 | EUR | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 13/12/2024 | 124.122 | 0,19 |
| 361.500.000 | EUR | Santander UK plc, 0.00%, 02/01/2025 | 358.276 | 0,54 |
| 99.000.000 | EUR | Standard Chartered Bank, 0.00%, 17/01/2025 | 97.902 | 0,15 |
| 43.000.000 | EUR | Standard Chartered Bank, 0.00%, 17/02/2025 | 42.393 | 0,06 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 1.009.827 | 1,53 |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 0,09 %) | | | | |
| 16.050.000 | EUR | Mont Blanc Capital Corp., 0.00%, 16/12/2024 | 15.933 | 0,03 |
| 20.000.000 | EUR | Mont Blanc Capital Corp., 0.00%, 16/01/2025 | 19.796 | 0,03 |
| 29.000.000 | EUR | Sheffield Receivables Co. LLC, 0.00%, 13/11/2024 | 28.876 | 0,04 |
| | | Vereinigte Staaten - Gesamt | 64.605 | 0,10 |
| Anlagen in Commercial Papers - Gesamt | | | 25.549.995 | 38,69 |
| Termineinlagen (30. September 2023: 14,24 %) | | | | |
| Österreich (30. September 2023: 8,75 %) | | | | |
| 2.496.945.774 | EUR | Erste Group Bank AG, 3.41%, 01/10/2024 | 2.496.946 | 3,78 |
| | | Österreich - Gesamt | 2.496.946 | 3,78 |
| Belgien (30. September 2023: 0,49 %) | | | | |
| | | | - | - |
| Frankreich (30. September 2023: 0,98 %) | | | | |
| 350.132.232 | EUR | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 3.40%, 01/10/2024 | 350.132 | 0,53 |
| | | Frankreich - Gesamt | 350.132 | 0,53 |
| Deutschland (30. September 2023: 2,17 %) | | | | |
| 1.390.393.833 | EUR | DZ Bank AG, 3.40%, 01/10/2024 | 1.390.394 | 2,11 |
| | | Deutschland - Gesamt | 1.390.394 | 2,11 |
| Japan (30. September 2023: 1,85 %) | | | | |
| 53.353.496 | EUR | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.42%, 01/10/2024 | 53.353 | 0,08 |
| 100.347.097 | EUR | MUFG Bank Ltd., 3.40%, 01/10/2024 | 100.347 | 0,15 |
| 68.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 3.45%, 01/10/2024 | 68.000 | 0,11 |
| | | Japan - Gesamt | 221.700 | 0,34 |
| Anlagen in Termineinlagen - Gesamt | | | 4.459.172 | 6,76 |

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts | |
|---|---------|---|----------------|------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| ANLEIHEN | | | | | | |
| Staatsanleihen (30. September 2023: 4,02 %) | | | | | | |
| | | Österreich (30. September 2023: 0,19 %) | | - | - | |
| | | Frankreich (30. September 2023: 3,83 %) | | | | |
| 10.000.000 | EUR | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 16/10/2024 ¹ | | 9.985 | 0,01 | |
| 508.500.000 | EUR | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 14/11/2024 ¹ | | 506.257 | 0,77 | |
| | | Frankreich - Gesamt | | 516.242 | 0,78 | |
| | | Niederlande (30. September 2023: 0,00 %)² | | | | |
| 100.000 | EUR | Dutch Treasury Certificate, 0.00%, 30/10/2024 ¹ | | 100 | - | |
| 100.000 | EUR | Dutch Treasury Certificate, 0.00%, 28/11/2024 ¹ | | 99 | - | |
| | | Niederlande - Gesamt | | 199 | - | |
| Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt | | | | 516.441 | 0,78 | |
| Schuldtitle von Unternehmen (30. September 2023: 5,43 %) | | | | | | |
| | | Kanada (30. September 2023: 4,50 %) | | - | - | |
| | | Luxemburg (30. September 2023: 0,93 %) | | | | |
| 413.000.000 | EUR | Purple Protected Asset, FRN, 3.49%, 18/09/2025 | | 413.000 | 0,63 | |
| 430.000.000 | EUR | SG Issuer SA, 3.50%, 04/10/2024 ³ | | 430.000 | 0,65 | |
| | | Luxemburg - Gesamt | | 843.000 | 1,28 | |
| Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt | | | | 843.000 | 1,28 | |
| Supranationale Wertpapiere (30. September 2023: 1,76 %) | | | | | | |
| Anlagen in supranationalen Wertpapieren - Gesamt | | | | - | - | |
| Anlagen in Anleihen - Gesamt | | | | 1.359.441 | 2,06 | |
| Bestand | Währung | Kontrahent | Zins- sätze | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
| Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2023: 11,10 %) | | | | | | |
| Australien (30. September 2023: 0,00 %) | | | | | | |
| 300.000.000 | EUR | National Australia Bank Ltd. | 3,39 % | 01.10.2024 | 300.000 | 0,46 |
| Australien - Gesamt | | | | | 300.000 | 0,46 |
| Kanada (30. September 2023: 1,63 %) | | | | | | |
| Frankreich (30. September 2023: 3,08 %) | | | | | | |
| 400.000.000 | EUR | BNP Paribas SA | 3,42 % | 01.10.2024 | 400.000 | 0,61 |
| 100.000.000 | EUR | BNP Paribas SA | 3,42 % | 01.10.2024 | 100.000 | 0,15 |

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Kontrahent | Zinssätze | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|-----------|------------------------|----------------------|-------------------------------|
| Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung) | | | | | | |
| Frankreich (Fortsetzung) | | | | | | |
| | | Credit Agricole Corporate and Investment Bank | 3,45 % | 01.10.2024 | 200.000 | 0,30 |
| 200.000.000 | EUR | | | | | |
| 1.250.000.000 | EUR | Natixis SA | 3,46 % | 01.10.2024 | 1.250.000 | 1,89 |
| 600.000.000 | EUR | Societe Generale | 3,42 % | 01.10.2024 | 600.000 | 0,91 |
| Frankreich - Gesamt | | | | | 2.550.000 | 3,86 |
| Japan (30. September 2023: 0,65 %) | | | | | | |
| 250.000.000 | EUR | MUFG Securities EMEA plc | 3,40 % | 01.10.2024 | 250.000 | 0,38 |
| Japan - Gesamt | | | | | 250.000 | 0,38 |
| Niederlande (30. September 2023: 1,95 %) | | | | | | |
| 1.500.000.000 | EUR | ING Bank NV | 3,41 % | 01.10.2024 | 1.500.000 | 2,27 |
| Niederlande - Gesamt | | | | | 1.500.000 | 2,27 |
| Spanien (30. September 2023: 0,54 %) | | | | | | |
| | | | | | - | - |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 1,30 %) | | | | | | |
| 1.400.000.000 | EUR | Bank of Nova Scotia plc | 3,45 % | 01.10.2024 | 1.400.000 | 2,12 |
| 200.000.000 | EUR | Canadian Imperial Bank of Commerce | 3,40 % | 01.10.2024 | 200.000 | 0,30 |
| 200.000.000 | EUR | Canadian Imperial Bank of Commerce | 3,40 % | 02.10.2024 | 200.000 | 0,30 |
| 200.000.000 | EUR | Goldman Sachs International | 3,43 % | 01.10.2024 | 200.000 | 0,30 |
| 200.000.000 | EUR | Goldman Sachs International | 3,45 % | 02.10.2024 | 200.000 | 0,30 |
| 1.000.000.000 | EUR | J.P. Morgan Securities plc | 3,45 % | 01.10.2024 | 1.000.000 | 1,52 |
| 550.000.000 | EUR | J.P. Morgan Securities plc | 3,42 % | 01.10.2024 | 550.000 | 0,83 |
| 550.000.000 | EUR | J.P. Morgan Securities plc | 3,43 % | 02.10.2024 | 550.000 | 0,83 |
| 1.300.000.000 | EUR | NatWest Markets plc | 3,45 % | 01.10.2024 | 1.300.000 | 1,97 |
| 150.000.000 | EUR | Santander UK plc | 3,42 % | 01.10.2024 | 150.000 | 0,23 |
| 100.000.000 | EUR | Santander UK plc | 3,40 % | 01.10.2024 | 100.000 | 0,15 |
| 100.000.000 | EUR | Santander UK plc | 3,40 % | 02.10.2024 | 100.000 | 0,15 |
| Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | | | 5.950.000 | 9,00 |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 1,95 %) | | | | | | |
| | | | | | - | - |
| Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt | | | | | 10.550.000 | 15,97 |
| | | | | | Zeitwert | % des Netto- |
| | | | | | Tsd. EUR | inventarwerts |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt | | | | | 65.655.973 | 99,43 |
| Barmittel und Barsicherheiten | | | | | 1.749.815 | 2,65 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | | | | (1.373.069) | (2,08) |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert | | | | | 66.032.719 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | | | | % des |
| Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | | | | | Gesamt- |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | | | | | | vermögens |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c) | | | | | | 1,37 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | | 16,23 |
| | | | | | | 79,47 |
| | | | | | | 2,93 |
| Gesamtvermögen | | | | | | 100,00 |

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

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

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

³Nullkupon-Anleihe

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (30. September 2023: 21,98 %) | | | | |
| | | Belgien (30. September 2023: 3,90 %) | - | - |
| | | Kanada (30. September 2023: 4,15 %) | - | - |
| 150.000.000 | EUR | Frankreich (30. September 2023: 4,41 %) Credit Agricole SA, 0.00%, 28/02/2025 | 148.025 | 2,94 |
| | | Frankreich - Gesamt | 148.025 | 2,94 |
| 10.000.000 | EUR | Japan (30. September 2023: 4,95 %) MUFG Bank Ltd., 0.00%, 29/10/2024 | 9.972 | 0,20 |
| 46.500.000 | GBP | Norinchukin Bank (The), 0.00%, 05/12/2024 | 55.384 | 1,10 |
| 150.000.000 | EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 06/01/2025 | 148.662 | 2,95 |
| | | Japan - Gesamt | 214.018 | 4,25 |
| 100.000.000 | EUR | Schweiz (30. September 2023: 0,00 %) UBS AG, 0.00%, 09/06/2025 | 97.961 | 1,94 |
| | | Schweiz - Gesamt | 97.961 | 1,94 |
| 100.000.000 | EUR | Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 4,57 %) Barclays Bank plc, 0.00%, 07/03/2025 | 98.650 | 1,96 |
| 50.000.000 | EUR | Lloyds Bank Corporate Markets plc, 0.00%, 09/06/2025 | 49.025 | 0,97 |
| 140.000.000 | EUR | Standard Chartered Bank, 0.00%, 12/05/2025 | 137.409 | 2,72 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 285.084 | 5,65 |
| Anlagen in Einlagenzertifikaten - Gesamt | | | 745.088 | 14,78 |
| Commercial Papers (30. September 2023: 24,82 %) | | | | |
| 150.000.000 | EUR | Australien (30. September 2023: 0,00 %) Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 31/10/2024 | 149.566 | 2,97 |
| | | Australien - Gesamt | 149.566 | 2,97 |
| 87.000.000 | EUR | Frankreich (30. September 2023: 6,95 %) Axa Banque, 0.00%, 03/03/2025 | 85.847 | 1,70 |
| 93.000.000 | EUR | Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 20/03/2025 | 91.633 | 1,82 |
| 60.000.000 | EUR | BPCE SA, 0.00%, 02/01/2025 | 59.485 | 1,18 |
| 40.000.000 | EUR | Satellite SASU, 0.00%, 25/10/2024 | 39.903 | 0,79 |
| 70.000.000 | EUR | Societe Generale SA, 0.00%, 03/03/2025 | 69.060 | 1,37 |
| | | Frankreich - Gesamt | 345.928 | 6,86 |
| 80.000.000 | EUR | Deutschland (30. September 2023: 0,29 %) Volkswagen AG, 0.00%, 07/10/2024 | 79.948 | 1,59 |
| | | Deutschland - Gesamt | 79.948 | 1,59 |
| 106.000.000 | EUR | Irland (30. September 2023: 3,44 %) Matchpoint Finance plc, 0.00%, 04/11/2024 | 105.643 | 2,10 |
| 31.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 05/11/2024 | 30.893 | 0,61 |
| 2.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 05/11/2024 | 1.993 | 0,04 |
| 80.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 12/11/2024 | 79.669 | 1,58 |
| 20.000.000 | EUR | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 04/12/2024 | 19.875 | 0,39 |
| | | Irland - Gesamt | 238.073 | 4,72 |
| 100.000.000 | EUR | Jersey (30. September 2023: 1,96 %) Royal Bank of Scotland International Ltd. (The), 0.00%, 02/05/2025 | 98.227 | 1,95 |

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Jersey (Fortsetzung) | | | | |
| 50.000.000 | EUR | Royal Bank of Scotland International Ltd. (The), 0.00%, 09/05/2025 | 49.092 | 0,97 |
| | | Jersey - Gesamt | 147.319 | 2,92 |
| Luxemburg (30. September 2023: 3,84 %) | | | | |
| 16.000.000 | EUR | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 22/11/2024 | 15.918 | 0,32 |
| 23.000.000 | EUR | Mohawk Capital Luxembourg SA, 0.00%, 16/10/2024 | 22.966 | 0,45 |
| | | Luxemburg - Gesamt | 38.884 | 0,77 |
| Niederlande (30. September 2023: 3,48 %) | | | | |
| 13.000.000 | EUR | Daimler Truck International Finance BV, 0.00%, 16/10/2024 | 12.979 | 0,26 |
| 18.500.000 | EUR | Enel Finance International NV, 0.00%, 24/10/2024 | 18.459 | 0,37 |
| 70.000.000 | EUR | Enel Finance International NV, 0.00%, 28/10/2024 | 69.818 | 1,38 |
| 50.000.000 | EUR | Enel Finance International NV, 0.00%, 30/10/2024 | 49.860 | 0,99 |
| 70.000.000 | EUR | Universal Music Group NV, 0.00%, 21/02/2025 | 69.068 | 1,37 |
| | | Niederlande - Gesamt | 220.184 | 4,37 |
| Spanien (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 130.000.000 | EUR | Banco Santander SA, 0.00%, 02/04/2025 | 127.956 | 2,54 |
| | | Spanien - Gesamt | 127.956 | 2,54 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 2,08 %) | | | | |
| 10.000.000 | GBP | Honda Finance Europe plc, 0.00%, 21/10/2024 | 11.985 | 0,24 |
| 83.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 04/10/2024 | 74.329 | 1,47 |
| 50.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 07/10/2024 | 44.758 | 0,89 |
| 15.000.000 | EUR | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 09/12/2024 | 14.898 | 0,29 |
| 10.000.000 | EUR | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 13/12/2024 | 9.929 | 0,20 |
| 74.500.000 | EUR | Reckitt Benckiser Treasury Services plc, 0.00%, 17/10/2024 | 74.382 | 1,48 |
| 10.000.000 | EUR | Sumitomo Corp. Capital Europe plc, 0.00%, 28/10/2024 | 9.974 | 0,20 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 240.255 | 4,77 |
| | | Vereinigte Staaten (30. September 2023: 2,78 %) | - | - |
| Anlagen in Commercial Papers - Gesamt | | | 1.588.113 | 31,51 |
| Termineinlagen (30. September 2023: 8,09 %) | | | | |
| | | Belgien (30. September 2023: 0,22 %) | - | - |
| | | Frankreich (30. September 2023: 2,94 %) | - | - |
| Deutschland (30. September 2023: 4,93 %) | | | | |
| 286.000.000 | EUR | DZ Bank AG, 3.40%, 01/10/2024 | 286.000 | 5,67 |
| | | Deutschland - Gesamt | 286.000 | 5,67 |
| Anlagen in Termineinlagen - Gesamt | | | 286.000 | 5,67 |

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| ANLEIHEN | | | | |
| Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2023: 40,29 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 4,14 %) | | | | |
| 60.000.000 | EUR | Macquarie Bank Ltd., FRN, 4.29%, 20/10/2025 | 60.242 | 1,20 |
| | | Australien - Gesamt | 60.242 | 1,20 |
| Belgien (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 145.000.000 | EUR | Belfius Bank SA, FRN, 3.87%, 17/09/2026 | 145.135 | 2,88 |
| | | Belgien - Gesamt | 145.135 | 2,88 |
| Kanada (30. September 2023: 1,76 %) | | | | |
| | | | - | - |
| Finnland (30. September 2023: 1,71 %) | | | | |
| 52.000.000 | EUR | OP Corporate Bank plc, FRN, 4.03%, 21/11/2025 | 52.153 | 1,03 |
| | | Finnland - Gesamt | 52.153 | 1,03 |
| Frankreich (30. September 2023: 11,31 %) | | | | |
| 51.000.000 | EUR | Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 4.01%, 17/01/2025 | 51.041 | 1,01 |
| 66.300.000 | EUR | Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 3.85%, 08/09/2025 | 66.418 | 1,32 |
| 200.000.000 | EUR | BPCE SA, FRN, 4.07%, 18/07/2025 | 200.120 | 3,97 |
| 27.100.000 | EUR | Credit Agricole SA, FRN, 3.79%, 07/03/2025 | 27.137 | 0,54 |
| 62.000.000 | EUR | HSBC Continental Europe SA, FRN, 4.00%, 10/05/2026 | 62.093 | 1,23 |
| 68.900.000 | EUR | Societe Generale SA, FRN, 4.14%, 13/01/2025 | 68.976 | 1,37 |
| | | Frankreich - Gesamt | 475.785 | 9,44 |
| Deutschland (30. September 2023: 4,02 %) | | | | |
| 37.200.000 | EUR | Deutsche Bank AG, FRN, 4.34%, 15/01/2026 | 37.351 | 0,74 |
| 145.000.000 | EUR | DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main, FRN, 3.96%, 28/02/2025 | 145.125 | 2,88 |
| | | Deutschland - Gesamt | 182.476 | 3,62 |
| Luxemburg (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 150.000.000 | EUR | Purple Protected Asset, FRN, 3.49%, 18/09/2025 | 150.000 | 2,98 |
| | | Luxemburg - Gesamt | 150.000 | 2,98 |
| Niederlande (30. September 2023: 6,15 %) | | | | |
| 101.400.000 | EUR | ABN AMRO Bank NV, FRN, 4.05%, 10/01/2025 | 101.481 | 2,02 |
| 212.000.000 | EUR | Toyota Motor Finance (Netherlands) BV, FRN, 3.90%, 28/05/2025 | 212.307 | 4,21 |
| | | Niederlande - Gesamt | 313.788 | 6,23 |
| Spanien (30. September 2023: 1,53 %) | | | | |
| 77.700.000 | EUR | Banco Santander SA, FRN, 4.21%, 16/01/2025 | 77.811 | 1,54 |
| | | Spanien - Gesamt | 77.811 | 1,54 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 6,71 %) | | | | |
| 60.000.000 | EUR | HSBC Bank plc, FRN, 3.87%, 08/03/2025 | 60.087 | 1,19 |
| 163.000.000 | EUR | Lloyds Bank Corporate Markets plc, FRN, 3.94%, 30/08/2025 | 163.267 | 3,24 |
| 100.000.000 | EUR | Nationwide Building Society, FRN, 4.08%, 10/11/2025 | 100.255 | 1,99 |
| 107.400.000 | EUR | NatWest Markets plc, FRN, 4.31%, 09/01/2026 | 107.796 | 2,14 |
| 119.000.000 | EUR | Standard Chartered Bank, FRN, 4.04%, 03/03/2025 | 119.239 | 2,36 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 550.644 | 10,92 |

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| ANLEIHEN (Fortsetzung) | | | | |
| Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung) | | | | |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 2,96 %) | | | | |
| 150.000.000 | EUR | Metropolitan Life Global Funding I, FRN, 3.94%, 18/06/2025 | 150.378 | 2,98 |
| 90.000.000 | EUR | Metropolitan Life Global Funding I, FRN, 3.92%, 17/09/2026 | 90.031 | 1,79 |
| Vereinigte Staaten - Gesamt | | | 240.409 | 4,77 |
| Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt | | | 2.248.443 | 44,61 |
| Anlagen in Anleihen - Gesamt | | | 2.248.443 | 44,61 |

| Beschreibung | Kontrahent | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---|-----------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------|
| Devisenterminkontrakte¹ | | | | |
| Buy EUR 74,672,562; Sell USD 82,656,059 | HSBC | 04.10.2024 | 617 | 0,01 |
| Buy EUR 310,723; Sell USD 343,941 | Merrill Lynch | 04.10.2024 | 3 | – |
| Buy EUR 44,897,326; Sell USD 49,800,177 | Goldman Sachs | 07.10.2024 | 284 | 0,01 |
| Buy EUR 180,150; Sell USD 199,823 | HSBC | 07.10.2024 | 1 | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2023: 0,00 %) | | | 905 | 0,02 |
| Devisenterminkontrakte¹ | | | | |
| Buy EUR 103,278; Sell GBP 88,556 | NatWest Markets | 21.10.2024 | (3) | – |
| Buy EUR 11,559,119; Sell GBP 9,911,444 | HSBC | 21.10.2024 | (343) | (0,01) |
| Buy EUR 686,421; Sell GBP 580,435 | Toronto-Dominion Bank | 05.12.2024 | (9) | – |
| Buy EUR 54,304,442; Sell GBP 45,919,565 | NatWest Markets | 05.12.2024 | (734) | (0,01) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2023: 0,00 %) | | | (1.089) | (0,02) |

| | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|--|----------------------|---|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt | 4.868.549 | 96,59 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt | (1.089) | (0,02) |
| Barmittel und Barsicherheiten | 279.520 | 5,55 |
| Zahlungsmitteläquivalente | | |
| Bestand | | |
| 965.229 | EUR | Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (30. September 2023: 0,00 %) |
| | | BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0) ² |
| | 101.097 | 2,00 |
| Zahlungsmitteläquivalente - Gesamt | 101.097 | 2,00 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | (207.444) | (4,12) |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert | 5.040.633 | 100,00 |

| Analyse des Gesamtvermögens | % des Gesamt- vermögens |
|---|-------------------------------|
| Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 42,66 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c) | 49,69 |
| Investmentfonds (CIS) | 1,92 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 0,02 |
| Sonstige Vermögenswerte | 5,71 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

¹Devisenterminkontrakte, die bei einem Kontrahenten mit der gleichen Kaufwährung, Verkaufswährung und Fälligkeit gehalten werden, werden gegebenenfalls als Summe ausgewiesen. Aktiv- und Passivpositionen werden nicht verrechnet.

²Dem Fonds nahestehende Partei.

| Derivative Finanzinstrumente | Basisengagement Tsd. EUR |
|-------------------------------------|-------------------------------------|
| Devisenterminkontrakte | 187.074 |

BLACKROCK ICS STERLING GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | | | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|-----------|------------------------|----------------------|-------------------------------|
| ANLEIHEN | | | | | | |
| Staatsanleihen (30. September 2023: 17,96 %) | | | | | | |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 17,96 %) | | | | | | |
| 50.600.000 | GBP | UK Treasury Bill, 0.00%, 14/10/2024 ¹ | | | 50.510 | 0,88 |
| 47.100.000 | GBP | UK Treasury Bill, 0.00%, 21/10/2024 ¹ | | | 46.968 | 0,81 |
| 47.822.000 | GBP | UK Treasury Bill, 0.00%, 28/10/2024 ¹ | | | 47.645 | 0,83 |
| 163.697.000 | GBP | UK Treasury Bill, 0.00%, 04/11/2024 ¹ | | | 162.930 | 2,82 |
| 29.000.000 | GBP | UK Treasury Bill, 0.00%, 11/11/2024 ¹ | | | 28.839 | 0,50 |
| 656.918.000 | GBP | UK Treasury Bill, 0.00%, 25/11/2024 ¹ | | | 651.925 | 11,30 |
| 25.000.000 | GBP | UK Treasury Bill, 0.00%, 02/12/2024 ¹ | | | 24.782 | 0,43 |
| 9.900.000 | GBP | UK Treasury Bill, 0.00%, 09/12/2024 ¹ | | | 9.808 | 0,17 |
| 300.000.000 | GBP | UK Treasury Bill, 0.00%, 16/12/2024 ¹ | | | 296.837 | 5,14 |
| 236.647.000 | GBP | UK Treasury Bill, 0.00%, 30/12/2024 ¹ | | | 233.701 | 4,05 |
| 5.200.000 | GBP | UK Treasury Bill, 0.00%, 13/01/2025 ¹ | | | 5.128 | 0,09 |
| 100.000.000 | GBP | UK Treasury Bill, 0.00%, 27/01/2025 ¹ | | | 98.392 | 1,71 |
| Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | | | 1.657.465 | 28,73 |
| Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt | | | | | 1.657.465 | 28,73 |
| Anlagen in Anleihen - Gesamt | | | | | 1.657.465 | 28,73 |
| Bestand | Währung | Kontrahent | Zinssätze | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
| Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2023: 105,38 %) | | | | | | |
| Australien (30. September 2023: 7,51 %) | | | | | | |
| 150.000.000 | GBP | National Australia Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 150.000 | 2,60 |
| Australien - Gesamt | | | | | 150.000 | 2,60 |
| Kanada (30. September 2023: 32,22 %) | | | | | | |
| Frankreich (30. September 2023: 28,00 %) | | | | | | |
| 195.000.000 | GBP | BNP Paribas SA | 4,98 % | 01.10.2024 | 195.000 | 3,38 |
| 250.000.000 | GBP | Societe Generale | 4,97 % | 01.10.2024 | 250.000 | 4,33 |
| Frankreich - Gesamt | | | | | 445.000 | 7,71 |
| Japan (30. September 2023: 12,95 %) | | | | | | |
| Spanien (30. September 2023: 7,53 %) | | | | | | |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 15,03 %) | | | | | | |
| 250.000.000 | GBP | Bank of Nova Scotia plc | 4,97 % | 01.10.2024 | 250.000 | 4,33 |
| 100.000.000 | GBP | Bank of Nova Scotia plc | 4,97 % | 01.10.2024 | 100.000 | 1,73 |
| 100.000.000 | GBP | Bank of Nova Scotia plc | 4,97 % | 02.10.2024 | 100.000 | 1,73 |
| 300.000.000 | GBP | Barclays Bank plc | 4,98 % | 01.10.2024 | 300.000 | 5,20 |
| 137.362.500 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 137.363 | 2,38 |
| 105.862.500 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 105.863 | 1,83 |
| 55.360.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 55.360 | 0,96 |
| 30.920.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 30.920 | 0,54 |

BLACKROCK ICS STERLING GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Kontrahent | Zinssätze | Fälligkeits-termin | Zeitwert Tsd. GBP | % des Nettoinventarwerts |
|---|---------|---|-----------|--------------------|--------------------------|---------------------------------|
| Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung) | | | | | | |
| Vereinigtes Königreich (Fortsetzung) | | | | | | |
| 8.606.250 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 8.606 | 0,15 |
| 8.437.500 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 8.437 | 0,15 |
| 2.500.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 2.500 | 0,04 |
| 951.250 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 951 | 0,02 |
| 137.025.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 137.025 | 2,37 |
| 105.525.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 105.525 | 1,83 |
| 55.040.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 55.040 | 0,95 |
| 31.993.750 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 31.994 | 0,55 |
| 8.572.500 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 8.573 | 0,15 |
| 8.403.750 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 8.404 | 0,15 |
| 2.493.750 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 2.494 | 0,04 |
| 946.250 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 946 | 0,02 |
| 100.000.000 | GBP | Credit Agricole Corporate and Investment Bank | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 1,73 |
| 100.000.000 | GBP | Credit Agricole Corporate and Investment Bank | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 1,73 |
| 100.000.000 | GBP | Credit Agricole Corporate and Investment Bank | 4,99 % | 02.10.2024 | 100.000 | 1,73 |
| 100.000.000 | GBP | Credit Agricole Corporate and Investment Bank | 4,99 % | 02.10.2024 | 100.000 | 1,73 |
| 26.871.039 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 26.871 | 0,47 |
| 23.128.961 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 23.129 | 0,40 |
| 45.035.335 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 02.10.2024 | 45.035 | 0,78 |
| 4.964.665 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 02.10.2024 | 4.965 | 0,09 |
| 250.000.000 | GBP | Goldman Sachs International | 4,97 % | 01.10.2024 | 250.000 | 4,33 |
| 200.000.000 | GBP | HSBC Bank plc | 4,97 % | 01.10.2024 | 200.000 | 3,47 |
| 350.000.000 | GBP | J.P. Morgan Securities plc | 4,98 % | 01.10.2024 | 350.000 | 6,07 |
| 91.120.582 | GBP | MUFG Securities EMEA plc | 4,97 % | 01.10.2024 | 91.121 | 1,58 |
| 70.137.952 | GBP | MUFG Securities EMEA plc | 4,97 % | 01.10.2024 | 70.138 | 1,22 |
| 38.741.466 | GBP | MUFG Securities EMEA plc | 4,97 % | 01.10.2024 | 38.741 | 0,67 |
| 72.486.183 | GBP | MUFG Securities EMEA plc | 4,97 % | 02.10.2024 | 72.486 | 1,26 |
| 67.689.067 | GBP | MUFG Securities EMEA plc | 4,97 % | 02.10.2024 | 67.689 | 1,17 |
| 59.824.750 | GBP | MUFG Securities EMEA plc | 4,97 % | 02.10.2024 | 59.825 | 1,04 |
| 250.000.000 | GBP | NatWest Markets plc | 4,98 % | 01.10.2024 | 250.000 | 4,33 |
| 300.000.000 | GBP | Santander UK plc | 4,98 % | 01.10.2024 | 300.000 | 5,20 |
| 138.346.224 | GBP | Standard Chartered Bank | 4,98 % | 01.10.2024 | 138.346 | 2,40 |
| 132.447.480 | GBP | Standard Chartered Bank | 4,98 % | 01.10.2024 | 132.447 | 2,29 |
| 29.206.296 | GBP | Standard Chartered Bank | 4,98 % | 01.10.2024 | 29.206 | 0,51 |
| 100.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 1,73 |
| 99.873.105 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 99.873 | 1,73 |
| 71.371.700 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 71.372 | 1,24 |
| 28.755.194 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 28.755 | 0,50 |
| Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | | | 4.300.000 | 74,52 |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 2,14 %) | | | | | - | - |
| Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt | | | | | 4.895.000 | 84,83 |
| | | | | | Zeitwert Tsd. GBP | % des Nettoinventarwerts |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt | | | | | 6.552.465 | 113,56 |
| Zahlungsmittel | | | | | 135.180 | 2,34 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | | | | (917.760) | (15,90) |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert | | | | | 5.769.885 | 100,00 |

BLACKROCK ICS STERLING GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

Analyse des Gesamtvermögens

An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

Sonstige Vermögenswerte

Gesamtvermögen

**% des Gesamt-
vermögens**

97,89

2,11

100,00

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

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (30. September 2023: 25,08 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 2,75 %) | | | | |
| 17.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 15/11/2024 | 16.897 | 0,17 |
| 17.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 16.782 | 0,17 |
| 25.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 15/01/2025 | 24.650 | 0,25 |
| 38.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 23/01/2025 | 37.429 | 0,38 |
| 34.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 05/02/2025 | 33.432 | 0,34 |
| 25.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 12/02/2025 | 24.560 | 0,25 |
| 15.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 03/03/2025 | 14.700 | 0,15 |
| 20.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 18/10/2024 | 19.952 | 0,20 |
| 10.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, 5.24%, 07/11/2024 | 10.002 | 0,10 |
| 21.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, 5.17%, 06/01/2025 | 21.013 | 0,21 |
| 17.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 06/01/2025 | 16.784 | 0,17 |
| 17.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 05/02/2025 | 16.719 | 0,17 |
| 13.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 24/02/2025 | 12.754 | 0,13 |
| 44.000.000 | GBP | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 08/10/2024 | 43.953 | 0,45 |
| 35.000.000 | GBP | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 08/10/2024 | 34.963 | 0,36 |
| 85.000.000 | GBP | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 13/01/2025 | 83.830 | 0,85 |
| 58.000.000 | GBP | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 15/01/2025 | 57.187 | 0,58 |
| Australien - Gesamt | | | 485.607 | 4,93 |
| Kanada (30. September 2023: 2,85 %) | | | | |
| 5.000.000 | GBP | Bank of Montreal, 0.00%, 27/01/2025 | 4.923 | 0,05 |
| 170.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The), 5.74%, 01/11/2024 | 170.099 | 1,72 |
| 60.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The), 5.23%, 08/11/2024 | 60.016 | 0,61 |
| 50.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 24/03/2025 | 48.868 | 0,50 |
| 20.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The), 5.34%, 17/06/2025 | 19.998 | 0,20 |
| Kanada - Gesamt | | | 303.904 | 3,08 |
| Finnland (30. September 2023: 2,37 %) | | | | |
| 27.000.000 | GBP | Nordea Bank Abp, 0.00%, 04/11/2024 | 26.875 | 0,27 |
| 67.000.000 | GBP | Nordea Bank Abp, 0.00%, 06/02/2025 | 65.877 | 0,67 |
| 30.000.000 | GBP | Nordea Bank Abp, 0.00%, 07/02/2025 | 29.493 | 0,30 |
| 16.000.000 | GBP | Nordea Bank Abp, 5.32%, 18/02/2025 | 16.026 | 0,16 |
| 34.000.000 | GBP | Nordea Bank Abp, 0.00%, 25/03/2025 | 33.229 | 0,34 |
| 34.000.000 | GBP | Nordea Bank Abp, 0.00%, 10/04/2025 | 33.163 | 0,34 |
| Finnland - Gesamt | | | 204.663 | 2,08 |
| Frankreich (30. September 2023: 1,67 %) | | | | |
| 90.000.000 | GBP | BNP Paribas SA, 5.30%, 31/01/2025 | 90.095 | 0,91 |
| 33.000.000 | GBP | BNP Paribas SA, 5.18%, 31/01/2025 | 33.023 | 0,33 |
| 76.000.000 | GBP | BNP Paribas SA, 0.00%, 03/02/2025 | 74.729 | 0,76 |
| 112.500.000 | GBP | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 0.00%, 06/01/2025 | 111.025 | 1,13 |
| 112.500.000 | GBP | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 0.00%, 08/01/2025 | 110.997 | 1,13 |
| Frankreich - Gesamt | | | 419.869 | 4,26 |
| Japan (30. September 2023: 5,13 %) | | | | |
| 10.000.000 | GBP | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 17/10/2024 | 9.977 | 0,10 |
| 15.000.000 | GBP | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 04/12/2024 | 14.867 | 0,15 |
| 50.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 01/10/2024 | 49.993 | 0,51 |
| 70.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 5.26%, 21/10/2024 | 70.007 | 0,71 |
| 18.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 21/10/2024 | 17.948 | 0,18 |
| 50.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 5.24%, 28/10/2024 | 50.006 | 0,51 |
| 50.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 5.24%, 29/10/2024 | 50.006 | 0,51 |
| 50.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 5.06%, 20/11/2024 | 50.002 | 0,51 |
| 20.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 5.05%, 03/12/2024 | 20.002 | 0,20 |
| 20.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 4.95%, 03/01/2025 | 20.001 | 0,20 |
| 40.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 39.478 | 0,40 |
| 45.000.000 | GBP | MUFG Bank Ltd., 4.97%, 10/01/2025 | 44.991 | 0,46 |

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| Japan (Fortsetzung) | | | | |
| 35.000.000 | GBP | MUFG Bank Ltd., 4.97%, 13/01/2025 | 34.993 | 0,36 |
| 60.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 06/01/2025 | 59.217 | 0,60 |
| 30.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.27%, 16/10/2024 | 30.002 | 0,30 |
| 10.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.24%, 25/10/2024 | 10.001 | 0,10 |
| 20.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.27%, 01/11/2024 | 20.003 | 0,20 |
| 27.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 4.95%, 06/01/2025 | 27.001 | 0,27 |
| 17.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 16.778 | 0,17 |
| 50.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 4.95%, 08/01/2025 | 50.002 | 0,51 |
| 26.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.00%, 08/01/2025 | 26.005 | 0,26 |
| 50.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 4.95%, 09/01/2025 | 50.003 | 0,51 |
| 50.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 4.95%, 10/01/2025 | 50.003 | 0,51 |
| 95.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 4.95%, 17/01/2025 | 95.008 | 0,96 |
| Japan - Gesamt | | | 906.294 | 9,19 |
| Niederlande (30. September 2023: 3,76 %) | | | | |
| 80.000.000 | GBP | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 06/01/2025 | 78.961 | 0,80 |
| 150.000.000 | GBP | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 21/02/2025 | 147.177 | 1,49 |
| 85.000.000 | GBP | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 24/02/2025 | 83.369 | 0,85 |
| 130.000.000 | GBP | ING Bank NV, 0.00%, 19/02/2025 | 127.599 | 1,29 |
| Niederlande - Gesamt | | | 437.106 | 4,43 |
| Norwegen (30. September 2023: 0,36 %) | | | | |
| 25.000.000 | GBP | DNB Bank ASA, 0.00%, 08/11/2024 | 24.870 | 0,25 |
| 15.000.000 | GBP | DNB Bank ASA, 0.00%, 03/02/2025 | 14.756 | 0,15 |
| 82.000.000 | GBP | DNB Bank ASA, 0.00%, 28/02/2025 | 80.406 | 0,82 |
| 15.000.000 | GBP | DNB Bank ASA, 0.00%, 03/03/2025 | 14.703 | 0,15 |
| Norwegen - Gesamt | | | 134.735 | 1,37 |
| Singapur (30. September 2023: 1,77 %) | | | | |
| 18.000.000 | GBP | DBS Bank Ltd., 0.00%, 19/11/2024 | 17.879 | 0,18 |
| 10.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.31%, 04/10/2024 | 10.000 | 0,10 |
| 5.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.28%, 14/10/2024 | 5.000 | 0,05 |
| 7.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.27%, 16/10/2024 | 7.001 | 0,07 |
| 10.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.28%, 17/10/2024 | 10.001 | 0,10 |
| 10.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.28%, 21/10/2024 | 10.001 | 0,10 |
| 25.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.22%, 29/10/2024 | 25.003 | 0,26 |
| 25.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.06%, 02/12/2024 | 25.002 | 0,26 |
| 10.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 4.97%, 10/01/2025 | 10.001 | 0,10 |
| 10.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 4.90%, 21/01/2025 | 9.999 | 0,10 |
| 10.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 4.97%, 31/01/2025 | 10.002 | 0,10 |
| 10.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 4.95%, 07/02/2025 | 10.001 | 0,10 |
| Singapur - Gesamt | | | 149.890 | 1,52 |
| Schweiz (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 40.000.000 | GBP | UBS AG, 0.00%, 13/01/2025 | 39.439 | 0,40 |
| 40.000.000 | GBP | UBS AG, 0.00%, 27/01/2025 | 39.367 | 0,40 |
| 25.000.000 | GBP | UBS AG, 0.00%, 21/03/2025 | 24.438 | 0,25 |
| Schweiz - Gesamt | | | 103.244 | 1,05 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 4,42 %) | | | | |
| 75.000.000 | GBP | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 18/10/2024 | 74.821 | 0,76 |
| 35.500.000 | GBP | NatWest Markets plc, 0.00%, 02/01/2025 | 35.061 | 0,35 |
| 16.500.000 | GBP | NatWest Markets plc, 0.00%, 07/01/2025 | 16.286 | 0,16 |
| 61.600.000 | GBP | NatWest Markets plc, 0.00%, 08/01/2025 | 60.787 | 0,62 |
| 44.000.000 | GBP | NatWest Markets plc, 0.00%, 03/02/2025 | 43.276 | 0,44 |

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| 26.000.000 | GBP | Vereinigtes Königreich (Fortsetzung) NatWest Markets plc, 0.00%, 04/02/2025 | 25.571 | 0,26 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 255.802 | 2,59 |
| 15.000.000 | GBP | Vereinigte Staaten (30. September 2023: 0,00 %) Bank of America NA, 0.00%, 20/01/2025 | 14.781 | 0,15 |
| | | Vereinigte Staaten - Gesamt | 14.781 | 0,15 |
| Anlagen in Einlagenzertifikaten - Gesamt | | | 3.415.895 | 34,65 |
| Commercial Papers (30. September 2023: 21,40 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 1,52 %) | | | | |
| 17.000.000 | GBP | Toyota Finance Australia Ltd., 0.00%, 18/11/2024 | 16.886 | 0,18 |
| 23.000.000 | GBP | Toyota Finance Australia Ltd., 0.00%, 09/12/2024 | 22.783 | 0,23 |
| 26.000.000 | GBP | Toyota Finance Australia Ltd., 0.00%, 17/12/2024 | 25.728 | 0,26 |
| | | Australien - Gesamt | 65.397 | 0,67 |
| | | Finnland (30. September 2023: 0,71 %) | - | - |
| Frankreich (30. September 2023: 7,48 %) | | | | |
| 90.000.000 | GBP | BPCE SA, 0.00%, 31/01/2025 | 88.530 | 0,90 |
| 65.000.000 | GBP | BPCE SA, 0.00%, 24/02/2025 | 63.740 | 0,65 |
| 90.000.000 | GBP | BPCE SA, 0.00%, 10/03/2025 | 88.098 | 0,89 |
| 70.000.000 | GBP | BRED Banque Populaire, 0.00%, 07/01/2025 | 69.096 | 0,70 |
| 20.600.000 | GBP | Satellite SASU, 0.00%, 31/10/2024 | 20.512 | 0,21 |
| 20.000.000 | GBP | Satellite SASU, 0.00%, 18/11/2024 | 19.865 | 0,20 |
| 10.000.000 | GBP | Satellite SASU, 0.00%, 28/11/2024 | 9.919 | 0,10 |
| | | Frankreich - Gesamt | 359.760 | 3,65 |
| Deutschland (30. September 2023: 2,73 %) | | | | |
| 32.000.000 | GBP | Allianz SE, 0.00%, 28/10/2024 | 31.881 | 0,32 |
| 75.000.000 | GBP | Allianz SE, 0.00%, 29/10/2024 | 74.710 | 0,76 |
| 20.000.000 | GBP | DekaBank Deutsche Girozentrale, 0.00%, 05/11/2024 | 19.907 | 0,20 |
| 95.000.000 | GBP | DZ Bank AG, 0.00%, 20/11/2024 | 94.358 | 0,96 |
| | | Deutschland - Gesamt | 220.856 | 2,24 |
| Irland (30. September 2023: 2,45 %) | | | | |
| 80.000.000 | GBP | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 12/11/2024 | 79.527 | 0,81 |
| 88.000.000 | GBP | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 22/11/2024 | 87.360 | 0,88 |
| 9.000.000 | GBP | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 27/01/2025 | 8.856 | 0,09 |
| | | Irland - Gesamt | 175.743 | 1,78 |
| Luxemburg (30. September 2023: 0,57 %) | | | | |
| 10.000.000 | GBP | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 25/10/2024 | 9.967 | 0,10 |
| 10.000.000 | GBP | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 20/12/2024 | 9.894 | 0,10 |
| 38.000.000 | GBP | Sunderland Receivables SA, 0.00%, 08/10/2024 | 37.959 | 0,39 |
| 5.000.000 | GBP | Sunderland Receivables SA, 0.00%, 20/11/2024 | 4.966 | 0,05 |
| | | Luxemburg - Gesamt | 62.786 | 0,64 |
| Niederlande (30. September 2023: 1,87 %) | | | | |
| 10.000.000 | GBP | Toyota Motor Finance (Netherlands) BV, 0.00%, 25/11/2024 | 9.924 | 0,10 |
| 5.000.000 | GBP | Toyota Motor Finance (Netherlands) BV, 0.00%, 25/11/2024 | 4.962 | 0,05 |
| 15.000.000 | GBP | Toyota Motor Finance (Netherlands) BV, 0.00%, 20/01/2025 | 14.778 | 0,15 |

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| 18.000.000 | GBP | Niederlande (Fortsetzung) Toyota Motor Finance (Netherlands) BV, 0.00%, 29/01/2025 | 17.712 | 0,18 |
| | | Niederlande - Gesamt | 47.376 | 0,48 |
| | | Norwegen (30. September 2023: 0,53 %) | - | - |
| 30.000.000 | GBP | Singapur (30. September 2023: 0,00 %) Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 28/11/2024 | 29.766 | 0,30 |
| 34.000.000 | GBP | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 27/01/2025 | 33.464 | 0,34 |
| | | Singapur - Gesamt | 63.230 | 0,64 |
| 49.000.000 | GBP | Schweiz (30. September 2023: 0,00 %) UBS AG, 0.00%, 09/01/2025 | 48.338 | 0,49 |
| 65.000.000 | GBP | UBS AG, 0.00%, 20/01/2025 | 64.030 | 0,65 |
| | | Schweiz - Gesamt | 112.368 | 1,14 |
| 6.000.000 | GBP | Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 3,54 %) National Westminster Bank plc, 0.00%, 27/01/2025 | 5.906 | 0,06 |
| 34.000.000 | GBP | NatWest Markets plc, 0.00%, 13/11/2024 | 33.800 | 0,34 |
| 16.000.000 | GBP | NatWest Markets plc, 0.00%, 24/01/2025 | 15.757 | 0,16 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 55.463 | 0,56 |
| Anlagen in Commercial Papers - Gesamt | | | 1.162.979 | 11,80 |
| Termineinlagen (30. September 2023: 22,57 %) | | | | |
| | | Belgien (30. September 2023: 0,94 %) | - | - |
| 86.000.000 | GBP | Kanada (30. September 2023: 2,63 %) Bank of Nova Scotia (The), 4.99%, 01/10/2024 | 86.000 | 0,88 |
| 51.482.017 | GBP | Royal Bank of Canada, 4.95%, 01/10/2024 | 51.482 | 0,52 |
| | | Kanada - Gesamt | 137.482 | 1,40 |
| 328.689.278 | GBP | Frankreich (30. September 2023: 2,83 %) BRED Banque Populaire, 4.95%, 01/10/2024 | 328.689 | 3,33 |
| | | Frankreich - Gesamt | 328.689 | 3,33 |
| 207.137.110 | GBP | Deutschland (30. September 2023: 2,76 %) DZ Bank AG, 4.93%, 01/10/2024 | 207.137 | 2,10 |
| | | Deutschland - Gesamt | 207.137 | 2,10 |
| 409.724.987 | GBP | Japan (30. September 2023: 8,14 %) Mizuho Bank Ltd., 4.95%, 01/10/2024 | 409.725 | 4,15 |
| 238.450.568 | GBP | MUFG Bank Ltd., 4.95%, 01/10/2024 | 238.451 | 2,42 |
| 208.646.213 | GBP | Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 4.95%, 01/10/2024 | 208.646 | 2,12 |
| | | Japan - Gesamt | 856.822 | 8,69 |
| 150.000.000 | GBP | Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 5,27 %) UK Debt Management Office, 4.98%, 01/10/2024 | 150.000 | 1,52 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 150.000 | 1,52 |
| Anlagen in Termineinlagen - Gesamt | | | 1.680.130 | 17,04 |

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts | |
|---|---------|--|-----------|------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| ANLEIHEN | | | | | | |
| Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2023: 7,19 %) | | | | | | |
| Australien (30. September 2023: 1,26 %) | | | | | | |
| 23.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 5.26%, 16/06/2025 | | 22.992 | 0,23 | |
| 53.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 5.29%, 08/09/2025 | | 52.994 | 0,54 | |
| 20.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, 5.22%, 20/11/2024 | | 20.005 | 0,20 | |
| 44.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, FRN, 5.30%, 15/04/2025 | | 44.000 | 0,45 | |
| 42.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, FRN, 5.32%, 25/07/2025 | | 41.996 | 0,42 | |
| 51.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, FRN, 5.27%, 17/09/2025 | | 50.994 | 0,52 | |
| 37.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, FRN, 5.26%, 24/09/2025 | | 36.996 | 0,37 | |
| 55.000.000 | GBP | National Australia Bank Ltd., FRN, 5.28%, 11/09/2025 | | 54.984 | 0,56 | |
| 46.000.000 | GBP | Westpac Banking Corp., FRN, 5.25%, 29/05/2025 | | 45.984 | 0,47 | |
| 47.000.000 | GBP | Westpac Banking Corp., FRN, 5.25%, 30/05/2025 | | 46.984 | 0,48 | |
| 80.000.000 | GBP | Westpac Banking Corp., FRN, 5.25%, 16/06/2025 | | 79.977 | 0,81 | |
| 45.000.000 | GBP | Westpac Banking Corp., FRN, 5.29%, 18/07/2025 | | 44.975 | 0,45 | |
| Australien - Gesamt | | | | 542.881 | 5,50 | |
| Kanada (30. September 2023: 5,62 %) | | | | | | |
| 78.000.000 | GBP | Bank of Nova Scotia (The), FRN, 5.26%, 17/06/2025 | | 77.980 | 0,79 | |
| 46.000.000 | GBP | Royal Bank of Canada, FRN, 5.30%, 27/01/2025 | | 45.996 | 0,47 | |
| 50.000.000 | GBP | Royal Bank of Canada, FRN, 5.24%, 19/05/2025 | | 49.978 | 0,51 | |
| 120.000.000 | GBP | Royal Bank of Canada, FRN, 5.30%, 08/07/2025 | | 119.965 | 1,22 | |
| 32.000.000 | GBP | Royal Bank of Canada, FRN, 5.25%, 23/09/2025 | | 32.009 | 0,32 | |
| Kanada - Gesamt | | | | 325.928 | 3,31 | |
| Niederlande (30. September 2023: 0,31 %) | | | | | | |
| | | | | - | - | |
| Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt | | | | 868.809 | 8,81 | |
| Anlagen in Anleihen - Gesamt | | | | 868.809 | 8,81 | |
| Bestand | Währung | Kontrahent | Zinssätze | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
| Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2023: 26,36 %) | | | | | | |
| Australien (30. September 2023: 0,53 %) | | | | | | |
| 250.000.000 | GBP | National Australia Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 250.000 | 2,54 |
| Australien - Gesamt | | | | | 250.000 | 2,54 |
| Kanada (30. September 2023: 14,74 %) | | | | | | |
| | | | | | - | - |
| Frankreich (30. September 2023: 2,11 %) | | | | | | |
| 255.000.000 | GBP | BNP Paribas SA | 4,98 % | 01.10.2024 | 255.000 | 2,59 |
| Frankreich - Gesamt | | | | | 255.000 | 2,59 |
| Spanien (30. September 2023: 3,17 %) | | | | | | |
| | | | | | - | - |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 5,81 %) | | | | | | |
| 100.000.000 | GBP | Bank of Nova Scotia plc | 4,97 % | 01.10.2024 | 100.000 | 1,01 |

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Kontrahent | Zinssätze | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|------------------------------------|-----------|------------------------|----------------------|-------------------------------|
| Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung) | | | | | | |
| Vereinigtes Königreich (Fortsetzung) | | | | | | |
| 100.000.000 | GBP | Bank of Nova Scotia plc | 4,97 % | 01.10.2024 | 100.000 | 1,01 |
| 100.000.000 | GBP | Bank of Nova Scotia plc | 4,97 % | 02.10.2024 | 100.000 | 1,01 |
| 250.000.000 | GBP | Barclays Bank plc | 4,98 % | 01.10.2024 | 250.000 | 2,54 |
| 67.968.750 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 67.969 | 0,69 |
| 56.980.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 56.980 | 0,58 |
| 27.840.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 27.840 | 0,28 |
| 25.950.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 25.950 | 0,26 |
| 10.688.750 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 10.689 | 0,11 |
| 10.572.500 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 10.573 | 0,11 |
| 67.500.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 67.500 | 0,68 |
| 56.840.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 56.840 | 0,58 |
| 27.720.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 27.720 | 0,28 |
| 25.800.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 25.800 | 0,26 |
| 11.515.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 11.515 | 0,12 |
| 10.625.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 10.625 | 0,11 |
| 64.652.401 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 64.652 | 0,66 |
| 35.347.599 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 35.348 | 0,36 |
| 100.000.000 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 02.10.2024 | 100.000 | 1,01 |
| 150.000.000 | GBP | Goldman Sachs International | 4,97 % | 01.10.2024 | 150.000 | 1,52 |
| 200.000.000 | GBP | NatWest Markets plc | 4,98 % | 01.10.2024 | 200.000 | 2,03 |
| 200.000.000 | GBP | Santander UK plc | 4,98 % | 01.10.2024 | 200.000 | 2,03 |
| 98.882.030 | GBP | Standard Chartered Bank | 4,98 % | 01.10.2024 | 98.882 | 1,00 |
| 73.946.520 | GBP | Standard Chartered Bank | 4,98 % | 01.10.2024 | 73.947 | 0,75 |
| 39.084.500 | GBP | Standard Chartered Bank | 4,98 % | 01.10.2024 | 39.085 | 0,40 |
| 34.247.000 | GBP | Standard Chartered Bank | 4,98 % | 01.10.2024 | 34.247 | 0,35 |
| 3.839.950 | GBP | Standard Chartered Bank | 4,98 % | 01.10.2024 | 3.840 | 0,04 |
| 100.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 1,01 |
| 99.675.409 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 99.675 | 1,01 |
| 53.706.544 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 53.707 | 0,54 |
| 38.668.087 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 38.668 | 0,39 |
| 7.949.959 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 7.950 | 0,08 |
| Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | | | 2.250.002 | 22,81 |
| Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt | | | | | 2.755.002 | 27,94 |
| | | | | | Zeitwert | % des Netto- |
| | | | | | Tsd. GBP | inventarwerts |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt | | | | | 9.882.815 | 100,24 |
| Zahlungsmittel | | | | | 325.937 | 3,31 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | | | | (350.008) | (3,55) |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert | | | | | 9.858.744 | 100,00 |
| | | | | | | % des |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | | | | Gesamt- |
| Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | | | | | vermögens |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | | | | | | 8,26 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c) | | | | | | 26,99 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | | 60,88 |
| Gesamtvermögen | | | | | | 3,87 |
| | | | | | | 100,00 |

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (30. September 2023: 37,88 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 3,50 %) | | | | |
| 82.500.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 15/11/2024 | 81.976 | 0,21 |
| 78.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 76.963 | 0,19 |
| 116.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 15/01/2025 | 114.357 | 0,29 |
| 200.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 23/01/2025 | 196.812 | 0,50 |
| 155.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 05/02/2025 | 152.318 | 0,38 |
| 116.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 12/02/2025 | 113.937 | 0,29 |
| 203.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 03/03/2025 | 198.625 | 0,50 |
| 124.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 18/10/2024 | 123.710 | 0,31 |
| 45.500.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, 5.24%, 07/11/2024 | 45.500 | 0,11 |
| 97.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, 5.17%, 06/01/2025 | 97.000 | 0,24 |
| 78.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 06/01/2025 | 76.963 | 0,19 |
| 78.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 05/02/2025 | 76.650 | 0,19 |
| 55.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 24/02/2025 | 53.895 | 0,14 |
| 197.000.000 | GBP | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 08/10/2024 | 196.810 | 0,50 |
| 153.000.000 | GBP | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 08/10/2024 | 152.853 | 0,39 |
| 400.000.000 | GBP | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 13/01/2025 | 394.270 | 0,99 |
| 277.000.000 | GBP | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 15/01/2025 | 272.992 | 0,69 |
| Australien - Gesamt | | | 2.425.631 | 6,11 |
| Kanada (30. September 2023: 3,47 %) | | | | |
| 18.000.000 | GBP | Bank of Montreal, 0.00%, 27/01/2025 | 17.706 | 0,05 |
| 580.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The), 5.74%, 01/11/2024 | 580.000 | 1,46 |
| 323.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The), 5.23%, 08/11/2024 | 323.000 | 0,81 |
| 400.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 24/03/2025 | 390.560 | 0,98 |
| 415.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The), 5.34%, 17/06/2025 | 415.000 | 1,05 |
| Kanada - Gesamt | | | 1.726.266 | 4,35 |
| Finnland (30. September 2023: 3,33 %) | | | | |
| 114.000.000 | GBP | Nordea Bank Abp, 0.00%, 04/11/2024 | 113.467 | 0,29 |
| 150.000.000 | GBP | Nordea Bank Abp, 0.00%, 15/11/2024 | 149.056 | 0,37 |
| 306.000.000 | GBP | Nordea Bank Abp, 0.00%, 06/02/2025 | 300.433 | 0,76 |
| 150.000.000 | GBP | Nordea Bank Abp, 0.00%, 07/02/2025 | 147.260 | 0,37 |
| 79.000.000 | GBP | Nordea Bank Abp, 5.32%, 18/02/2025 | 79.000 | 0,20 |
| 146.000.000 | GBP | Nordea Bank Abp, 0.00%, 25/03/2025 | 142.478 | 0,36 |
| 146.000.000 | GBP | Nordea Bank Abp, 0.00%, 10/04/2025 | 142.174 | 0,36 |
| Finnland - Gesamt | | | 1.073.868 | 2,71 |
| Frankreich (30. September 2023: 4,04 %) | | | | |
| 50.000.000 | GBP | BNP Paribas SA, 0.00%, 02/10/2024 | 49.993 | 0,13 |
| 410.000.000 | GBP | BNP Paribas SA, 5.30%, 31/01/2025 | 410.000 | 1,03 |
| 158.000.000 | GBP | BNP Paribas SA, 5.18%, 31/01/2025 | 158.000 | 0,40 |
| 400.000.000 | GBP | BNP Paribas SA, 0.00%, 03/02/2025 | 392.943 | 0,99 |
| 370.000.000 | GBP | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 0.00%, 06/01/2025 | 364.981 | 0,92 |
| 370.000.000 | GBP | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 0.00%, 08/01/2025 | 364.879 | 0,92 |
| Frankreich - Gesamt | | | 1.740.796 | 4,39 |
| Japan (30. September 2023: 7,44 %) | | | | |
| 40.000.000 | GBP | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 17/10/2024 | 39.909 | 0,10 |
| 65.000.000 | GBP | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 04/12/2024 | 64.431 | 0,16 |
| 180.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 01/10/2024 | 180.000 | 0,45 |
| 200.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 5.37%, 01/10/2024 | 200.000 | 0,50 |
| 100.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 21/10/2024 | 99.716 | 0,25 |
| 30.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 5.26%, 21/10/2024 | 30.000 | 0,08 |
| 150.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 5.24%, 28/10/2024 | 150.000 | 0,38 |
| 100.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 5.24%, 29/10/2024 | 100.000 | 0,25 |
| 150.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 5.06%, 20/11/2024 | 150.000 | 0,38 |
| 80.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 5.05%, 03/12/2024 | 80.000 | 0,20 |

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| Japan (Fortsetzung) | | | | |
| 80.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 4.95%, 03/01/2025 | 80.000 | 0,20 |
| 160.000.000 | GBP | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 157.909 | 0,40 |
| 200.000.000 | GBP | MUFG Bank Ltd., 4.97%, 10/01/2025 | 200.000 | 0,51 |
| 162.000.000 | GBP | MUFG Bank Ltd., 4.97%, 13/01/2025 | 162.000 | 0,41 |
| 319.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 06/01/2025 | 314.833 | 0,79 |
| 100.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.35%, 02/10/2024 | 100.000 | 0,25 |
| 120.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.27%, 16/10/2024 | 120.000 | 0,30 |
| 56.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.27%, 17/10/2024 | 56.000 | 0,14 |
| 150.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.24%, 25/10/2024 | 150.000 | 0,38 |
| 80.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.27%, 01/11/2024 | 80.000 | 0,20 |
| 113.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 4.95%, 06/01/2025 | 113.000 | 0,29 |
| 77.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 75.990 | 0,19 |
| 135.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 4.95%, 08/01/2025 | 135.000 | 0,34 |
| 115.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.00%, 08/01/2025 | 115.000 | 0,29 |
| 150.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 4.95%, 09/01/2025 | 150.000 | 0,38 |
| 190.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 4.95%, 10/01/2025 | 190.000 | 0,48 |
| 191.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 4.95%, 14/01/2025 | 191.000 | 0,48 |
| 45.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 4.95%, 17/01/2025 | 45.000 | 0,11 |
| 150.000.000 | GBP | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 4.95%, 20/01/2025 | 150.000 | 0,38 |
| Japan - Gesamt | | | 3.679.788 | 9,27 |
| Niederlande (30. September 2023: 4,66 %) | | | | |
| 393.000.000 | GBP | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 06/01/2025 | 387.587 | 0,98 |
| 643.000.000 | GBP | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 21/02/2025 | 630.645 | 1,59 |
| 388.000.000 | GBP | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 24/02/2025 | 380.450 | 0,96 |
| 445.000.000 | GBP | ING Bank NV, 0.00%, 19/02/2025 | 436.326 | 1,10 |
| 53.000.000 | GBP | Rabobank International, 0.00%, 10/01/2025 | 52.280 | 0,13 |
| Niederlande - Gesamt | | | 1.887.288 | 4,76 |
| Norwegen (30. September 2023: 0,45 %) | | | | |
| 118.000.000 | GBP | DNB Bank ASA, 0.00%, 08/11/2024 | 117.385 | 0,29 |
| 80.000.000 | GBP | DNB Bank ASA, 0.00%, 03/02/2025 | 78.612 | 0,20 |
| 390.000.000 | GBP | DNB Bank ASA, 0.00%, 28/02/2025 | 381.863 | 0,96 |
| 80.000.000 | GBP | DNB Bank ASA, 0.00%, 03/03/2025 | 78.308 | 0,20 |
| Norwegen - Gesamt | | | 656.168 | 1,65 |
| Singapur (30. September 2023: 2,38 %) | | | | |
| 76.000.000 | GBP | DBS Bank Ltd., 0.00%, 19/11/2024 | 75.497 | 0,19 |
| 35.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.32%, 02/10/2024 | 35.000 | 0,09 |
| 10.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.31%, 04/10/2024 | 10.000 | 0,02 |
| 20.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.28%, 14/10/2024 | 20.000 | 0,05 |
| 28.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.27%, 16/10/2024 | 28.000 | 0,07 |
| 20.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.28%, 17/10/2024 | 20.000 | 0,05 |
| 40.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.28%, 21/10/2024 | 40.000 | 0,10 |
| 50.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.06%, 13/11/2024 | 50.000 | 0,13 |
| 30.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.04%, 26/11/2024 | 30.000 | 0,08 |
| 25.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 5.06%, 02/12/2024 | 25.000 | 0,06 |
| 40.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 4.97%, 10/01/2025 | 40.000 | 0,10 |
| 40.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 4.90%, 21/01/2025 | 40.000 | 0,10 |
| 15.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 4.97%, 31/01/2025 | 15.000 | 0,04 |
| 10.000.000 | GBP | United Overseas Bank Ltd., 4.95%, 07/02/2025 | 10.000 | 0,02 |
| Singapur - Gesamt | | | 438.497 | 1,10 |
| Schweiz (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 300.000.000 | GBP | UBS AG, 0.00%, 07/01/2025 | 295.888 | 0,74 |
| 196.000.000 | GBP | UBS AG, 0.00%, 13/01/2025 | 193.109 | 0,49 |
| 196.000.000 | GBP | UBS AG, 0.00%, 27/01/2025 | 192.726 | 0,49 |

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| Schweiz (Fortsetzung) | | | | |
| 125.000.000 | GBP | UBS AG, 0.00%, 21/03/2025 | 122.004 | 0,31 |
| | | Schweiz - Gesamt | 803.727 | 2,03 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 8,61 %) | | | | |
| 402.000.000 | GBP | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 18/10/2024 | 401.016 | 1,01 |
| 27.000.000 | GBP | National Westminster Bank plc, 0.00%, 06/01/2025 | 26.633 | 0,07 |
| 1.335.000.000 | GBP | Nationwide Building Society, 4.95%, 02/10/2024 | 1.335.000 | 3,37 |
| 153.500.000 | GBP | NatWest Markets plc, 0.00%, 02/01/2025 | 151.495 | 0,38 |
| 55.000.000 | GBP | NatWest Markets plc, 0.00%, 07/01/2025 | 54.244 | 0,14 |
| 195.000.000 | GBP | NatWest Markets plc, 0.00%, 03/02/2025 | 191.592 | 0,48 |
| 110.500.000 | GBP | NatWest Markets plc, 0.00%, 04/02/2025 | 108.545 | 0,27 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 2.268.525 | 5,72 |
| Anlagen in Einlagenzertifikaten - Gesamt | | | 16.700.554 | 42,09 |
| Commercial Papers (30. September 2023: 20,27 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 0,56 %) | | | | |
| 115.000.000 | GBP | Toyota Finance Australia Ltd., 0.00%, 18/11/2024 | 114.228 | 0,29 |
| 104.000.000 | GBP | Toyota Finance Australia Ltd., 0.00%, 09/12/2024 | 102.981 | 0,26 |
| 129.000.000 | GBP | Toyota Finance Australia Ltd., 0.00%, 17/12/2024 | 127.594 | 0,32 |
| | | Australien - Gesamt | 344.803 | 0,87 |
| Kanada (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 7.000.000 | GBP | OMERS Finance Trust, 0.00%, 29/10/2024 | 6.973 | 0,02 |
| | | Kanada - Gesamt | 6.973 | 0,02 |
| Finnland (30. September 2023: 0,90 %) | | | | |
| | | | - | - |
| Frankreich (30. September 2023: 9,16 %) | | | | |
| 550.000.000 | GBP | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 17/01/2025 | 542.083 | 1,37 |
| 214.000.000 | GBP | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 21/01/2025 | 210.810 | 0,53 |
| 150.000.000 | GBP | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 22/01/2025 | 147.744 | 0,37 |
| 100.000.000 | GBP | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 23/01/2025 | 98.483 | 0,25 |
| 364.000.000 | GBP | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 27/01/2025 | 358.290 | 0,90 |
| 149.000.000 | GBP | Antalis SA, 0.00%, 21/10/2024 | 148.594 | 0,37 |
| 382.000.000 | GBP | BPCE SA, 0.00%, 31/01/2025 | 375.483 | 0,95 |
| 315.000.000 | GBP | BPCE SA, 0.00%, 24/02/2025 | 308.821 | 0,78 |
| 500.000.000 | GBP | BPCE SA, 0.00%, 10/03/2025 | 489.411 | 1,23 |
| 310.000.000 | GBP | BRED Banque Populaire, 0.00%, 07/01/2025 | 305.893 | 0,77 |
| 21.000.000 | GBP | Eurotitrisation - SAT Magenta, 0.00%, 21/11/2024 | 20.854 | 0,05 |
| 44.000.000 | GBP | Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST SA, 0.00%, 01/10/2024 | 44.000 | 0,11 |
| 44.000.000 | GBP | Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST SA, 0.00%, 02/10/2024 | 43.994 | 0,11 |
| 41.000.000 | GBP | Satellite SASU, 0.00%, 25/10/2024 | 40.860 | 0,10 |
| 98.000.000 | GBP | Satellite SASU, 0.00%, 18/11/2024 | 97.331 | 0,25 |
| 30.000.000 | GBP | Satellite SASU, 0.00%, 28/11/2024 | 29.764 | 0,08 |
| | | Frankreich - Gesamt | 3.262.415 | 8,22 |
| Deutschland (30. September 2023: 2,15 %) | | | | |
| 50.000.000 | GBP | DekaBank Deutsche Girozentrale, 0.00%, 05/11/2024 | 49.760 | 0,12 |
| 471.000.000 | GBP | DZ Bank AG, 0.00%, 20/11/2024 | 467.700 | 1,18 |
| | | Deutschland - Gesamt | 517.460 | 1,30 |
| Irland (30. September 2023: 1,18 %) | | | | |
| 28.000.000 | GBP | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 12/11/2024 | 27.839 | 0,07 |

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Irland (Fortsetzung) | | | | |
| 319.000.000 | GBP | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 22/11/2024 | 316.654 | 0,80 |
| 38.000.000 | GBP | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 27/01/2025 | 37.402 | 0,09 |
| 20.000.000 | GBP | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 31/01/2025 | 19.674 | 0,05 |
| Irland - Gesamt | | | 401.569 | 1,01 |
| Japan (30. September 2023: 0,64 %) | | | | |
| | | | - | - |
| Luxemburg (30. September 2023: 0,37 %) | | | | |
| 49.019.000 | GBP | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 21/10/2024 | 48.884 | 0,12 |
| 15.389.000 | GBP | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 21/10/2024 | 15.347 | 0,04 |
| 47.479.000 | GBP | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 25/10/2024 | 47.324 | 0,12 |
| 44.900.000 | GBP | Albion Capital Corp. SA, 0.00%, 20/12/2024 | 44.416 | 0,11 |
| 26.000.000 | GBP | Sunderland Receivables SA, 0.00%, 08/10/2024 | 25.974 | 0,07 |
| 25.000.000 | GBP | Sunderland Receivables SA, 0.00%, 09/10/2024 | 24.971 | 0,06 |
| 23.000.000 | GBP | Sunderland Receivables SA, 0.00%, 20/11/2024 | 22.843 | 0,06 |
| Luxemburg - Gesamt | | | 229.759 | 0,58 |
| Niederlande (30. September 2023: 2,22 %) | | | | |
| 337.000.000 | GBP | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 05/11/2024 | 335.397 | 0,85 |
| 9.000.000 | GBP | PACCAR Financial Europe BV, 0.00%, 03/10/2024 | 8.998 | 0,02 |
| 2.000.000 | GBP | PACCAR Financial Europe BV, 0.00%, 25/10/2024 | 1.993 | - |
| 39.000.000 | GBP | Toyota Motor Finance (Netherlands) BV, 0.00%, 25/11/2024 | 38.700 | 0,10 |
| 18.000.000 | GBP | Toyota Motor Finance (Netherlands) BV, 0.00%, 25/11/2024 | 17.867 | 0,05 |
| 68.000.000 | GBP | Toyota Motor Finance (Netherlands) BV, 0.00%, 20/01/2025 | 66.995 | 0,17 |
| 73.000.000 | GBP | Toyota Motor Finance (Netherlands) BV, 0.00%, 29/01/2025 | 71.788 | 0,18 |
| Niederlande - Gesamt | | | 541.738 | 1,37 |
| Norwegen (30. September 2023: 0,68 %) | | | | |
| | | | - | - |
| Singapur (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 144.000.000 | GBP | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 28/11/2024 | 142.866 | 0,36 |
| 145.000.000 | GBP | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 27/01/2025 | 142.724 | 0,36 |
| Singapur - Gesamt | | | 285.590 | 0,72 |
| Schweiz (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 236.000.000 | GBP | UBS AG, 0.00%, 09/01/2025 | 232.764 | 0,58 |
| 15.000.000 | GBP | UBS AG, 0.00%, 20/01/2025 | 14.768 | 0,04 |
| Schweiz - Gesamt | | | 247.532 | 0,62 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 2,15 %) | | | | |
| 24.000.000 | GBP | National Westminster Bank plc, 0.00%, 27/01/2025 | 23.604 | 0,06 |
| 100.000.000 | GBP | NatWest Markets plc, 0.00%, 13/11/2024 | 99.394 | 0,25 |
| 84.000.000 | GBP | NatWest Markets plc, 0.00%, 24/01/2025 | 82.637 | 0,21 |
| Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | 205.635 | 0,52 |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 0,26 %) | | | | |
| 143.000.000 | GBP | Manhattan Asset Funding Co. LLC, 0.00%, 21/10/2024 | 142.609 | 0,36 |
| 16.996.000 | GBP | Mont Blanc Capital Corp., 0.00%, 16/10/2024 | 16.959 | 0,04 |
| 15.066.000 | GBP | Mont Blanc Capital Corp., 0.00%, 16/12/2024 | 14.912 | 0,04 |
| 35.000.000 | GBP | Nieuw Amsterdam Receivables Corp., 0.00%, 21/10/2024 | 34.904 | 0,09 |
| 126.000.000 | GBP | Nieuw Amsterdam Receivables Corp., 0.00%, 28/10/2024 | 125.534 | 0,31 |
| Vereinigte Staaten - Gesamt | | | 334.918 | 0,84 |
| Anlagen in Commercial Papers - Gesamt | | | 6.378.392 | 16,07 |

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Termineinlagen (30. September 2023: 11,39 %) | | | | |
| 30.000.000 | GBP | Belgien (30. September 2023: 0,25 %) KBC Bank NV, 4.95%, 01/10/2024 | 30.000 | 0,08 |
| | | Belgien - Gesamt | 30.000 | 0,08 |
| 14.000.000 | GBP | Kanada (30. September 2023: 0,28 %) Bank of Nova Scotia (The), 4.99%, 01/10/2024 | 14.000 | 0,03 |
| 50.027.126 | GBP | Royal Bank of Canada, 4.95%, 01/10/2024 | 50.027 | 0,13 |
| | | Kanada - Gesamt | 64.027 | 0,16 |
| 23.515.938 | GBP | Frankreich (30. September 2023: 1,02 %) BRED Banque Populaire, 4.95%, 01/10/2024 | 23.516 | 0,06 |
| | | Frankreich - Gesamt | 23.516 | 0,06 |
| 79.032.141 | GBP | Japan (30. September 2023: 6,45 %) Mizuho Bank Ltd., 4.95%, 01/10/2024 | 79.032 | 0,20 |
| 40.021.701 | GBP | MUFG Bank Ltd., 4.95%, 01/10/2024 | 40.022 | 0,10 |
| 1.507.953.456 | GBP | Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 4.95%, 01/10/2024 | 1.507.953 | 3,80 |
| | | Japan - Gesamt | 1.627.007 | 4,10 |
| | | Niederlande (30. September 2023: 2,26 %) | - | - |
| 104.092.311 | GBP | Singapur (30. September 2023: 0,00 %) United Overseas Bank Ltd., 4.94%, 01/10/2024 | 104.092 | 0,26 |
| | | Singapur - Gesamt | 104.092 | 0,26 |
| | | Spanien (30. September 2023: 1,13 %) | - | - |
| 466.624.428 | GBP | Vereinigte Arabische Emirate (30. September 2023: 0,00 %) National Bank of Abu Dhabi, 4.95%, 01/10/2024 | 466.625 | 1,18 |
| | | Vereinigte Arabische Emirate - Gesamt | 466.625 | 1,18 |
| 850.000.000 | GBP | Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 0,00 %) UK Debt Management Office, 4.98%, 01/10/2024 | 850.000 | 2,14 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 850.000 | 2,14 |
| Anlagen in Termineinlagen - Gesamt | | | 3.165.267 | 7,98 |

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|---------|---------|---------------|----------------------|-------------------------------|
|---------|---------|---------------|----------------------|-------------------------------|

ANLEIHEN

Schuldttitel von Unternehmen (30. September 2023: 11,35 %)

| | | | | |
|-------------|-----|--|---------|------|
| | | Australien (30. September 2023: 1,64 %) | | |
| 119.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 5.26%, 16/06/2025 | 119.000 | 0,30 |
| 221.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 5.29%, 08/09/2025 | 221.000 | 0,56 |
| 97.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, 5.22%, 20/11/2024 | 97.000 | 0,25 |
| 213.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, FRN, 5.30%, 15/04/2025 | 213.000 | 0,54 |
| 195.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, FRN, 5.32%, 25/07/2025 | 195.000 | 0,49 |
| 213.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, FRN, 5.27%, 17/09/2025 | 213.000 | 0,54 |
| 152.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, FRN, 5.26%, 24/09/2025 | 152.000 | 0,38 |
| 230.000.000 | GBP | National Australia Bank Ltd., FRN, 5.28%, 11/09/2025 | 230.000 | 0,58 |
| 228.000.000 | GBP | Westpac Banking Corp., FRN, 5.25%, 29/05/2025 | 228.000 | 0,57 |

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts | |
|---|---------|--|-----------|------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| ANLEIHEN (Fortsetzung) | | | | | | |
| Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung) | | | | | | |
| Australien (Fortsetzung) | | | | | | |
| 227.000.000 | GBP | Westpac Banking Corp., FRN, 5.25%, 30/05/2025 | | 227.000 | 0,57 | |
| 363.000.000 | GBP | Westpac Banking Corp., FRN, 5.25%, 16/06/2025 | | 363.000 | 0,91 | |
| 205.000.000 | GBP | Westpac Banking Corp., FRN, 5.29%, 18/07/2025 | | 205.000 | 0,52 | |
| Australien - Gesamt | | | | 2.463.000 | 6,21 | |
| Kanada (30. September 2023: 7,88 %) | | | | | | |
| 361.000.000 | GBP | Bank of Nova Scotia (The), FRN, 5.26%, 17/06/2025 | | 361.000 | 0,91 | |
| 209.000.000 | GBP | Royal Bank of Canada, FRN, 5.30%, 27/01/2025 | | 209.000 | 0,53 | |
| 380.000.000 | GBP | Royal Bank of Canada, FRN, 5.24%, 19/05/2025 | | 380.000 | 0,96 | |
| 562.000.000 | GBP | Royal Bank of Canada, FRN, 5.30%, 08/07/2025 | | 562.000 | 1,42 | |
| 133.000.000 | GBP | Royal Bank of Canada, FRN, 5.25%, 23/09/2025 | | 133.000 | 0,33 | |
| Kanada - Gesamt | | | | 1.645.000 | 4,15 | |
| Niederlande (30. September 2023: 0,41 %) | | | | | | |
| | | | | - | - | |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 1,42 %) | | | | | | |
| 470.000.000 | GBP | New York Life Global Funding, FRN, 5.28%, 22/08/2025 | | 470.000 | 1,18 | |
| Vereinigte Staaten - Gesamt | | | | 470.000 | 1,18 | |
| Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt | | | | 4.578.000 | 11,54 | |
| Staatsanleihen (30. September 2023: 0,49 %) | | | | | | |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 0,49 %) | | | | | | |
| | | | | - | - | |
| Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt | | | | - | - | |
| Anlagen in Anleihen - Gesamt | | | | 4.578.000 | 11,54 | |
| Bestand | Währung | Kontrahent | Zinssätze | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
| Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2023: 14,80 %) | | | | | | |
| Australien (30. September 2023: 0,00 %) | | | | | | |
| 200.000.000 | GBP | National Australia Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 200.000 | 0,50 |
| Australien - Gesamt | | | | | 200.000 | 0,50 |
| Kanada (30. September 2023: 5,30 %) | | | | | | |
| | | | | | - | - |
| Frankreich (30. September 2023: 0,13 %) | | | | | | |
| 400.000.000 | GBP | BNP Paribas SA | 4,98 % | 01.10.2024 | 400.000 | 1,01 |
| 150.000.000 | GBP | Societe Generale | 4,97 % | 01.10.2024 | 150.000 | 0,38 |
| Frankreich - Gesamt | | | | | 550.000 | 1,39 |

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Kontrahent | Zinssätze | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|------------------------------------|-----------|------------------------|----------------------|-------------------------------|
| Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung) | | | | | | |
| Japan (30. September 2023: 2,56 %) | | | | | - | - |
| Spanien (30. September 2023: 2,98 %) | | | | | - | - |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 2,13 %) | | | | | | |
| 150.000.000 | GBP | Bank of Montreal | 4,98 % | 01.10.2024 | 150.000 | 0,38 |
| 150.000.000 | GBP | Bank of Montreal | 4,98 % | 02.10.2024 | 150.000 | 0,38 |
| 450.000.000 | GBP | Bank of Nova Scotia plc | 4,97 % | 01.10.2024 | 450.000 | 1,13 |
| 400.000.000 | GBP | Barclays Bank plc | 4,98 % | 01.10.2024 | 400.000 | 1,01 |
| 72.875.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 72.875 | 0,18 |
| 25.762.500 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 25.762 | 0,07 |
| 12.545.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 12.545 | 0,03 |
| 12.076.250 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 12.076 | 0,03 |
| 11.781.250 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 11.781 | 0,03 |
| 5.670.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 5.670 | 0,01 |
| 3.528.750 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 3.529 | 0,01 |
| 2.992.500 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 2.993 | 0,01 |
| 1.582.500 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 1.582 | - |
| 1.186.250 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 01.10.2024 | 1.186 | - |
| 72.820.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 72.820 | 0,18 |
| 25.650.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 25.650 | 0,07 |
| 12.480.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 12.480 | 0,03 |
| 12.476.250 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 12.476 | 0,03 |
| 11.700.000 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 11.700 | 0,03 |
| 5.626.250 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 5.626 | 0,01 |
| 3.517.500 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 3.518 | 0,01 |
| 2.977.500 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 2.978 | 0,01 |
| 1.571.250 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 1.571 | - |
| 1.181.250 | GBP | Canadian Imperial Bank of Commerce | 5,00 % | 02.10.2024 | 1.181 | - |
| 500.000.000 | GBP | Citigroup Global Markets Ltd. | 5,00 % | 01.10.2024 | 500.000 | 1,26 |
| 83.741.823 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 83.742 | 0,21 |
| 68.068.444 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 68.068 | 0,17 |
| 35.850.873 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 35.851 | 0,09 |
| 30.203.414 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 30.203 | 0,08 |
| 30.059.627 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 30.060 | 0,08 |
| 24.317.294 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 24.317 | 0,06 |
| 22.906.603 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 22.907 | 0,06 |
| 18.873.193 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 18.873 | 0,05 |
| 13.604.156 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 13.604 | 0,03 |
| 6.567.911 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 6.568 | 0,02 |
| 6.306.809 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 6.307 | 0,02 |
| 4.932.954 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 4.933 | 0,01 |
| 4.566.898 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 01.10.2024 | 4.567 | 0,01 |
| 94.122.789 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 02.10.2024 | 94.123 | 0,24 |
| 87.635.145 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 02.10.2024 | 87.635 | 0,22 |
| 67.777.676 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 02.10.2024 | 67.778 | 0,17 |
| 37.349.521 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 02.10.2024 | 37.350 | 0,09 |
| 35.808.864 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 02.10.2024 | 35.809 | 0,09 |
| 18.752.782 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 02.10.2024 | 18.753 | 0,05 |
| 8.553.223 | GBP | DBS Bank Ltd. | 4,98 % | 02.10.2024 | 8.553 | 0,02 |
| 400.000.000 | GBP | Goldman Sachs International | 4,97 % | 01.10.2024 | 400.000 | 1,01 |
| 250.000.000 | GBP | HSBC Bank plc | 4,97 % | 01.10.2024 | 250.000 | 0,63 |
| 650.000.000 | GBP | J.P. Morgan Securities plc | 4,98 % | 01.10.2024 | 650.000 | 1,64 |
| 134.792.312 | GBP | MUFG Securities EMEA plc | 4,97 % | 01.10.2024 | 134.792 | 0,34 |
| 65.207.688 | GBP | MUFG Securities EMEA plc | 4,97 % | 01.10.2024 | 65.208 | 0,17 |
| 46.196.589 | GBP | MUFG Securities EMEA plc | 4,97 % | 02.10.2024 | 46.197 | 0,12 |
| 44.124.458 | GBP | MUFG Securities EMEA plc | 4,97 % | 02.10.2024 | 44.124 | 0,11 |
| 43.963.412 | GBP | MUFG Securities EMEA plc | 4,97 % | 02.10.2024 | 43.963 | 0,11 |

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Kontrahent | Zinssätze | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|-----------------------------|-----------|------------------------|----------------------|-------------------------------|
| Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung) | | | | | | |
| Vereinigtes Königreich (Fortsetzung) | | | | | | |
| 39.460.235 | GBP | MUFG Securities EMEA plc | 4,97 % | 02.10.2024 | 39.460 | 0,10 |
| 18.901.556 | GBP | MUFG Securities EMEA plc | 4,97 % | 02.10.2024 | 18.902 | 0,05 |
| 7.353.751 | GBP | MUFG Securities EMEA plc | 4,97 % | 02.10.2024 | 7.354 | 0,02 |
| 250.000.000 | GBP | NatWest Markets plc | 4,98 % | 01.10.2024 | 250.000 | 0,63 |
| 1.000.000.000 | GBP | Santander UK plc | 4,98 % | 01.10.2024 | 1.000.000 | 2,52 |
| 107.242.500 | GBP | Standard Chartered Bank | 4,98 % | 01.10.2024 | 107.243 | 0,27 |
| 99.241.360 | GBP | Standard Chartered Bank | 4,98 % | 01.10.2024 | 99.241 | 0,25 |
| 87.882.300 | GBP | Standard Chartered Bank | 4,98 % | 01.10.2024 | 87.882 | 0,22 |
| 41.548.760 | GBP | Standard Chartered Bank | 4,98 % | 01.10.2024 | 41.549 | 0,11 |
| 14.085.080 | GBP | Standard Chartered Bank | 4,98 % | 01.10.2024 | 14.085 | 0,04 |
| 100.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 0,25 |
| 100.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 0,25 |
| 100.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 0,25 |
| 100.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 0,25 |
| 100.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 0,25 |
| 100.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 0,25 |
| 100.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 0,25 |
| 100.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 0,25 |
| 100.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 0,25 |
| 100.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 0,25 |
| 100.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 0,25 |
| 100.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 100.000 | 0,25 |
| 99.020.342 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 99.020 | 0,25 |
| 80.754.600 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 80.755 | 0,20 |
| 51.067.561 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 51.068 | 0,13 |
| 29.545.794 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 29.546 | 0,08 |
| 24.841.913 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 24.842 | 0,06 |
| 14.769.790 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The) | 4,99 % | 01.10.2024 | 14.770 | 0,04 |
| Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | | | 7.350.001 | 18,52 |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 1,70 %) | | | | | - | - |
| Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt | | | | | 8.100.001 | 20,41 |
| | | | | | Zeitwert | % des Netto- |
| | | | | | Tsd. GBP | inventarwerts |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt | | | | | 38.922.214 | 98,09 |
| Zahlungsmittel | | | | | 1.701.825 | 4,29 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | | | | (942.024) | (2,38) |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert | | | | | 39.682.015 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | | | | % des |
| Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | | | | | Gesamt- |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | | | | | | vermögens |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c) | | | | | | 10,99 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | | 20,11 |
| Gesamtvermögen | | | | | | 64,39 |
| | | | | | | 4,51 |
| | | | | | | 100,00 |

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (30. September 2023: 47,12 %) | | | | |
| 80.000.000 | GBP | Australien (30. September 2023: 0,00 %) Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 18/07/2025 | 77.080 | 4,32 |
| | | Australien - Gesamt | 77.080 | 4,32 |
| 30.000.000 | GBP | Belgien (30. September 2023: 3,31 %) Belfius Bank SA, 0.00%, 24/01/2025 | 29.547 | 1,66 |
| | | Belgien - Gesamt | 29.547 | 1,66 |
| 67.000.000 | GBP | Kanada (30. September 2023: 4,40 %) Bank of Montreal, 0.00%, 13/06/2025 | 64.781 | 3,63 |
| 60.000.000 | GBP | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 02/04/2025 | 58.568 | 3,29 |
| | | Kanada - Gesamt | 123.349 | 6,92 |
| 60.000.000 | GBP | Finnland (30. September 2023: 2,43 %) Nordea Bank Abp, 0.00%, 30/05/2025 | 58.176 | 3,26 |
| | | Finnland - Gesamt | 58.176 | 3,26 |
| 70.000.000 | GBP | Frankreich (30. September 2023: 8,70 %) Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 17/01/2025 | 68.984 | 3,87 |
| 30.000.000 | GBP | BNP Paribas SA, 5.22%, 03/02/2025 | 30.014 | 1,68 |
| | | Frankreich - Gesamt | 98.998 | 5,55 |
| 75.000.000 | GBP | Japan (30. September 2023: 18,89 %) MUFG Bank Ltd., 0.00%, 25/03/2025 | 73.276 | 4,11 |
| 40.000.000 | GBP | Norinchukin Bank (The), 0.00%, 06/12/2024 | 39.634 | 2,22 |
| | | Japan - Gesamt | 112.910 | 6,33 |
| 22.000.000 | GBP | Niederlande (30. September 2023: 2,42 %) ING Bank NV, 0.00%, 19/03/2025 | 21.517 | 1,21 |
| | | Niederlande - Gesamt | 21.517 | 1,21 |
| 60.000.000 | GBP | Spanien (30. September 2023: 2,49 %) Banco Santander SA, 0.00%, 20/05/2025 | 58.285 | 3,27 |
| | | Spanien - Gesamt | 58.285 | 3,27 |
| 60.000.000 | GBP | Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 4,48 %) Barclays Bank plc, 0.00%, 10/03/2025 | 58.741 | 3,30 |
| 30.000.000 | GBP | HSBC Bank plc, 5.38%, 13/05/2025 | 30.013 | 1,69 |
| 40.000.000 | GBP | Lloyds Bank Corporate Markets plc, 5.37%, 09/06/2025 | 40.146 | 2,25 |
| 50.000.000 | GBP | NatWest Group plc, 0.00%, 04/11/2024 | 49.765 | 2,79 |
| 40.000.000 | GBP | Standard Chartered Bank, 0.00%, 07/05/2025 | 38.901 | 2,18 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 217.566 | 12,21 |
| Anlagen in Einlagenzertifikaten - Gesamt | | | 797.428 | 44,73 |
| Commercial Papers (30. September 2023: 37,83 %) | | | | |
| 15.000.000 | GBP | Australien (30. September 2023: 0,00 %) Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 01/11/2024 | 14.935 | 0,84 |
| | | Australien - Gesamt | 14.935 | 0,84 |

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| | | Dänemark (30. September 2023: 2,86 %) | - | - |
| | | Finnland (30. September 2023: 2,44 %) | - | - |
| | | Frankreich (30. September 2023: 12,01 %) | | |
| 30.000.000 | GBP | Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 15/04/2025 | 29.242 | 1,64 |
| 50.000.000 | GBP | BPCE SA, 0.00%, 04/11/2024 | 49.764 | 2,79 |
| 70.000.000 | GBP | Societe Generale SA, 0.00%, 13/05/2025 | 67.993 | 3,82 |
| | | Frankreich - Gesamt | 146.999 | 8,25 |
| | | Deutschland (30. September 2023: 0,00 %) | | |
| 56.000.000 | EUR | Deutsche Bank AG, 0.00%, 07/10/2024 | 46.563 | 2,61 |
| | | Deutschland - Gesamt | 46.563 | 2,61 |
| | | Irland (30. September 2023: 1,45 %) | | |
| 35.000.000 | GBP | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 12/11/2024 | 34.793 | 1,95 |
| | | Irland - Gesamt | 34.793 | 1,95 |
| | | Jersey (30. September 2023: 3,99 %) | | |
| 35.000.000 | GBP | Royal Bank of Scotland International Ltd. (The), 0.00%, 27/03/2025 | 34.202 | 1,92 |
| | | Jersey - Gesamt | 34.202 | 1,92 |
| | | Luxemburg (30. September 2023: 1,70 %) | - | - |
| | | Niederlande (30. September 2023: 5,15 %) | - | - |
| | | Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 6,06 %) | | |
| 10.000.000 | GBP | Honda Finance Europe plc, 0.00%, 21/10/2024 | 9.972 | 0,56 |
| 10.000.000 | GBP | Honda Finance Europe plc, 0.00%, 04/11/2024 | 9.953 | 0,56 |
| 40.000.000 | GBP | Lloyds Bank Corporate Markets plc, 0.00%, 01/05/2025 | 38.892 | 2,18 |
| 30.000.000 | GBP | LSEGA Financing plc, 0.00%, 09/10/2024 | 29.962 | 1,68 |
| 31.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 04/10/2024 | 23.099 | 1,30 |
| 50.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 07/10/2024 | 37.240 | 2,09 |
| 30.000.000 | GBP | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 18/12/2024 | 29.677 | 1,66 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 178.795 | 10,03 |
| | | Vereinigte Staaten (30. September 2023: 2,17 %) | - | - |
| | | Anlagen in Commercial Papers - Gesamt | 456.287 | 25,60 |
| | | Termineinlagen (30. September 2023: 15,31 %) | | |
| | | Belgien (30. September 2023: 4,80 %) | | |
| 12.000.000 | GBP | KBC Bank NV, 4.95%, 01/10/2024 | 12.000 | 0,67 |
| | | Belgien - Gesamt | 12.000 | 0,67 |
| | | Kanada (30. September 2023: 0,00 %) | | |
| 135.000.000 | GBP | Bank of Nova Scotia (The), 4.99%, 01/10/2024 | 135.000 | 7,58 |
| | | Kanada - Gesamt | 135.000 | 7,58 |

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Termineinlagen (Fortsetzung) | | | | |
| | | Japan (30. September 2023: 4,24 %) | - | - |
| | | Spanien (30. September 2023: 6,27 %) | - | - |
| Anlagen in Termineinlagen - Gesamt | | | 147.000 | 8,25 |
| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
| ANLEIHEN | | | | |
| Staatsanleihen (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 20.000.000 | GBP | Frankreich (30. September 2023: 0,00 %) Dexia SA, 1.25%, 21/07/2025 | 19.444 | 1,09 |
| Frankreich - Gesamt | | | 19.444 | 1,09 |
| Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt | | | 19.444 | 1,09 |
| Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 30.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 5.29%, 22/04/2025 | 29.990 | 1,68 |
| 10.000.000 | GBP | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 5.29%, 08/09/2025 | 9.999 | 0,56 |
| 30.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, FRN, 5.30%, 15/04/2025 | 30.000 | 1,68 |
| 10.000.000 | GBP | Commonwealth Bank of Australia, FRN, 5.27%, 17/09/2025 | 9.999 | 0,56 |
| 35.000.000 | GBP | National Australia Bank Ltd., FRN, 5.26%, 20/06/2025 | 34.992 | 1,97 |
| 10.000.000 | GBP | Westpac Banking Corp., FRN, 5.25%, 29/05/2025 | 9.997 | 0,56 |
| 10.000.000 | GBP | Westpac Banking Corp., FRN, 5.25%, 30/05/2025 | 9.997 | 0,56 |
| 30.000.000 | GBP | Westpac Banking Corp., FRN, 5.25%, 16/06/2025 | 29.991 | 1,68 |
| Australien - Gesamt | | | 164.965 | 9,25 |
| Kanada (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 35.000.000 | GBP | Bank of Nova Scotia (The), FRN, 5.26%, 17/06/2025 | 34.991 | 1,97 |
| 30.000.000 | GBP | Royal Bank of Canada, FRN, 5.24%, 19/05/2025 | 29.987 | 1,68 |
| Kanada - Gesamt | | | 64.978 | 3,65 |
| Singapur (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 35.000.000 | GBP | DBS Bank Ltd., FRN, 5.98%, 17/11/2025 | 35.249 | 1,98 |
| Singapur - Gesamt | | | 35.249 | 1,98 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 15.000.000 | GBP | HSBC UK Bank plc, FRN, 5.36%, 20/09/2025 | 14.966 | 0,84 |
| Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | 14.966 | 0,84 |

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| ANLEIHEN (Fortsetzung) | | | | |
| Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung) | | | | |
| | | Vereinigte Staaten (30. September 2023: 0,00 %) | | |
| 30.000.000 | GBP | New York Life Global Funding, FRN, 5.28%, 22/08/2025 | 29.994 | 1,68 |
| | | Vereinigte Staaten - Gesamt | 29.994 | 1,68 |
| Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt | | | 310.152 | 17,40 |
| Anlagen in Anleihen - Gesamt | | | 329.596 | 18,49 |

| Beschreibung | Kontrahent | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|--|-----------------|------------------------|----------------------|-------------------------------|
| Devisenterminkontrakte¹ | | | | |
| Buy GBP 47,386,936; Sell EUR 54,908,017 | NatWest Markets | 07.10.2024 | 1.692 | 0,10 |
| Buy GBP 942,395; Sell EUR 1,091,983 | BNP Paribas | 07.10.2024 | 34 | – |
| Buy GBP 23,528,309; Sell USD 30,871,541 | RBC | 04.10.2024 | 513 | 0,03 |
| Buy GBP 97,893; Sell USD 128,459 | Morgan Stanley | 04.10.2024 | 2 | – |
| Buy GBP 38,006,628; Sell USD 50,000,000 | Merrill Lynch | 07.10.2024 | 731 | 0,04 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2023: 0,00 %)² | | | 2.972 | 0,17 |
| Devisenterminkontrakte | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2023: (0,04) %) | | | – | – |

| | Zeitwert Tsd. GBP | % des Netto- inventarwerts |
|---|----------------------|-------------------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt | 1.733.283 | 97,24 |
| Zahlungsmittel | 100.407 | 5,63 |
| Zahlungsmitteläquivalente | (51.199) | (2,87) |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert | 1.782.491 | 100,00 |

Analyse des Gesamtvermögens

| | |
|---|---------------|
| Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 17,89 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c) | 76,03 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 0,16 |
| Sonstige Vermögenswerte | 5,92 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

¹Devisenterminkontrakte, die bei einem Kontrahenten mit der gleichen Kaufwährung, Verkaufswährung und Fälligkeit gehalten werden, werden gegebenenfalls als Summe ausgewiesen. Aktiv- und Passivpositionen werden nicht verrechnet.

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

| Derivative Finanzinstrumente | Basisengagement Tsd. GBP |
|------------------------------|-----------------------------|
| Devisenterminkontrakte | 106.981 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Einlagezertifikate (30. September 2023: 25,37 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 1,40 %) | | | | |
| 10.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 5.70%, 27/11/2024 | 10.012 | 0,23 |
| 5.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 05/12/2024 | 4.957 | 0,11 |
| 10.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 02/01/2025 | 9.881 | 0,23 |
| 10.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 21/03/2025 | 9.792 | 0,22 |
| 8.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 07/04/2025 | 7.819 | 0,18 |
| 14.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 01/10/2024 | 13.998 | 0,32 |
| 12.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 20/12/2024 | 11.873 | 0,27 |
| 8.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 02/01/2025 | 7.903 | 0,18 |
| 8.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 07/02/2025 | 7.868 | 0,18 |
| 15.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 04/04/2025 | 14.660 | 0,33 |
| Australien - Gesamt | | | 98.763 | 2,25 |
| Belgien (30. September 2023: 0,33 %) | | | | |
| 15.000.000 | USD | KBC Bank NV, 0.00%, 18/12/2024 | 14.846 | 0,34 |
| Belgien - Gesamt | | | 14.846 | 0,34 |
| Kanada (30. September 2023: 5,49 %) | | | | |
| 11.000.000 | USD | Bank of Montreal, FRN, 5.10%, 11/02/2025 | 11.003 | 0,25 |
| 12.500.000 | USD | Bank of Montreal, 5.80%, 12/11/2024 | 12.511 | 0,28 |
| 12.000.000 | USD | Bank of Montreal, 0.00%, 09/01/2025 | 11.845 | 0,27 |
| 11.000.000 | USD | Bank of Montreal, 0.00%, 27/01/2025 | 10.835 | 0,25 |
| 3.000.000 | USD | Bank of Montreal, 0.00%, 05/03/2025 | 2.943 | 0,07 |
| 11.000.000 | USD | Bank of Montreal, 0.00%, 04/04/2025 | 10.754 | 0,24 |
| 6.000.000 | USD | Bank of Montreal, 5.53%, 27/05/2025 | 6.044 | 0,14 |
| 7.000.000 | USD | Bank of Montreal, 5.50%, 11/06/2025 | 7.055 | 0,16 |
| 10.000.000 | USD | Bank of Montreal, 0.00%, 28/07/2025 | 9.660 | 0,22 |
| 10.000.000 | USD | Bank of Nova Scotia (The), FRN, 5.14%, 21/02/2025 | 10.004 | 0,23 |
| 10.000.000 | USD | Bank of Nova Scotia (The), 5.80%, 08/11/2024 | 10.008 | 0,23 |
| 10.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.10%, 20/02/2025 | 10.005 | 0,23 |
| 11.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.10%, 04/03/2025 | 11.006 | 0,25 |
| 10.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.10%, 01/04/2025 | 10.004 | 0,23 |
| 14.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.10%, 04/06/2025 | 14.002 | 0,32 |
| 11.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.19%, 23/09/2025 | 11.000 | 0,25 |
| 20.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.80%, 08/11/2024 | 20.015 | 0,46 |
| 6.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.50%, 23/05/2025 | 6.042 | 0,14 |
| 13.000.000 | USD | Royal Bank of Canada, FRN, 5.11%, 06/02/2025 | 13.004 | 0,30 |
| 10.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 5.09%, 21/02/2025 | 10.002 | 0,23 |
| 9.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 5.18%, 22/09/2025 | 8.997 | 0,20 |
| 11.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 5.80%, 07/11/2024 | 11.008 | 0,25 |
| 10.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 5.15%, 31/12/2024 | 10.008 | 0,23 |
| 15.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 02/01/2025 | 14.820 | 0,34 |
| 9.500.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 02/01/2025 | 9.386 | 0,21 |
| 10.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 5.40%, 31/03/2025 | 10.040 | 0,23 |
| 7.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 5.48%, 22/05/2025 | 7.046 | 0,16 |
| 9.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 4.75%, 27/05/2025 | 9.022 | 0,20 |
| 10.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 5.42%, 03/07/2025 | 10.081 | 0,23 |
| 10.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 09/07/2025 | 9.679 | 0,22 |
| 9.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 10/07/2025 | 8.710 | 0,20 |
| Kanada - Gesamt | | | 316.539 | 7,22 |
| Finnland (30. September 2023: 0,25 %) | | | | |
| 8.000.000 | USD | Nordea Bank Abp, FRN, 5.08%, 28/04/2025 | 8.001 | 0,18 |
| 8.000.000 | USD | Nordea Bank Abp, 5.30%, 14/02/2025 | 8.021 | 0,19 |
| Finnland - Gesamt | | | 16.022 | 0,37 |
| Frankreich (30. September 2023: 3,82 %) | | | | |
| 10.000.000 | USD | Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 03/02/2025 | 9.840 | 0,22 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| Frankreich (Fortsetzung) | | | | |
| 14.000.000 | USD | BNP Paribas SA, FRN, 5.05%, 26/11/2024 | 14.003 | 0,32 |
| 23.000.000 | USD | BNP Paribas SA, FRN, 5.12%, 31/12/2024 | 23.010 | 0,53 |
| 10.000.000 | USD | BNP Paribas SA, 5.45%, 01/10/2024 | 10.000 | 0,23 |
| 11.000.000 | USD | BNP Paribas SA, 5.53%, 02/12/2024 | 11.013 | 0,25 |
| 10.000.000 | USD | BNP Paribas SA, 5.40%, 31/01/2025 | 10.028 | 0,23 |
| 19.000.000 | USD | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN, 5.09%, 31/10/2024 | 19.002 | 0,43 |
| 8.000.000 | USD | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN, 5.13%, 20/06/2025 | 8.001 | 0,18 |
| 9.000.000 | USD | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 5.54%, 02/12/2024 | 9.011 | 0,21 |
| 10.000.000 | USD | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 5.40%, 31/01/2025 | 10.029 | 0,23 |
| 11.000.000 | USD | Credit Agricole SA, 0.00%, 06/01/2025 | 10.862 | 0,25 |
| 7.000.000 | USD | Credit Industriel et Commercial, 5.50%, 12/05/2025 | 7.044 | 0,16 |
| 14.000.000 | USD | Natixis SA, FRN, 5.14%, 24/02/2025 | 14.003 | 0,32 |
| 8.000.000 | USD | Natixis SA, 5.43%, 31/10/2024 | 8.003 | 0,18 |
| 7.000.000 | USD | Natixis SA, 4.98%, 28/02/2025 | 7.011 | 0,16 |
| | | Frankreich - Gesamt | 170.860 | 3,90 |
| Deutschland (30. September 2023: 0,95 %) | | | | |
| 7.000.000 | USD | DG Bank, 5.47%, 16/10/2024 | 7.002 | 0,16 |
| 24.000.000 | USD | DG Bank, 4.85%, 21/10/2024 | 24.000 | 0,55 |
| | | Deutschland - Gesamt | 31.002 | 0,71 |
| Japan (30. September 2023: 5,20 %) | | | | |
| 14.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., FRN, 5.09%, 24/02/2025 | 14.003 | 0,32 |
| 9.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 28/10/2024 | 8.966 | 0,21 |
| 15.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 29/10/2024 | 14.941 | 0,34 |
| 15.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 05/11/2024 | 14.927 | 0,34 |
| 15.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 05/11/2024 | 14.927 | 0,34 |
| 8.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 20/11/2024 | 7.945 | 0,18 |
| 15.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 22/11/2024 | 14.893 | 0,34 |
| 5.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 09/12/2024 | 4.953 | 0,11 |
| 15.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., FRN, 5.08%, 01/11/2024 | 15.002 | 0,34 |
| 10.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., FRN, 5.08%, 21/03/2025 | 10.001 | 0,23 |
| 12.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 11/10/2024 | 11.982 | 0,27 |
| 5.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 28/10/2024 | 4.981 | 0,11 |
| 8.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 05/12/2024 | 7.930 | 0,18 |
| 9.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 08/01/2025 | 8.884 | 0,20 |
| 5.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 09/01/2025 | 4.935 | 0,11 |
| 9.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 5.08%, 22/01/2025 | 9.011 | 0,21 |
| 5.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 28/01/2025 | 4.924 | 0,11 |
| 12.000.000 | USD | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 04/10/2024 | 11.993 | 0,27 |
| 10.000.000 | USD | MUFG Bank Ltd., 5.42%, 18/11/2024 | 10.008 | 0,23 |
| 5.000.000 | USD | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 20/11/2024 | 4.966 | 0,11 |
| 5.000.000 | USD | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 13/01/2025 | 4.932 | 0,11 |
| 18.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN, 5.08%, 01/11/2024 | 18.002 | 0,41 |
| 12.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 5.08%, 04/10/2024 | 12.000 | 0,28 |
| 16.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 24/10/2024 | 15.948 | 0,37 |
| 5.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 06/11/2024 | 4.975 | 0,11 |
| 11.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN, 5.08%, 29/10/2024 | 11.001 | 0,25 |
| 9.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN, 5.08%, 25/03/2025 | 9.003 | 0,21 |
| 9.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN, 5.07%, 15/04/2025 | 9.001 | 0,21 |
| 11.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 16/10/2024 | 10.976 | 0,25 |
| 15.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 29/10/2024 | 14.941 | 0,34 |
| 10.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 30/10/2024 | 9.959 | 0,23 |
| 7.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 08/11/2024 | 6.963 | 0,16 |
| 5.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 13/12/2024 | 4.951 | 0,11 |
| 10.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 9.874 | 0,23 |
| 8.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 7.899 | 0,18 |
| 5.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 4.937 | 0,11 |
| 5.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 07/01/2025 | 4.937 | 0,11 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| Japan (Fortsetzung) | | | | |
| 10.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 09/01/2025 | 9.871 | 0,23 |
| 10.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 07/02/2025 | 9.836 | 0,23 |
| Japan - Gesamt | | | 380.178 | 8,68 |
| Niederlande (30. September 2023: 1,41 %) | | | | |
| 20.000.000 | USD | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 14/02/2025 | 19.654 | 0,45 |
| 10.000.000 | USD | Cooperatieve Rabobank UA, 0.00%, 30/05/2025 | 9.717 | 0,22 |
| 12.000.000 | USD | ING Bank NV, 0.00%, 06/11/2024 | 11.940 | 0,27 |
| 6.500.000 | USD | ING Bank NV, 0.00%, 22/11/2024 | 6.454 | 0,15 |
| 12.000.000 | USD | ING Bank NV, 0.00%, 02/12/2024 | 11.900 | 0,27 |
| 5.000.000 | USD | ING Bank NV, 0.00%, 02/01/2025 | 4.939 | 0,11 |
| Niederlande - Gesamt | | | 64.604 | 1,47 |
| Norwegen (30. September 2023: 0,70 %) | | | | |
| 13.000.000 | USD | DNB Bank ASA, 0.00%, 02/01/2025 | 12.844 | 0,30 |
| 10.000.000 | USD | DNB Bank ASA, 0.00%, 02/05/2025 | 9.748 | 0,22 |
| Norwegen - Gesamt | | | 22.592 | 0,52 |
| Singapur (30. September 2023: 0,21 %) | | | | |
| 10.000.000 | USD | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., FRN, 5.03%, 03/10/2024 | 10.000 | 0,23 |
| 15.000.000 | USD | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., FRN, 5.06%, 09/12/2024 | 15.003 | 0,34 |
| 12.000.000 | USD | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., FRN, 5.09%, 21/05/2025 | 12.003 | 0,27 |
| Singapur - Gesamt | | | 37.006 | 0,84 |
| Schweden (30. September 2023: 0,46 %) | | | | |
| 12.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.03%, 03/10/2024 | 12.000 | 0,27 |
| 22.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.05%, 07/11/2024 | 22.002 | 0,50 |
| 11.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.06%, 02/12/2024 | 11.003 | 0,25 |
| 14.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.10%, 05/02/2025 | 14.006 | 0,32 |
| 13.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.09%, 28/05/2025 | 13.002 | 0,30 |
| 8.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, 5.31%, 18/02/2025 | 8.024 | 0,18 |
| 13.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, 5.35%, 09/04/2025 | 13.056 | 0,30 |
| 27.000.000 | USD | Swedbank AB, FRN, 5.03%, 02/10/2024 | 27.001 | 0,62 |
| 7.000.000 | USD | Swedbank AB, 5.34%, 09/04/2025 | 7.032 | 0,16 |
| Schweden - Gesamt | | | 127.126 | 2,90 |
| Schweiz (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 3.000.000 | USD | UBS AG, 0.00%, 08/11/2024 | 2.985 | 0,07 |
| 5.000.000 | USD | UBS AG, 0.00%, 03/01/2025 | 4.939 | 0,11 |
| 15.000.000 | USD | UBS AG, 0.00%, 19/02/2025 | 14.735 | 0,34 |
| Schweiz - Gesamt | | | 22.659 | 0,52 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 2,41 %) | | | | |
| 15.500.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 18/10/2024 | 15.462 | 0,35 |
| 11.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 04/11/2024 | 10.948 | 0,25 |
| 15.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 20/11/2024 | 14.897 | 0,34 |
| 15.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 16/12/2024 | 14.847 | 0,34 |
| 17.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 03/03/2025 | 16.671 | 0,38 |
| 5.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 20/03/2025 | 4.894 | 0,11 |
| 5.000.000 | USD | NatWest Markets plc, 0.00%, 22/01/2025 | 4.927 | 0,11 |
| 12.000.000 | USD | Standard Chartered Bank, FRN, 5.09%, 12/11/2024 | 12.002 | 0,28 |
| 19.000.000 | USD | Standard Chartered Bank, FRN, 5.14%, 02/01/2025 | 19.009 | 0,43 |
| 10.000.000 | USD | Standard Chartered Bank, 0.00%, 21/11/2024 | 9.932 | 0,23 |
| Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | 123.589 | 2,82 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Einlagezertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 2,74 %) | | | | |
| 20.000.000 | USD | Bank of America NA, 5.15%, 22/01/2025 | 20.025 | 0,46 |
| 8.000.000 | USD | Bank of America NA, 5.37%, 09/04/2025 | 8.035 | 0,18 |
| 5.000.000 | USD | Bank of America NA, 5.50%, 10/04/2025 | 5.024 | 0,11 |
| 7.000.000 | USD | Bank of America NA, 5.28%, 15/04/2025 | 7.029 | 0,16 |
| 6.000.000 | USD | Bank of America NA, 5.50%, 24/04/2025 | 6.032 | 0,14 |
| 7.000.000 | USD | Citibank NA, FRN, 5.10%, 20/06/2025 | 7.000 | 0,16 |
| Vereinigte Staaten - Gesamt | | | 53.145 | 1,21 |
| Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt | | | 1.478.931 | 33,75 |
| Commercial Papers (30. September 2023: 40,19 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 5,69 %) | | | | |
| 12.000.000 | USD | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 5.04%, 08/10/2024 | 12.000 | 0,27 |
| 15.000.000 | USD | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 02/01/2025 | 14.816 | 0,34 |
| 10.000.000 | USD | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 14/01/2025 | 9.867 | 0,23 |
| 10.000.000 | USD | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 5.10%, 22/04/2025 | 10.003 | 0,23 |
| 9.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 5.16%, 07/11/2024 | 9.001 | 0,21 |
| 3.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 5.18%, 13/11/2024 | 3.000 | 0,07 |
| 5.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 5.19%, 18/11/2024 | 5.001 | 0,11 |
| 5.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 08/01/2025 | 4.937 | 0,11 |
| 18.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 5.08%, 05/11/2024 | 18.003 | 0,41 |
| 11.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 5.05%, 07/11/2024 | 11.002 | 0,25 |
| 11.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 5.08%, 13/12/2024 | 11.003 | 0,25 |
| 12.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 17/01/2025 | 11.833 | 0,27 |
| 8.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 5.10%, 07/03/2025 | 8.001 | 0,18 |
| 32.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 5.05%, 15/10/2024 | 32.002 | 0,73 |
| 15.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 5.08%, 12/11/2024 | 15.002 | 0,34 |
| 9.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 5.09%, 24/02/2025 | 9.003 | 0,21 |
| 9.000.000 | USD | Queensland Treasury Corp., 0.00%, 03/02/2025 | 8.860 | 0,20 |
| 11.000.000 | USD | Toyota Finance Australia Ltd., 0.00%, 12/11/2024 | 10.937 | 0,25 |
| 15.000.000 | USD | Westpac Banking Corp., 0.00%, 14/11/2024 | 14.911 | 0,34 |
| 5.000.000 | USD | Westpac Banking Corp., 5.09%, 25/03/2025 | 5.002 | 0,12 |
| Australien - Gesamt | | | 224.184 | 5,12 |
| Österreich (30. September 2023: 0,73 %) | | | - | - |
| Kanada (30. September 2023: 2,10 %) | | | | |
| 12.000.000 | USD | Bank of Montreal, 5.26%, 17/06/2025 | 12.002 | 0,27 |
| 8.000.000 | USD | Bank of Montreal, 5.34%, 11/09/2025 | 8.001 | 0,18 |
| 5.000.000 | USD | CDP Financial, Inc., 0.00%, 07/02/2025 | 4.917 | 0,11 |
| 6.000.000 | USD | CDP Financial, Inc., 0.00%, 29/04/2025 | 5.847 | 0,13 |
| 7.000.000 | USD | Export Development Canada, 0.00%, 10/01/2025 | 6.909 | 0,16 |
| 12.000.000 | USD | National Bank of Canada, 0.00%, 23/10/2024 | 11.963 | 0,27 |
| 14.000.000 | USD | Province of Quebec Canada, 0.00%, 18/10/2024 | 13.966 | 0,32 |
| 10.000.000 | USD | Royal Bank of Canada, 0.00%, 06/11/2024 | 9.951 | 0,23 |
| 12.000.000 | USD | Royal Bank of Canada, 5.19%, 21/01/2025 | 12.007 | 0,28 |
| 15.000.000 | USD | Royal Bank of Canada, 5.09%, 18/02/2025 | 15.004 | 0,34 |
| Kanada - Gesamt | | | 100.567 | 2,29 |
| Finnland (30. September 2023: 1,91 %) | | | | |
| 5.000.000 | USD | Kuntarahoitus OYJ, 0.00%, 03/10/2024 | 4.998 | 0,11 |
| 10.000.000 | USD | Kuntarahoitus OYJ, 0.00%, 14/01/2025 | 9.867 | 0,23 |
| Finnland - Gesamt | | | 14.865 | 0,34 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Frankreich (30. September 2023: 10,02 %) | | | | |
| 10.000.000 | USD | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 02/10/2024 | 9.997 | 0,23 |
| 15.000.000 | USD | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 17/01/2025 | 14.791 | 0,34 |
| 10.000.000 | USD | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 22/01/2025 | 9.855 | 0,23 |
| 10.000.000 | USD | Agence Francaise De Developpement Principal, 0.00%, 27/01/2025 | 9.850 | 0,23 |
| 13.000.000 | USD | BPCE SA, 0.00%, 28/10/2024 | 12.951 | 0,30 |
| 15.000.000 | USD | BPCE SA, 5.09%, 05/11/2024 | 15.002 | 0,34 |
| 9.000.000 | USD | BPCE SA, 0.00%, 09/12/2024 | 8.918 | 0,20 |
| 5.000.000 | USD | BPCE SA, 5.09%, 09/12/2024 | 5.001 | 0,11 |
| 25.000.000 | USD | BRED Banque Populaire, 0.00%, 01/10/2024 | 24.997 | 0,57 |
| 25.000.000 | USD | BRED Banque Populaire, 0.00%, 02/10/2024 | 24.997 | 0,57 |
| 8.000.000 | USD | BRED Banque Populaire, 0.00%, 03/01/2025 | 7.904 | 0,18 |
| 46.000.000 | USD | Caisse d'amortissement de la dette sociale, 0.00%, 15/10/2024 | 45.908 | 1,05 |
| 25.000.000 | USD | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.00%, 17/10/2024 | 24.943 | 0,57 |
| 18.000.000 | USD | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.00%, 10/02/2025 | 17.699 | 0,40 |
| 23.000.000 | USD | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.00%, 27/02/2025 | 22.570 | 0,52 |
| 5.000.000 | USD | Caisse des Depots et Consignations, 0.00%, 31/10/2024 | 4.979 | 0,11 |
| 27.000.000 | USD | Caisse des Depots et Consignations, 0.00%, 06/11/2024 | 26.867 | 0,61 |
| 12.000.000 | USD | Caisse des Depots et Consignations, 0.00%, 08/11/2024 | 11.938 | 0,27 |
| 5.000.000 | USD | Eurotitrisation - SAT Magenta, 0.00%, 18/10/2024 | 4.988 | 0,11 |
| 10.000.000 | USD | Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST SA, 0.00%, 02/12/2024 | 9.918 | 0,23 |
| 5.000.000 | USD | Satellite, 0.00%, 21/10/2024 | 4.986 | 0,11 |
| 10.000.000 | USD | Satellite SASU, 0.00%, 23/10/2024 | 9.968 | 0,23 |
| 1.000.000 | USD | Satellite SASU, 0.00%, 24/10/2024 | 997 | 0,02 |
| | | Frankreich - Gesamt | 330.024 | 7,53 |
| Deutschland (30. September 2023: 4,33 %) | | | | |
| 10.000.000 | USD | Deutsche Bank AG, 0.00%, 12/12/2024 | 9.905 | 0,23 |
| 10.000.000 | USD | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.00%, 01/11/2024 | 9.958 | 0,23 |
| 15.000.000 | USD | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.00%, 03/01/2025 | 14.820 | 0,34 |
| 10.000.000 | USD | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.00%, 03/01/2025 | 9.880 | 0,23 |
| 5.000.000 | USD | Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 0.00%, 21/10/2024 | 4.986 | 0,11 |
| 4.000.000 | USD | NRW. Bank, 0.00%, 07/10/2024 | 3.996 | 0,09 |
| 10.000.000 | USD | NRW. Bank, 0.00%, 08/10/2024 | 9.989 | 0,23 |
| 12.000.000 | USD | NRW. Bank, 0.00%, 04/11/2024 | 11.945 | 0,27 |
| 24.000.000 | USD | NRW. Bank, 0.00%, 10/12/2024 | 23.779 | 0,54 |
| 15.000.000 | USD | NRW. Bank, 0.00%, 22/04/2025 | 14.635 | 0,33 |
| | | Deutschland - Gesamt | 113.893 | 2,60 |
| | | Irland (30. September 2023: 0,25 %) | - | - |
| | | Luxemburg (30. September 2023: 2,03 %) | | |
| 20.000.000 | USD | DZ Privatbank SA, 0.00%, 02/10/2024 | 19.995 | 0,46 |
| | | Luxemburg - Gesamt | 19.995 | 0,46 |
| | | Niederlande (30. September 2023: 1,54 %) | | |
| 19.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 02/10/2024 | 18.995 | 0,43 |
| 20.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 03/10/2024 | 19.992 | 0,46 |
| 17.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 04/10/2024 | 16.991 | 0,39 |
| 12.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 21/10/2024 | 11.967 | 0,27 |
| 10.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 31/10/2024 | 9.958 | 0,23 |
| 10.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 31/10/2024 | 9.958 | 0,23 |
| 14.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 06/01/2025 | 13.826 | 0,32 |
| 87.000.000 | USD | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 11/10/2024 | 86.872 | 1,98 |
| 27.000.000 | USD | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 21/10/2024 | 26.924 | 0,61 |
| 5.000.000 | USD | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 21/10/2024 | 4.986 | 0,11 |
| 5.000.000 | USD | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 21/10/2024 | 4.986 | 0,11 |
| | | Niederlande - Gesamt | 225.455 | 5,14 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Neuseeland (30. September 2023: 0,20 %) | | | | |
| 8.000.000 | USD | New Zealand (Government of), 0.00%, 22/11/2024 | 7.945 | 0,18 |
| 10.000.000 | USD | New Zealand (Government of), 0.00%, 18/12/2024 | 9.899 | 0,23 |
| 12.000.000 | USD | New Zealand (Government of), 0.00%, 06/01/2025 | 11.852 | 0,27 |
| 15.000.000 | USD | New Zealand Local Government Funding Agency Ltd., 0.00%, 20/11/2024 | 14.895 | 0,34 |
| 4.000.000 | USD | New Zealand Local Government Funding Agency Ltd., 0.00%, 10/12/2024 | 3.962 | 0,09 |
| Neuseeland - Gesamt | | | 48.553 | 1,11 |
| Norwegen (30. September 2023: 0,63 %) | | | | |
| 7.500.000 | USD | Kommunalbanken A/S, 0.00%, 28/10/2024 | 7.471 | 0,17 |
| Norwegen - Gesamt | | | 7.471 | 0,17 |
| Singapur (30. September 2023: 0,73 %) | | | | |
| 10.000.000 | USD | DBS Bank Ltd., 0.00%, 21/10/2024 | 9.972 | 0,23 |
| 10.000.000 | USD | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 25/10/2024 | 9.967 | 0,22 |
| 10.000.000 | USD | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 5.12%, 05/11/2024 | 10.000 | 0,23 |
| 10.000.000 | USD | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 5.15%, 02/12/2024 | 10.001 | 0,23 |
| Singapur - Gesamt | | | 39.940 | 0,91 |
| Supranational (30. September 2023: 3,09 %) | | | | |
| 10.000.000 | USD | Council of Europe Development Bank, 0.00%, 01/11/2024 | 9.958 | 0,23 |
| 18.000.000 | USD | European Investment Bank, 0.00%, 06/11/2024 | 17.916 | 0,41 |
| 15.000.000 | USD | European Investment Bank, 0.00%, 14/04/2025 | 14.653 | 0,33 |
| Supranational - Gesamt | | | 42.527 | 0,97 |
| Schweden (30. September 2023: 0,98 %) | | | | |
| 8.000.000 | USD | Kommuninvest i Sverige AB, 0.00%, 12/02/2025 | 7.863 | 0,18 |
| 5.000.000 | USD | Kommuninvest i Sverige AB, 0.00%, 03/03/2025 | 4.903 | 0,11 |
| 15.000.000 | USD | Skandinaviska Enskilda Banken AB, 5.03%, 01/10/2024 | 15.000 | 0,34 |
| 5.000.000 | USD | Skandinaviska Enskilda Banken AB, 5.04%, 20/12/2024 | 5.001 | 0,11 |
| 9.000.000 | USD | Swedbank AB, 5.07%, 02/12/2024 | 9.002 | 0,21 |
| 10.000.000 | USD | Swedbank AB, 5.07%, 09/12/2024 | 10.002 | 0,23 |
| 15.000.000 | USD | Swedbank AB, 5.04%, 17/03/2025 | 15.002 | 0,34 |
| Schweden - Gesamt | | | 66.773 | 1,52 |
| Schweiz (30. September 2023: 0,76 %) | | | | |
| 15.000.000 | USD | UBS AG, 5.07%, 26/11/2024 | 15.003 | 0,34 |
| 15.000.000 | USD | UBS AG, 5.19%, 02/01/2025 | 14.999 | 0,34 |
| 10.000.000 | USD | UBS AG, 5.20%, 03/01/2025 | 10.000 | 0,23 |
| 10.000.000 | USD | UBS AG, 5.12%, 26/03/2025 | 10.004 | 0,23 |
| Schweiz - Gesamt | | | 50.006 | 1,14 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 2,02 %) | | | | |
| 14.000.000 | USD | Bank of England, 0.00%, 15/01/2025 | 13.812 | 0,31 |
| 15.000.000 | USD | HSBC Bank plc, 5.06%, 16/10/2024 | 15.001 | 0,34 |
| 20.000.000 | USD | HSBC Bank plc, 5.06%, 04/11/2024 | 20.002 | 0,46 |
| 10.000.000 | USD | HSBC Bank plc, 5.04%, 06/12/2024 | 10.001 | 0,23 |
| 60.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 07/10/2024 | 59.919 | 1,37 |
| 11.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 10/10/2024 | 10.981 | 0,25 |
| 35.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 23/10/2024 | 34.877 | 0,80 |
| 5.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 23/10/2024 | 4.983 | 0,11 |
| Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | 169.576 | 3,87 |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 3,18 %) | | | | |
| 17.000.000 | USD | Alinghi Funding Co. LLC, 0.00%, 04/10/2024 | 16.991 | 0,39 |
| 19.000.000 | USD | Aquitaine Funding Co. LLC, 0.00%, 02/10/2024 | 18.995 | 0,43 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Vereinigte Staaten (Fortsetzung) | | | | |
| 7.000.000 | USD | Aquitaine Funding Co. LLC, 0.00%, 17/10/2024 | 6.941 | 0,16 |
| 15.000.000 | USD | Aquitaine Funding Co. LLC, 0.00%, 01/11/2024 | 14.934 | 0,34 |
| 12.000.000 | USD | Britannia Funding Co. LLC, 0.00%, 19/11/2024 | 11.920 | 0,27 |
| 8.000.000 | USD | Cisco Systems, Inc., 0.00%, 04/11/2024 | 7.963 | 0,18 |
| 15.000.000 | USD | Citigroup Global Markets, Inc., 0.00%, 24/10/2024 | 14.951 | 0,34 |
| 13.000.000 | USD | Endeavour Fdg Co Llc Corporate Commercial Paper, 0.00%, 01/11/2024 | 12.944 | 0,30 |
| 10.000.000 | USD | Gotham Funding Corp., 0.00%, 14/11/2024 | 9.940 | 0,23 |
| 13.000.000 | USD | ING (U.S.) Funding LLC, 5.04%, 24/10/2024 | 13.001 | 0,30 |
| 1.000.000 | USD | ING (U.S.) Funding LLC, 5.08%, 12/11/2024 | 1.000 | 0,02 |
| 20.000.000 | USD | J.P. Morgan Securities LLC, 5.16%, 06/01/2025 | 20.002 | 0,46 |
| 23.500.000 | USD | Liberty Street Funding LLC, 0.00%, 05/12/2024 | 23.296 | 0,53 |
| | | Vereinigte Staaten - Gesamt | 172.878 | 3,95 |
| Anlagen in Commercial Papers - Gesamt | | | 1.626.707 | 37,12 |

Termineinlagen (30. September 2023: 7,91 %)

| | | | | |
|--|-----|--|----------------|-------------|
| Kanada (30. September 2023: 4,38 %) | | | | |
| 60.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, 4.82%, 01/10/2024 | 60.000 | 1,37 |
| 100.000.000 | USD | Royal Bank of Canada, 4.83%, 01/10/2024 | 100.000 | 2,28 |
| | | Kanada - Gesamt | 160.000 | 3,65 |
| Frankreich (30. September 2023: 0,08 %) | | | | |
| 36.000.000 | USD | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 4.82%, 01/10/2024 | 36.000 | 0,82 |
| | | Frankreich - Gesamt | 36.000 | 0,82 |
| Japan (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 50.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 4.83%, 01/10/2024 | 50.000 | 1,14 |
| | | Japan - Gesamt | 50.000 | 1,14 |
| Schweden (30. September 2023: 3,45 %) | | | | |
| 119.000.000 | USD | Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.83%, 01/10/2024 | 119.000 | 2,72 |
| 70.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, 4.82%, 01/10/2024 | 70.000 | 1,60 |
| | | Schweden - Gesamt | 189.000 | 4,32 |
| Anlagen in Termineinlagen - Gesamt | | | 435.000 | 9,93 |

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---------|---------|---------------|----------------------|-------------------------------|
|---------|---------|---------------|----------------------|-------------------------------|

ANLEIHEN

Staatsanleihen (30. September 2023: 1,12 %)

| | | | | |
|--|-----|--|--------|------|
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 1,12 %) | | | | |
| 4.460.400 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 21/11/2024 ¹ | 4.431 | 0,10 |
| 7.000.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 03/12/2024 ¹ | 6.945 | 0,16 |
| 24.000.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 17/12/2024 ¹ | 23.770 | 0,54 |
| 9.000.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 23/01/2025 ¹ | 8.874 | 0,20 |
| 13.500.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 27/02/2025 ¹ | 13.259 | 0,31 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts | |
|---|---------|--|-----------|------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| ANLEIHEN (Fortsetzung) | | | | | | |
| Staatsanleihen (Fortsetzung) | | | | | | |
| | | Vereinigte Staaten (Fortsetzung) | | | | |
| 9.000.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 27/03/2025 ¹ | | 8.811 | 0,20 | |
| | | Vereinigte Staaten - Gesamt | | 66.090 | 1,51 | |
| Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt | | | | 66.090 | 1,51 | |
| Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2023: 1,15 %) | | | | | | |
| | | Luxemburg (30. September 2023: 0,64 %) | | | | |
| 25.000.000 | USD | SG Issuer SA, 5.05%, 04/10/2024 ² | | 25.000 | 0,57 | |
| | | Luxemburg - Gesamt | | 25.000 | 0,57 | |
| | | Niederlande (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 20.000.000 | USD | BNG Bank NV, 5.15%, 28/02/2025 | | 20.014 | 0,46 | |
| | | Niederlande - Gesamt | | 20.014 | 0,46 | |
| | | Vereinigte Staaten (30. September 2023: 0,51 %) | | - | - | |
| Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt | | | | 45.014 | 1,03 | |
| Anlagen in Anleihen - Gesamt | | | | 111.104 | 2,54 | |
| Bestand | Währung | Kontrahent | Zinssätze | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
| Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2023: 25,70 %) | | | | | | |
| Frankreich (30. September 2023: 3,09 %) | | | | | | |
| 15.000.000 | USD | BNP Paribas SA | 4,87 % | 01.10.2024 | 15.000 | 0,34 |
| | | Frankreich - Gesamt | | | 15.000 | 0,34 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 0,00 %) | | | | | | |
| 225.000.000 | USD | Citigroup Global Markets, Inc. | 4,89 % | 01.10.2024 | 225.000 | 5,13 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | 225.000 | 5,13 |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 22,61 %) | | | | | | |
| 205.000.000 | USD | Bofa Securities Inc. | 4,88 % | 01.10.2024 | 205.000 | 4,68 |
| 170.000.000 | USD | J.P. Morgan Securities LLC | 4,90 % | 01.10.2024 | 170.000 | 3,88 |
| | | Vereinigte Staaten - Gesamt | | | 375.000 | 8,56 |
| Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt | | | | | 615.000 | 14,03 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|----------------------|--|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt | 4.266.742 | 97,37 |
| Zahlungsmittel | 140.891 | 3,22 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | (25.435) | (0,59) |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert | 4.382.198 | 100,00 |
| | | % des Gesamt- vermögens |
| Analyse des Gesamtvermögens | | |
| Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | 0,65 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | | 15,77 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c) | | 80,07 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 3,51 |
| Gesamtvermögen | | 100,00 |

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

² Nullkupon-Anleihe.

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Einlagezertifikate (30. September 2023: 30,57 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 0,85 %) | | | | |
| 85.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 05/12/2024 | 84.193 | 0,10 |
| 138.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 02/01/2025 | 136.146 | 0,17 |
| 280.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 12/03/2025 | 273.482 | 0,33 |
| 260.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 21/03/2025 | 254.564 | 0,31 |
| 265.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 07/04/2025 | 257.887 | 0,32 |
| 259.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 01/10/2024 | 259.000 | 0,32 |
| 225.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 20/12/2024 | 222.339 | 0,27 |
| 125.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 02/01/2025 | 123.340 | 0,15 |
| 115.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 07/02/2025 | 112.918 | 0,14 |
| 120.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 04/04/2025 | 116.878 | 0,14 |
| 200.000.000 | USD | Westpac Banking Corp., FRN, 5.11%, 12/05/2025 | 200.000 | 0,25 |
| Australien - Gesamt | | | 2.040.747 | 2,50 |
| Belgien (30. September 2023: 0,88 %) | | | | |
| 195.000.000 | USD | Euroclear Bank SA, 0.00%, 18/10/2024 | 194.514 | 0,24 |
| 80.000.000 | USD | Euroclear Bank SA, 0.00%, 31/10/2024 | 79.665 | 0,10 |
| 200.000.000 | USD | KBC Bank NV, 5.49%, 18/10/2024 | 200.000 | 0,24 |
| 30.000.000 | USD | KBC Bank NV, 0.00%, 18/12/2024 | 29.662 | 0,04 |
| 360.000.000 | USD | KBC Bank NV, 0.00%, 13/01/2025 | 354.908 | 0,43 |
| Belgien - Gesamt | | | 858.749 | 1,05 |
| Kanada (30. September 2023: 5,91 %) | | | | |
| 187.000.000 | USD | Bank of Montreal, FRN, 5.10%, 11/02/2025 | 187.000 | 0,23 |
| 128.000.000 | USD | Bank of Montreal, FRN, 5.24%, 24/10/2025 | 128.000 | 0,16 |
| 175.000.000 | USD | Bank of Montreal, 5.80%, 12/11/2024 | 175.000 | 0,21 |
| 157.000.000 | USD | Bank of Montreal, 5.60%, 29/11/2024 | 157.000 | 0,19 |
| 130.000.000 | USD | Bank of Montreal, 5.50%, 06/12/2024 | 130.000 | 0,16 |
| 20.950.000 | USD | Bank of Montreal, 5.50%, 09/12/2024 | 20.950 | 0,03 |
| 213.000.000 | USD | Bank of Montreal, 0.00%, 09/01/2025 | 210.048 | 0,26 |
| 35.000.000 | USD | Bank of Montreal, 0.00%, 27/01/2025 | 34.407 | 0,04 |
| 186.000.000 | USD | Bank of Montreal, 0.00%, 05/03/2025 | 181.742 | 0,22 |
| 170.000.000 | USD | Bank of Montreal, 0.00%, 04/04/2025 | 165.512 | 0,20 |
| 93.000.000 | USD | Bank of Montreal, 5.53%, 27/05/2025 | 93.000 | 0,11 |
| 100.000.000 | USD | Bank of Montreal, 5.50%, 11/06/2025 | 100.000 | 0,12 |
| 63.000.000 | USD | Bank of Montreal, 0.00%, 28/07/2025 | 60.431 | 0,07 |
| 167.000.000 | USD | Bank of Nova Scotia (The), FRN, 5.14%, 21/02/2025 | 167.000 | 0,21 |
| 160.000.000 | USD | Bank of Nova Scotia (The), 5.80%, 08/11/2024 | 160.000 | 0,20 |
| 160.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.10%, 20/02/2025 | 160.000 | 0,20 |
| 195.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.10%, 04/03/2025 | 195.000 | 0,24 |
| 205.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.10%, 01/04/2025 | 205.000 | 0,25 |
| 266.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.10%, 04/06/2025 | 266.000 | 0,33 |
| 200.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.19%, 23/09/2025 | 200.000 | 0,25 |
| 190.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.80%, 08/11/2024 | 190.000 | 0,23 |
| 100.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.50%, 23/05/2025 | 100.000 | 0,12 |
| 100.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.45%, 05/06/2025 | 100.000 | 0,12 |
| 185.000.000 | USD | Royal Bank of Canada, FRN, 5.11%, 06/02/2025 | 185.000 | 0,23 |
| 150.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 5.09%, 21/02/2025 | 150.000 | 0,18 |
| 175.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 5.18%, 22/09/2025 | 175.000 | 0,21 |
| 179.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 5.80%, 07/11/2024 | 179.000 | 0,22 |
| 167.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 5.15%, 31/12/2024 | 167.000 | 0,20 |
| 265.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 02/01/2025 | 261.588 | 0,32 |
| 170.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 02/01/2025 | 167.758 | 0,21 |
| 140.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 5.40%, 31/03/2025 | 140.000 | 0,17 |
| 115.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 5.48%, 22/05/2025 | 115.000 | 0,14 |
| 170.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 4.75%, 27/05/2025 | 170.000 | 0,21 |
| 220.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 5.42%, 03/07/2025 | 220.000 | 0,27 |
| 155.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 09/07/2025 | 149.011 | 0,18 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| Kanada (Fortsetzung) | | | | |
| 110.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 10/07/2025 | 105.736 | 0,13 |
| | | Kanada - Gesamt | 5.571.183 | 6,82 |
| Finnland (30. September 2023: 0,35 %) | | | | |
| 142.000.000 | USD | Nordea Bank Abp, FRN, 5.08%, 28/04/2025 | 142.000 | 0,17 |
| 145.000.000 | USD | Nordea Bank Abp, 5.30%, 14/02/2025 | 145.000 | 0,18 |
| | | Finnland - Gesamt | 287.000 | 0,35 |
| Frankreich (30. September 2023: 4,63 %) | | | | |
| 173.000.000 | USD | Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 03/02/2025 | 169.877 | 0,21 |
| 210.000.000 | USD | BNP Paribas SA, FRN, 5.05%, 26/11/2024 | 210.000 | 0,26 |
| 348.000.000 | USD | BNP Paribas SA, FRN, 5.12%, 31/12/2024 | 348.000 | 0,42 |
| 232.000.000 | USD | BNP Paribas SA, FRN, 5.11%, 13/06/2025 | 232.000 | 0,28 |
| 163.000.000 | USD | BNP Paribas SA, 5.45%, 01/10/2024 | 163.000 | 0,20 |
| 185.000.000 | USD | BNP Paribas SA, 5.53%, 02/12/2024 | 185.000 | 0,23 |
| 210.000.000 | USD | BNP Paribas SA, 5.40%, 31/01/2025 | 210.000 | 0,26 |
| 278.000.000 | USD | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN, 5.09%, 31/10/2024 | 278.000 | 0,34 |
| 250.000.000 | USD | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN, 5.13%, 20/06/2025 | 250.000 | 0,31 |
| 139.000.000 | USD | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 5.54%, 02/12/2024 | 139.000 | 0,17 |
| 197.000.000 | USD | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 5.40%, 31/01/2025 | 197.000 | 0,24 |
| 95.000.000 | USD | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 5.50%, 23/05/2025 | 95.000 | 0,12 |
| 170.000.000 | USD | Credit Agricole SA, 0.00%, 06/01/2025 | 167.606 | 0,20 |
| 111.000.000 | USD | Credit Industriel et Commercial, 5.50%, 12/05/2025 | 111.000 | 0,14 |
| 267.000.000 | USD | Natixis SA, FRN, 5.14%, 24/02/2025 | 267.041 | 0,33 |
| 200.000.000 | USD | Natixis SA, FRN, 5.13%, 20/06/2025 | 200.000 | 0,24 |
| 159.000.000 | USD | Natixis SA, 5.43%, 31/10/2024 | 159.000 | 0,19 |
| 130.000.000 | USD | Natixis SA, 4.98%, 28/02/2025 | 130.000 | 0,16 |
| | | Frankreich - Gesamt | 3.511.524 | 4,30 |
| Deutschland (30. September 2023: 0,52 %) | | | | |
| 120.000.000 | USD | DG Bank, 5.47%, 16/10/2024 | 120.000 | 0,15 |
| 451.000.000 | USD | DG Bank, 4.85%, 21/10/2024 | 451.000 | 0,55 |
| 50.000.000 | USD | UBS Europe SE, 0.00%, 12/03/2025 | 48.808 | 0,06 |
| | | Deutschland - Gesamt | 619.808 | 0,76 |
| Japan (30. September 2023: 7,60 %) | | | | |
| 240.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., FRN, 5.09%, 24/02/2025 | 240.000 | 0,29 |
| 90.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 28/10/2024 | 89.636 | 0,11 |
| 116.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 29/10/2024 | 115.516 | 0,14 |
| 230.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 05/11/2024 | 228.803 | 0,28 |
| 135.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 05/11/2024 | 134.301 | 0,16 |
| 196.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 13/11/2024 | 194.773 | 0,24 |
| 139.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 20/11/2024 | 137.990 | 0,17 |
| 105.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 22/11/2024 | 104.205 | 0,13 |
| 120.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 09/12/2024 | 118.817 | 0,15 |
| 100.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 14/01/2025 | 98.564 | 0,12 |
| 74.000.000 | USD | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 14/01/2025 | 72.937 | 0,09 |
| 200.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., FRN, 5.08%, 01/11/2024 | 200.000 | 0,25 |
| 128.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., FRN, 5.08%, 21/03/2025 | 128.000 | 0,16 |
| 187.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 11/10/2024 | 186.721 | 0,23 |
| 100.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 22/10/2024 | 99.683 | 0,12 |
| 98.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 24/10/2024 | 97.660 | 0,12 |
| 190.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 28/10/2024 | 189.254 | 0,23 |
| 50.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 12/11/2024 | 49.714 | 0,06 |
| 90.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 05/12/2024 | 89.142 | 0,11 |
| 96.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 16/12/2024 | 94.955 | 0,12 |
| 100.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 08/01/2025 | 98.598 | 0,12 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| Japan (Fortsetzung) | | | | |
| 70.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 08/01/2025 | 69.019 | 0,08 |
| 87.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 09/01/2025 | 85.791 | 0,11 |
| 100.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 13/01/2025 | 98.585 | 0,12 |
| 155.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 5.08%, 22/01/2025 | 155.000 | 0,19 |
| 94.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 28/01/2025 | 92.551 | 0,11 |
| 190.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 03/02/2025 | 186.802 | 0,23 |
| 1.000.000.000 | USD | MUFG Bank Ltd., 4.85%, 01/10/2024 | 1.000.000 | 1,22 |
| 200.000.000 | USD | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 02/10/2024 | 199.970 | 0,24 |
| 188.000.000 | USD | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 04/10/2024 | 187.915 | 0,23 |
| 136.000.000 | USD | MUFG Bank Ltd., 5.44%, 28/10/2024 | 136.000 | 0,17 |
| 138.000.000 | USD | MUFG Bank Ltd., 5.42%, 18/11/2024 | 138.000 | 0,17 |
| 145.000.000 | USD | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 20/11/2024 | 143.996 | 0,18 |
| 285.000.000 | USD | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 13/01/2025 | 280.952 | 0,34 |
| 140.000.000 | USD | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 14/01/2025 | 137.805 | 0,17 |
| 279.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN, 5.08%, 01/11/2024 | 279.000 | 0,34 |
| 100.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN, 5.09%, 06/11/2024 | 100.000 | 0,12 |
| 186.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 5.08%, 04/10/2024 | 186.000 | 0,23 |
| 180.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 24/10/2024 | 179.378 | 0,22 |
| 127.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 06/11/2024 | 126.338 | 0,15 |
| 195.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 18/11/2024 | 193.693 | 0,24 |
| 147.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 25/11/2024 | 145.787 | 0,18 |
| 100.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 25/11/2024 | 99.253 | 0,12 |
| 48.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 25/11/2024 | 47.605 | 0,06 |
| 100.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 06/01/2025 | 98.729 | 0,12 |
| 161.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN, 5.08%, 29/10/2024 | 161.000 | 0,20 |
| 139.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN, 5.08%, 25/03/2025 | 139.000 | 0,17 |
| 177.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN, 5.07%, 15/04/2025 | 177.000 | 0,22 |
| 150.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 03/10/2024 | 149.955 | 0,18 |
| 100.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.45%, 07/10/2024 | 100.000 | 0,12 |
| 87.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.45%, 08/10/2024 | 87.000 | 0,11 |
| 198.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 15/10/2024 | 197.596 | 0,24 |
| 185.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 16/10/2024 | 184.592 | 0,23 |
| 53.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 29/10/2024 | 52.777 | 0,06 |
| 188.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 30/10/2024 | 187.246 | 0,23 |
| 132.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 08/11/2024 | 131.244 | 0,16 |
| 190.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 15/11/2024 | 188.713 | 0,23 |
| 90.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 13/12/2024 | 89.081 | 0,11 |
| 135.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 133.215 | 0,16 |
| 130.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 128.189 | 0,16 |
| 110.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 108.463 | 0,13 |
| 94.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 07/01/2025 | 92.793 | 0,11 |
| 190.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 09/01/2025 | 187.323 | 0,23 |
| 125.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 07/02/2025 | 122.781 | 0,15 |
| Japan - Gesamt | | | 9.755.406 | 11,94 |
| Niederlande (30. September 2023: 2,22 %) | | | | |
| 323.000.000 | USD | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 14/02/2025 | 316.752 | 0,39 |
| 151.000.000 | USD | Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 5.09%, 08/04/2025 | 151.000 | 0,18 |
| 82.000.000 | USD | Cooperatieve Rabobank UA, 0.00%, 08/11/2024 | 81.559 | 0,10 |
| 44.000.000 | USD | Cooperatieve Rabobank UA, 0.00%, 13/02/2025 | 43.166 | 0,05 |
| 198.000.000 | USD | Cooperatieve Rabobank UA, 0.00%, 30/05/2025 | 191.034 | 0,23 |
| 186.000.000 | USD | ING Bank NV, 0.00%, 06/11/2024 | 185.023 | 0,23 |
| 117.000.000 | USD | ING Bank NV, 0.00%, 22/11/2024 | 116.127 | 0,14 |
| 136.000.000 | USD | ING Bank NV, 0.00%, 02/12/2024 | 134.774 | 0,17 |
| 234.000.000 | USD | ING Bank NV, 0.00%, 02/01/2025 | 230.802 | 0,28 |
| Niederlande - Gesamt | | | 1.450.237 | 1,77 |
| Norwegen (30. September 2023: 0,65 %) | | | | |
| 210.000.000 | USD | DNB Bank ASA, 0.00%, 02/01/2025 | 207.364 | 0,25 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Einlagezertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| Norwegen (Fortsetzung) | | | | |
| 115.000.000 | USD | DNB Bank ASA, 0.00%, 02/05/2025 | 111.647 | 0,14 |
| | | Norwegen - Gesamt | 319.011 | 0,39 |
| Singapur (30. September 2023: 0,29 %) | | | | |
| 200.000.000 | USD | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., FRN, 5.01%, 01/10/2024 | 200.000 | 0,24 |
| 248.000.000 | USD | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., FRN, 5.03%, 03/10/2024 | 248.000 | 0,30 |
| 241.000.000 | USD | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., FRN, 5.06%, 09/12/2024 | 241.000 | 0,30 |
| 186.000.000 | USD | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., FRN, 5.09%, 21/05/2025 | 186.000 | 0,23 |
| | | Singapur - Gesamt | 875.000 | 1,07 |
| Südkorea (30. September 2023: 0,29 %) | | | | |
| 30.000.000 | USD | KEB Hana Bank, 0.00%, 07/10/2024 | 29.973 | 0,04 |
| 20.000.000 | USD | KEB Hana Bank, 0.00%, 07/10/2024 | 19.981 | 0,02 |
| 20.000.000 | USD | KEB Hana Bank, 0.00%, 09/10/2024 | 19.976 | 0,02 |
| 30.000.000 | USD | KEB Hana Bank, 0.00%, 22/10/2024 | 29.905 | 0,04 |
| 98.000.000 | USD | Korea Development Bank (The), 0.00%, 08/10/2024 | 97.897 | 0,12 |
| | | Südkorea - Gesamt | 197.732 | 0,24 |
| Schweden (30. September 2023: 0,88 %) | | | | |
| 200.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.03%, 03/10/2024 | 200.000 | 0,25 |
| 349.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.05%, 07/11/2024 | 349.000 | 0,43 |
| 162.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.06%, 02/12/2024 | 162.000 | 0,20 |
| 91.450.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.10%, 17/01/2025 | 91.450 | 0,11 |
| 202.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.10%, 05/02/2025 | 202.000 | 0,25 |
| 200.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.04%, 14/03/2025 | 199.999 | 0,25 |
| 245.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.09%, 28/05/2025 | 245.000 | 0,30 |
| 100.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.08%, 11/06/2025 | 100.000 | 0,12 |
| 158.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, 5.31%, 18/02/2025 | 158.003 | 0,19 |
| 150.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, 5.35%, 09/04/2025 | 150.004 | 0,18 |
| 248.000.000 | USD | Swedbank AB, FRN, 5.03%, 02/10/2024 | 248.000 | 0,30 |
| 50.000.000 | USD | Swedbank AB, FRN, 5.08%, 05/06/2025 | 50.000 | 0,06 |
| 100.000.000 | USD | Swedbank AB, 5.39%, 30/12/2024 | 100.000 | 0,12 |
| 158.000.000 | USD | Swedbank AB, 5.34%, 09/04/2025 | 158.000 | 0,19 |
| | | Schweden - Gesamt | 2.413.456 | 2,95 |
| Schweiz (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 43.000.000 | USD | UBS AG, 0.00%, 08/11/2024 | 42.768 | 0,05 |
| 93.000.000 | USD | UBS AG, 0.00%, 03/01/2025 | 91.692 | 0,11 |
| 125.000.000 | USD | UBS AG, 0.00%, 19/02/2025 | 122.480 | 0,15 |
| 190.000.000 | USD | UBS AG, 0.00%, 10/03/2025 | 185.581 | 0,23 |
| | | Schweiz - Gesamt | 442.521 | 0,54 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 2,19 %) | | | | |
| 232.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 18/10/2024 | 231.404 | 0,28 |
| 160.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 04/11/2024 | 159.177 | 0,19 |
| 269.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 20/11/2024 | 267.046 | 0,33 |
| 210.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 16/12/2024 | 207.618 | 0,25 |
| 247.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 03/03/2025 | 241.890 | 0,30 |
| 265.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 20/03/2025 | 259.069 | 0,32 |
| 90.000.000 | USD | NatWest Markets plc, 0.00%, 22/01/2025 | 88.516 | 0,11 |
| 184.000.000 | USD | Standard Chartered Bank, FRN, 5.09%, 12/11/2024 | 184.000 | 0,23 |
| 278.000.000 | USD | Standard Chartered Bank, FRN, 5.14%, 02/01/2025 | 278.000 | 0,34 |
| 185.000.000 | USD | Standard Chartered Bank, 0.00%, 21/11/2024 | 183.630 | 0,22 |
| 47.000.000 | USD | Standard Chartered Bank, 0.00%, 10/12/2024 | 46.539 | 0,06 |
| 175.000.000 | USD | Standard Chartered Bank, 5.35%, 10/04/2025 | 175.000 | 0,21 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 2.321.889 | 2,84 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Einlagezertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 3,31 %) | | | | |
| 150.000.000 | USD | Bank of America NA, 5.15%, 22/01/2025 | 150.000 | 0,18 |
| 160.000.000 | USD | Bank of America NA, 5.37%, 09/04/2025 | 160.000 | 0,20 |
| 95.000.000 | USD | Bank of America NA, 5.50%, 10/04/2025 | 95.000 | 0,12 |
| 132.000.000 | USD | Bank of America NA, 5.28%, 15/04/2025 | 132.000 | 0,16 |
| 97.000.000 | USD | Bank of America NA, 5.50%, 24/04/2025 | 97.000 | 0,12 |
| 150.000.000 | USD | Bank of America NA, 5.11%, 18/06/2025 | 150.000 | 0,18 |
| 137.000.000 | USD | Citibank NA, FRN, 5.10%, 20/06/2025 | 137.000 | 0,17 |
| 100.000.000 | USD | Wells Fargo Bank NA, FRN, 5.14%, 21/02/2025 | 100.000 | 0,12 |
| Vereinigte Staaten - Gesamt | | | 1.021.000 | 1,25 |
| Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt | | | 31.685.263 | 38,77 |
| Commercial Papers (30. September 2023: 40,11 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 4,80 %) | | | | |
| 186.000.000 | USD | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 5.04%, 08/10/2024 | 186.000 | 0,23 |
| 253.500.000 | USD | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 02/01/2025 | 250.286 | 0,31 |
| 166.000.000 | USD | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 14/01/2025 | 163.628 | 0,20 |
| 202.000.000 | USD | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 5.10%, 22/04/2025 | 202.000 | 0,25 |
| 141.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 5.16%, 07/11/2024 | 141.000 | 0,17 |
| 47.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 5.18%, 13/11/2024 | 46.999 | 0,06 |
| 86.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 5.19%, 18/11/2024 | 86.000 | 0,10 |
| 229.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 08/01/2025 | 225.888 | 0,28 |
| 157.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 5.26%, 30/01/2025 | 157.000 | 0,19 |
| 55.000.000 | USD | Export Finance & Insurance Corp., 0.00%, 21/10/2024 | 54.840 | 0,07 |
| 50.000.000 | USD | Export Finance & Insurance Corp., 0.00%, 16/12/2024 | 49.440 | 0,06 |
| 279.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 5.08%, 05/11/2024 | 279.000 | 0,34 |
| 178.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 5.05%, 07/11/2024 | 178.000 | 0,22 |
| 187.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 5.08%, 13/12/2024 | 187.000 | 0,23 |
| 175.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 17/01/2025 | 172.260 | 0,21 |
| 97.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 27/01/2025 | 95.307 | 0,12 |
| 175.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 5.11%, 03/03/2025 | 175.000 | 0,21 |
| 149.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 5.10%, 07/03/2025 | 149.000 | 0,18 |
| 88.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 18/03/2025 | 86.160 | 0,10 |
| 231.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 5.11%, 23/06/2025 | 231.000 | 0,28 |
| 285.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 5.05%, 15/10/2024 | 285.000 | 0,35 |
| 232.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 5.08%, 12/11/2024 | 232.000 | 0,28 |
| 161.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 5.09%, 24/02/2025 | 161.000 | 0,20 |
| 100.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 5.12%, 27/06/2025 | 100.014 | 0,12 |
| 130.000.000 | USD | Queensland Treasury Corp., 0.00%, 03/02/2025 | 127.701 | 0,16 |
| 184.000.000 | USD | Toyota Finance Australia Ltd., 0.00%, 12/11/2024 | 182.852 | 0,22 |
| 129.000.000 | USD | Toyota Finance Australia Ltd., 0.00%, 25/11/2024 | 127.946 | 0,16 |
| 97.000.000 | USD | Toyota Finance Australia Ltd., 0.00%, 29/11/2024 | 96.149 | 0,12 |
| 250.000.000 | USD | Westpac Banking Corp., 5.09%, 20/03/2025 | 249.989 | 0,30 |
| 95.000.000 | USD | Westpac Banking Corp., 5.09%, 25/03/2025 | 95.000 | 0,12 |
| 150.000.000 | USD | Westpac Banking Corp., 5.17%, 05/09/2025 | 150.000 | 0,18 |
| Australien - Gesamt | | | 4.923.459 | 6,02 |
| Österreich (30. September 2023: 0,69 %) | | | | |
| 500.000.000 | USD | Erste Group Bank AG, 0.00%, 03/10/2024 | 499.866 | 0,61 |
| Österreich - Gesamt | | | 499.866 | 0,61 |
| Kanada (30. September 2023: 2,37 %) | | | | |
| 123.000.000 | USD | Bank of Montreal, 5.14%, 21/05/2025 | 123.000 | 0,15 |
| 224.000.000 | USD | Bank of Montreal, 5.26%, 17/06/2025 | 224.000 | 0,28 |
| 142.000.000 | USD | Bank of Montreal, 5.34%, 11/09/2025 | 142.000 | 0,18 |
| 114.000.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.00%, 01/10/2024 | 114.000 | 0,14 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Kanada (Fortsetzung) | | | | |
| 43.000.000 | USD | CDP Financial, Inc., 0.00%, 21/10/2024 | 42.875 | 0,05 |
| 134.000.000 | USD | CDP Financial, Inc., 0.00%, 07/02/2025 | 131.650 | 0,16 |
| 35.000.000 | USD | CDP Financial, Inc., 0.00%, 29/04/2025 | 33.986 | 0,04 |
| 45.000.000 | USD | CDP Financial, Inc., 0.00%, 14/05/2025 | 43.540 | 0,05 |
| 100.000.000 | USD | Export Development Canada, 0.00%, 09/01/2025 | 98.557 | 0,12 |
| 85.000.000 | USD | Export Development Canada, 0.00%, 10/01/2025 | 83.761 | 0,10 |
| 45.000.000 | USD | Export Development Canada, 0.00%, 14/01/2025 | 44.319 | 0,06 |
| 100.000.000 | USD | Federation des caisses Desjardins du Quebec (The), 0.00%, 21/10/2024 | 99.731 | 0,12 |
| 100.000.000 | USD | Federation des caisses Desjardins du Quebec (The), 0.00%, 22/10/2024 | 99.717 | 0,12 |
| 185.000.000 | USD | Federation des caisses Desjardins du Quebec (The), 0.00%, 21/01/2025 | 182.009 | 0,22 |
| 238.000.000 | USD | National Bank of Canada, 0.00%, 23/10/2024 | 237.293 | 0,29 |
| 149.000.000 | USD | National Bank of Canada, 5.06%, 10/02/2025 | 149.000 | 0,18 |
| 35.000.000 | USD | Province of Quebec Canada, 0.00%, 18/10/2024 | 34.912 | 0,04 |
| 160.000.000 | USD | Royal Bank of Canada, 0.00%, 06/11/2024 | 159.123 | 0,20 |
| | | Kanada - Gesamt | 2.043.473 | 2,50 |
| | | Dänemark (30. September 2023: 1,83 %) | - | - |
| | | Finnland (30. September 2023: 2,29 %) | | |
| 94.000.000 | USD | Kuntarahoitus OYJ, 0.00%, 03/10/2024 | 93.975 | 0,12 |
| 165.000.000 | USD | Kuntarahoitus OYJ, 0.00%, 14/01/2025 | 162.641 | 0,20 |
| | | Finnland - Gesamt | 256.616 | 0,32 |
| | | Frankreich (30. September 2023: 7,40 %) | | |
| 137.000.000 | USD | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 02/10/2024 | 136.980 | 0,17 |
| 150.000.000 | USD | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 13/12/2024 | 148.489 | 0,18 |
| 217.000.000 | USD | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 17/01/2025 | 213.637 | 0,26 |
| 201.000.000 | USD | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 22/01/2025 | 197.906 | 0,24 |
| 75.000.000 | USD | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 03/02/2025 | 73.824 | 0,09 |
| 60.000.000 | USD | Agence Francaise De Developpement Principal, 0.00%, 27/01/2025 | 58.984 | 0,07 |
| 20.000.000 | USD | Antalis SA, 0.00%, 04/10/2024 | 19.992 | 0,03 |
| 135.000.000 | USD | BPCE SA, 0.00%, 28/10/2024 | 134.466 | 0,17 |
| 232.000.000 | USD | BPCE SA, 5.09%, 05/11/2024 | 232.000 | 0,28 |
| 140.000.000 | USD | BPCE SA, 0.00%, 09/12/2024 | 138.577 | 0,17 |
| 100.000.000 | USD | BPCE SA, 5.09%, 09/12/2024 | 100.000 | 0,12 |
| 100.000.000 | USD | BPCE SA, 5.09%, 03/03/2025 | 100.000 | 0,12 |
| 39.000.000 | USD | BPCE SA, 0.00%, 03/03/2025 | 38.193 | 0,05 |
| 375.000.000 | USD | BRED Banque Populaire, 0.00%, 01/10/2024 | 375.000 | 0,46 |
| 375.000.000 | USD | BRED Banque Populaire, 0.00%, 02/10/2024 | 374.950 | 0,46 |
| 140.000.000 | USD | BRED Banque Populaire, 0.00%, 03/01/2025 | 138.174 | 0,17 |
| 901.000.000 | USD | Caisse d'amortissement de la dette sociale, 0.00%, 15/10/2024 | 899.131 | 1,10 |
| 475.000.000 | USD | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.00%, 17/10/2024 | 473.879 | 0,58 |
| 100.000.000 | USD | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.00%, 22/10/2024 | 99.690 | 0,12 |
| 256.000.000 | USD | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.00%, 10/02/2025 | 251.429 | 0,31 |
| 411.000.000 | USD | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.00%, 27/02/2025 | 402.775 | 0,49 |
| 473.000.000 | USD | Caisse des Depots et Consignations, 0.00%, 06/11/2024 | 470.581 | 0,58 |
| 217.000.000 | USD | Caisse des Depots et Consignations, 0.00%, 08/11/2024 | 215.828 | 0,26 |
| 200.000.000 | USD | Caisse des Depots et Consignations, 0.00%, 20/12/2024 | 197.956 | 0,24 |
| 67.000.000 | USD | Eurotitrisation - SAT Magenta, 0.00%, 01/10/2024 | 67.000 | 0,08 |
| 67.000.000 | USD | Eurotitrisation - SAT Magenta, 0.00%, 02/10/2024 | 66.990 | 0,08 |
| 120.000.000 | USD | Eurotitrisation - SAT Magenta, 0.00%, 18/10/2024 | 119.693 | 0,15 |
| 33.000.000 | USD | Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST SA, 0.00%, 01/11/2024 | 32.851 | 0,04 |
| 127.000.000 | USD | Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST SA, 0.00%, 02/12/2024 | 125.869 | 0,15 |
| 65.000.000 | USD | Satellite, 0.00%, 21/10/2024 | 64.818 | 0,08 |
| 48.000.000 | USD | Satellite, 0.00%, 08/11/2024 | 47.734 | 0,06 |
| 83.000.000 | USD | Satellite, 0.00%, 09/01/2025 | 81.855 | 0,10 |
| 10.000.000 | USD | Satellite SASU, 0.00%, 23/10/2024 | 9.967 | 0,01 |
| 62.000.000 | USD | Satellite SASU, 0.00%, 24/10/2024 | 61.805 | 0,08 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| 20.000.000 | USD | Frankreich (Fortsetzung) Satellite SASU, 0.00%, 04/12/2024 | 19.817 | 0,02 |
| | | Frankreich - Gesamt | 6.190.840 | 7,57 |
| | | Deutschland (30. September 2023: 5,89 %) | | |
| 300.000.000 | USD | Deutsche Bank AG, 0.00%, 12/12/2024 | 296.756 | 0,36 |
| 159.000.000 | USD | FMS Wertmanagement, 0.00%, 29/10/2024 | 158.401 | 0,19 |
| 150.000.000 | USD | FMS Wertmanagement, 0.00%, 30/10/2024 | 149.416 | 0,18 |
| 180.000.000 | USD | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.00%, 01/11/2024 | 179.188 | 0,22 |
| 274.000.000 | USD | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.00%, 03/01/2025 | 270.469 | 0,33 |
| 224.000.000 | USD | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.00%, 03/01/2025 | 220.928 | 0,27 |
| 294.000.000 | USD | Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 0.00%, 21/10/2024 | 293.187 | 0,36 |
| 250.000.000 | USD | Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 0.00%, 07/11/2024 | 248.748 | 0,31 |
| 200.000.000 | USD | Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 0.00%, 07/01/2025 | 197.342 | 0,24 |
| 200.000.000 | USD | Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.00%, 21/10/2024 | 199.447 | 0,24 |
| 400.000.000 | USD | Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.00%, 07/11/2024 | 397.997 | 0,49 |
| 75.000.000 | USD | NRW. Bank, 0.00%, 07/10/2024 | 74.933 | 0,09 |
| 188.000.000 | USD | NRW. Bank, 0.00%, 08/10/2024 | 187.805 | 0,23 |
| 205.000.000 | USD | NRW. Bank, 0.00%, 04/11/2024 | 204.048 | 0,25 |
| 78.000.000 | USD | NRW. Bank, 0.00%, 06/12/2024 | 77.291 | 0,10 |
| 100.000.000 | USD | NRW. Bank, 0.00%, 09/12/2024 | 98.983 | 0,12 |
| 471.000.000 | USD | NRW. Bank, 0.00%, 10/12/2024 | 466.476 | 0,57 |
| 285.000.000 | USD | NRW. Bank, 0.00%, 22/04/2025 | 278.089 | 0,34 |
| | | Deutschland - Gesamt | 3.999.504 | 4,89 |
| | | Irland (30. September 2023: 0,15 %) | | |
| 54.000.000 | USD | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 09/01/2025 | 53.255 | 0,07 |
| | | Irland - Gesamt | 53.255 | 0,07 |
| | | Japan (30. September 2023: 0,00 %) | | |
| 174.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 04/10/2024 | 173.922 | 0,22 |
| 75.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 11/12/2024 | 74.259 | 0,09 |
| 100.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 13/12/2024 | 98.984 | 0,12 |
| | | Japan - Gesamt | 347.165 | 0,43 |
| | | Luxemburg (30. September 2023: 2,36 %) | | |
| 376.000.000 | USD | DZ Privatbank SA, 0.00%, 02/10/2024 | 375.949 | 0,46 |
| | | Luxemburg - Gesamt | 375.949 | 0,46 |
| | | Niederlande (30. September 2023: 1,82 %) | | |
| 356.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 02/10/2024 | 355.952 | 0,44 |
| 380.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 03/10/2024 | 379.898 | 0,46 |
| 333.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 04/10/2024 | 332.866 | 0,41 |
| 227.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 21/10/2024 | 226.390 | 0,28 |
| 200.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 28/10/2024 | 199.276 | 0,24 |
| 190.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 31/10/2024 | 189.170 | 0,23 |
| 185.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 31/10/2024 | 184.192 | 0,22 |
| 264.000.000 | USD | BNG Bank NV, 0.00%, 06/01/2025 | 260.354 | 0,32 |
| 1.663.000.000 | USD | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 11/10/2024 | 1.660.758 | 2,03 |
| 523.000.000 | USD | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 21/10/2024 | 521.588 | 0,64 |
| 244.000.000 | USD | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 21/10/2024 | 243.325 | 0,30 |
| 244.000.000 | USD | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 21/10/2024 | 243.324 | 0,30 |
| 296.000.000 | USD | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 05/12/2024 | 293.358 | 0,36 |
| 58.000.000 | USD | Toyota Motor Finance (Netherlands) BV, 0.00%, 15/11/2024 | 57.612 | 0,07 |
| | | Niederlande - Gesamt | 5.148.063 | 6,30 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Neuseeland (30. September 2023: 0,17 %) | | | | |
| 150.000.000 | USD | ASB Bank Ltd., 5.11%, 27/06/2025 | 150.000 | 0,18 |
| 190.000.000 | USD | New Zealand (Government of), 0.00%, 22/11/2024 | 188.589 | 0,23 |
| 220.000.000 | USD | New Zealand (Government of), 0.00%, 18/12/2024 | 217.646 | 0,27 |
| 182.000.000 | USD | New Zealand (Government of), 0.00%, 06/01/2025 | 179.589 | 0,22 |
| 137.000.000 | USD | New Zealand Local Government Funding Agency Ltd., 0.00%, 15/11/2024 | 136.084 | 0,17 |
| 95.000.000 | USD | New Zealand Local Government Funding Agency Ltd., 0.00%, 10/12/2024 | 94.026 | 0,11 |
| Neuseeland - Gesamt | | | 965.934 | 1,18 |
| Norwegen (30. September 2023: 0,55 %) | | | | |
| 99.000.000 | USD | DNB Bank ASA, 0.00%, 05/12/2024 | 98.061 | 0,12 |
| 90.000.000 | USD | DNB Bank ASA, 0.00%, 02/01/2025 | 88.861 | 0,11 |
| 141.000.000 | USD | Kommunalbanken A/S, 0.00%, 28/10/2024 | 140.486 | 0,17 |
| Norwegen - Gesamt | | | 327.408 | 0,40 |
| Singapur (30. September 2023: 0,76 %) | | | | |
| 190.000.000 | USD | DBS Bank Ltd., 0.00%, 21/10/2024 | 189.489 | 0,23 |
| 100.000.000 | USD | DBS Bank Ltd., 0.00%, 23/10/2024 | 99.704 | 0,12 |
| 100.000.000 | USD | DBS Bank Ltd., 0.00%, 24/10/2024 | 99.691 | 0,12 |
| 90.000.000 | USD | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 25/10/2024 | 89.678 | 0,11 |
| 190.000.000 | USD | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 5.12%, 05/11/2024 | 190.000 | 0,23 |
| 176.000.000 | USD | Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 5.15%, 02/12/2024 | 176.000 | 0,22 |
| 278.000.000 | USD | United Overseas Bank Ltd., 5.03%, 16/04/2025 | 278.000 | 0,34 |
| Singapur - Gesamt | | | 1.122.562 | 1,37 |
| Südkorea (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 90.000.000 | USD | Korea Development Bank (The), 0.00%, 14/11/2024 | 89.408 | 0,11 |
| 175.000.000 | USD | Korea Development Bank (The), 0.00%, 07/01/2025 | 172.745 | 0,21 |
| 145.000.000 | USD | Korea Development Bank (The), 0.00%, 13/01/2025 | 142.940 | 0,18 |
| Südkorea - Gesamt | | | 405.093 | 0,50 |
| Supranational (30. September 2023: 1,72 %) | | | | |
| 170.000.000 | USD | Council of Europe Development Bank, 0.00%, 01/11/2024 | 169.282 | 0,21 |
| 78.000.000 | USD | Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial, 0.00%, 10/12/2024 | 77.241 | 0,09 |
| 300.000.000 | USD | European Investment Bank, 0.00%, 06/11/2024 | 298.540 | 0,37 |
| 70.000.000 | USD | European Investment Bank, 0.00%, 14/04/2025 | 68.111 | 0,08 |
| 199.000.000 | USD | International Development Association, 0.00%, 16/10/2024 | 198.560 | 0,24 |
| Supranational - Gesamt | | | 811.734 | 0,99 |
| Schweden (30. September 2023: 1,04 %) | | | | |
| 247.500.000 | USD | Kingdom of Sweden, 0.00%, 11/02/2025 | 243.348 | 0,30 |
| 139.000.000 | USD | Kommuninvest i Sverige AB, 0.00%, 12/02/2025 | 136.296 | 0,17 |
| 185.000.000 | USD | Kommuninvest i Sverige AB, 0.00%, 18/02/2025 | 181.240 | 0,22 |
| 220.000.000 | USD | Kommuninvest i Sverige AB, 0.00%, 03/03/2025 | 215.192 | 0,26 |
| 247.000.000 | USD | Skandinaviska Enskilda Banken AB, 5.03%, 01/10/2024 | 247.000 | 0,30 |
| 86.700.000 | USD | Skandinaviska Enskilda Banken AB, 5.04%, 20/12/2024 | 86.699 | 0,11 |
| 141.000.000 | USD | Swedbank AB, 5.07%, 02/12/2024 | 141.000 | 0,17 |
| 164.000.000 | USD | Swedbank AB, 5.07%, 09/12/2024 | 164.000 | 0,20 |
| 260.000.000 | USD | Swedbank AB, 5.04%, 17/03/2025 | 260.000 | 0,32 |
| Schweden - Gesamt | | | 1.674.775 | 2,05 |
| Schweiz (30. September 2023: 0,28 %) | | | | |
| 235.000.000 | USD | UBS AG, 5.07%, 26/11/2024 | 235.000 | 0,29 |
| 226.000.000 | USD | UBS AG, 5.19%, 02/01/2025 | 226.000 | 0,28 |
| 143.000.000 | USD | UBS AG, 5.20%, 03/01/2025 | 143.000 | 0,17 |
| 100.000.000 | USD | UBS AG, 5.20%, 03/02/2025 | 100.000 | 0,12 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Schweiz (Fortsetzung) | | | | |
| 189.000.000 | USD | UBS AG, 5.12%, 26/03/2025 | 189.000 | 0,23 |
| | | Schweiz - Gesamt | 893.000 | 1,09 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 1,73 %) | | | | |
| 285.000.000 | USD | Bank of England, 0.00%, 15/01/2025 | 280.737 | 0,34 |
| 232.000.000 | USD | HSBC Bank plc, 5.06%, 16/10/2024 | 232.000 | 0,28 |
| 200.000.000 | USD | HSBC Bank plc, 5.06%, 04/11/2024 | 200.000 | 0,25 |
| 188.000.000 | USD | HSBC Bank plc, 5.04%, 06/12/2024 | 188.000 | 0,23 |
| 600.000.000 | USD | National Westminster Bank plc, 0.00%, 03/10/2024 | 599.839 | 0,73 |
| 165.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 07/10/2024 | 164.853 | 0,20 |
| 205.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 10/10/2024 | 204.727 | 0,25 |
| 80.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 11/10/2024 | 79.878 | 0,10 |
| 143.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 23/10/2024 | 142.523 | 0,18 |
| 40.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 23/10/2024 | 39.866 | 0,05 |
| 134.000.000 | USD | Santander UK plc, 0.00%, 06/12/2024 | 132.833 | 0,16 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 2.265.256 | 2,77 |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 4,26 %) | | | | |
| 50.000.000 | USD | Aquitaine Funding Co. LLC, 0.00%, 01/10/2024 | 50.000 | 0,06 |
| 434.000.000 | USD | Aquitaine Funding Co. LLC, 0.00%, 02/10/2024 | 433.941 | 0,53 |
| 31.000.000 | USD | Automatic Data Processing, Inc., 0.00%, 02/10/2024 | 30.996 | 0,04 |
| 104.800.000 | USD | Britannia Funding Co. LLC, 0.00%, 01/10/2024 | 104.800 | 0,13 |
| 300.000.000 | USD | Britannia Funding Co. LLC, 0.00%, 02/10/2024 | 299.960 | 0,37 |
| 158.000.000 | USD | Cisco Systems, Inc., 0.00%, 04/11/2024 | 157.205 | 0,19 |
| 216.000.000 | USD | Citigroup Global Markets, Inc., 0.00%, 24/10/2024 | 215.256 | 0,26 |
| 140.000.000 | USD | Citigroup Global Markets, Inc., 0.00%, 09/04/2025 | 136.180 | 0,17 |
| 124.000.000 | USD | Citigroup Global Markets, Inc., 5.10%, 09/04/2025 | 124.000 | 0,15 |
| 184.000.000 | USD | Endeavour Fdg Co Llc Corporate Commercial Paper, 0.00%, 31/10/2024 | 183.160 | 0,22 |
| 400.000.000 | USD | Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 01/10/2024 | 400.000 | 0,49 |
| 185.000.000 | USD | ING (U.S.) Funding LLC, 5.04%, 24/10/2024 | 185.000 | 0,23 |
| 120.000.000 | USD | ING (U.S.) Funding LLC, 5.07%, 31/10/2024 | 120.000 | 0,15 |
| 37.000.000 | USD | ING (U.S.) Funding LLC, 5.08%, 12/11/2024 | 37.000 | 0,04 |
| 302.000.000 | USD | ING (U.S.) Funding LLC, 5.09%, 05/06/2025 | 302.000 | 0,37 |
| 312.000.000 | USD | J.P. Morgan Securities LLC, 5.16%, 06/01/2025 | 312.000 | 0,38 |
| | | Vereinigte Staaten - Gesamt | 3.091.498 | 3,78 |
| Anlagen in Commercial Papers - Gesamt | | | 35.395.450 | 43,30 |
| Termineinlagen (30. September 2023: 14,92 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 0,31 %) | | | | |
| 1.000.000.000 | USD | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 4.82%, 01/10/2024 | 1.000.000 | 1,22 |
| | | Australien - Gesamt | 1.000.000 | 1,22 |
| Belgien (30. September 2023: 0,31 %) | | | | |
| | | | - | - |
| Kanada (30. September 2023: 4,16 %) | | | | |
| 1.402.000.000 | USD | Royal Bank of Canada, 4.83%, 01/10/2024 | 1.402.000 | 1,71 |
| | | Kanada - Gesamt | 1.402.000 | 1,71 |
| Frankreich (30. September 2023: 0,04 %) | | | | |
| 324.000.000 | USD | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 4.82%, 01/10/2024 | 324.000 | 0,40 |
| | | Frankreich - Gesamt | 324.000 | 0,40 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Termineinlagen (Fortsetzung) | | | | |
| 88.000.000 | USD | Japan (30. September 2023: 0,00 %) Mizuho Bank Ltd., 4.83%, 01/10/2024 | 88.000 | 0,11 |
| | | Japan - Gesamt | 88.000 | 0,11 |
| | | Niederlande (30. September 2023: 1,00 %) | - | - |
| 2.280.000.000 | USD | Schweden (30. September 2023: 4,64 %) Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.83%, 01/10/2024 | 2.280.000 | 2,79 |
| | | Schweden - Gesamt | 2.280.000 | 2,79 |
| 2.000.000.000 | USD | Vereinigte Arabische Emirate (30. September 2023: 4,46 %) First Abu Dhabi Bank USA NV, 4.83%, 01/10/2024 | 2.000.000 | 2,45 |
| | | Vereinigte Arabische Emirate - Gesamt | 2.000.000 | 2,45 |
| Anlagen in Termineinlagen - Gesamt | | | 7.094.000 | 8,68 |
| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
| ANLEIHEN | | | | |
| Staatsanleihen (30. September 2023: 1,26 %) | | | | |
| | | Vereinigte Staaten (30. September 2023: 1,26 %) | | |
| 74.552.400 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 21/11/2024 ¹ | 74.019 | 0,09 |
| 127.000.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 03/12/2024 ¹ | 125.896 | 0,15 |
| 419.000.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 17/12/2024 ¹ | 414.537 | 0,51 |
| 247.000.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 23/01/2025 ¹ | 243.208 | 0,30 |
| 49.000.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 28/01/2025 ¹ | 48.281 | 0,06 |
| 181.000.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 27/03/2025 ¹ | 177.200 | 0,21 |
| | | Vereinigte Staaten - Gesamt | 1.083.141 | 1,32 |
| Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt | | | 1.083.141 | 1,32 |
| Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2023: 0,82 %) | | | | |
| | | Luxemburg (30. September 2023: 0,42 %) | | |
| 270.000.000 | USD | SG Issuer SA, 5.05%, 04/10/2024 ² | 270.000 | 0,33 |
| | | Luxemburg - Gesamt | 270.000 | 0,33 |
| | | Niederlande (30. September 2023: 0,00 %) | | |
| 147.000.000 | USD | BNG Bank NV, 5.15%, 28/02/2025 | 147.000 | 0,18 |
| | | Niederlande - Gesamt | 147.000 | 0,18 |
| | | Vereinigte Staaten (30. September 2023: 0,40 %) | - | - |
| Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt | | | 417.000 | 0,51 |
| Anlagen in Anleihen - Gesamt | | | 1.500.141 | 1,83 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Kontrahent | Zinssätze | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--------------------------------|-----------|------------------------|----------------------|-------------------------------|
| Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2023: 14,40 %) | | | | | | |
| Kanada (30. September 2023: 0,46 %) | | | | | | |
| 250.000.000 | USD | Royal Bank of Canada | 4,88 % | 01.10.2024 | 250.000 | 0,31 |
| 1.065.000.000 | USD | TD Securities (USA) LLC | 4,90 % | 01.10.2024 | 1.065.000 | 1,30 |
| Kanada - Gesamt | | | | | 1.315.000 | 1,61 |
| Frankreich (30. September 2023: 1,89 %) | | | | | | |
| 675.000.000 | USD | BNP Paribas SA | 4,88 % | 01.10.2024 | 675.000 | 0,83 |
| 220.000.000 | USD | BNP Paribas SA | 4,87 % | 01.10.2024 | 220.000 | 0,27 |
| 45.000.000 | USD | Credit Agricole SA | 4,89 % | 01.10.2024 | 45.000 | 0,05 |
| Frankreich - Gesamt | | | | | 940.000 | 1,15 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 0,00 %) | | | | | | |
| 523.000.000 | USD | Citigroup Global Markets, Inc. | 4,89 % | 01.10.2024 | 523.000 | 0,64 |
| 1.500.000.000 | USD | Wells Fargo Securities LLC | 4,89 % | 01.10.2024 | 1.500.000 | 1,83 |
| Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | | | 2.023.000 | 2,47 |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 12,05 %) | | | | | | |
| 375.000.000 | USD | Bofa Securities Inc. | 4,87 % | 01.10.2024 | 375.000 | 0,46 |
| 14.000.000 | USD | Bofa Securities Inc. | 4,88 % | 01.10.2024 | 14.000 | 0,02 |
| 492.000.000 | USD | J.P. Morgan Securities LLC | 4,90 % | 01.10.2024 | 492.000 | 0,60 |
| Vereinigte Staaten - Gesamt | | | | | 881.000 | 1,08 |
| Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt | | | | | 5.159.000 | 6,31 |
| | | | | | Zeitwert | % des Netto- |
| | | | | | Tsd. USD | inventarwerts |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt | | | | | 80.833.854 | 98,89 |
| Zahlungsmittel | | | | | 1.535.353 | 1,88 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | | | | (629.623) | (0,77) |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert | | | | | 81.739.584 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | | | | % des |
| Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | | | | | Gesamt- |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | | | | | | vermögens |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c) | | | | | | 0,47 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | | 7,58 |
| | | | | | | 89,73 |
| Gesamtvermögen | | | | | | 2,22 |
| | | | | | | 100,00 |

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

²Nullkupon-Anleihe

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Einlagezertifikate (30. September 2023: 29,87 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 0,87 %) | | | | |
| 7.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 05/12/2024 | 6.941 | 0,10 |
| 19.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 12/03/2025 | 18.623 | 0,27 |
| 25.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 21/03/2025 | 24.480 | 0,36 |
| 25.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 07/04/2025 | 24.434 | 0,36 |
| 25.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 01/10/2024 | 24.997 | 0,36 |
| 10.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 20/12/2024 | 9.894 | 0,14 |
| 15.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 02/01/2025 | 14.817 | 0,22 |
| 24.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 07/02/2025 | 23.606 | 0,34 |
| 9.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 0.00%, 04/04/2025 | 8.796 | 0,13 |
| 18.900.000 | USD | Westpac Banking Corp., 5.70%, 19/11/2024 | 18.919 | 0,27 |
| 15.000.000 | USD | Westpac Banking Corp., 5.35%, 28/01/2025 | 15.029 | 0,22 |
| Australien - Gesamt | | | 190.536 | 2,77 |
| Belgien (30. September 2023: 0,87 %) | | | | |
| 20.000.000 | USD | Euroclear Bank SA, 0.00%, 18/10/2024 | 19.952 | 0,29 |
| 18.000.000 | USD | Euroclear Bank SA, 0.00%, 31/10/2024 | 17.925 | 0,26 |
| 15.000.000 | USD | KBC Bank NV, 5.49%, 18/11/2024 | 15.013 | 0,22 |
| 40.000.000 | USD | KBC Bank NV, 0.00%, 13/01/2025 | 39.464 | 0,57 |
| Belgien - Gesamt | | | 92.354 | 1,34 |
| Kanada (30. September 2023: 6,55 %) | | | | |
| 21.590.000 | USD | Bank of Montreal, FRN, 5.24%, 24/10/2025 | 21.588 | 0,31 |
| 20.000.000 | USD | Bank of Montreal, 0.00%, 09/01/2025 | 19.742 | 0,29 |
| 10.000.000 | USD | Bank of Montreal, 0.00%, 05/03/2025 | 9.808 | 0,14 |
| 17.000.000 | USD | Bank of Montreal, 0.00%, 04/04/2025 | 16.620 | 0,24 |
| 20.000.000 | USD | Bank of Montreal, 0.00%, 28/07/2025 | 19.321 | 0,28 |
| 10.000.000 | USD | Bank of Nova Scotia (The), 6.00%, 18/10/2024 | 10.004 | 0,15 |
| 15.720.000 | USD | Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.17%, 04/06/2025 | 15.730 | 0,23 |
| 7.690.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 5.18%, 22/09/2025 | 7.688 | 0,11 |
| 17.500.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 02/01/2025 | 17.290 | 0,25 |
| 15.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 02/01/2025 | 14.820 | 0,21 |
| 16.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 02/04/2025 | 15.643 | 0,23 |
| 32.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 09/07/2025 | 30.972 | 0,45 |
| 25.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 10/07/2025 | 24.195 | 0,35 |
| Kanada - Gesamt | | | 223.421 | 3,24 |
| Finnland (30. September 2023: 0,44 %) | | | | |
| | | | - | - |
| Frankreich (30. September 2023: 3,22 %) | | | | |
| 15.000.000 | USD | Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 03/02/2025 | 14.760 | 0,21 |
| 46.000.000 | USD | Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 05/02/2025 | 45.264 | 0,66 |
| 47.950.000 | USD | BNP Paribas SA, 5.10%, 30/07/2025 | 48.266 | 0,70 |
| 6.490.000 | USD | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN, 5.12%, 13/06/2025 | 6.490 | 0,09 |
| 11.340.000 | USD | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN, 5.13%, 20/06/2025 | 11.341 | 0,16 |
| 24.000.000 | USD | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 5.55%, 30/05/2025 | 24.181 | 0,35 |
| 50.000.000 | USD | Credit Agricole SA, 0.00%, 06/01/2025 | 49.373 | 0,72 |
| 15.000.000 | USD | Credit Agricole SA, 0.00%, 06/01/2025 | 14.812 | 0,22 |
| 5.250.000 | USD | Credit Industriel et Commercial, 5.28%, 12/12/2024 | 5.254 | 0,08 |
| 12.220.000 | USD | Credit Industriel et Commercial, 5.26%, 11/03/2025 | 12.255 | 0,18 |
| 12.500.000 | USD | Credit Industriel et Commercial, 5.50%, 12/05/2025 | 12.578 | 0,18 |
| 13.100.000 | USD | Credit Industriel et Commercial, 5.52%, 28/05/2025 | 13.192 | 0,19 |
| Frankreich - Gesamt | | | 257.766 | 3,74 |
| Deutschland (30. September 2023: 0,57 %) | | | | |
| 30.000.000 | USD | Deutsche Bank AG, FRN, 5.19%, 03/03/2025 | 30.007 | 0,43 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| Deutschland (Fortsetzung) | | | | |
| 25.000.000 | USD | UBS Europe SE, 0.00%, 12/03/2025 | 24.499 | 0,36 |
| | | Deutschland - Gesamt | 54.506 | 0,79 |
| Japan (30. September 2023: 2,84 %) | | | | |
| 30.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., FRN, 5.08%, 06/11/2024 | 30.005 | 0,44 |
| 24.360.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., FRN, 5.06%, 13/11/2024 | 24.364 | 0,35 |
| 18.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 08/01/2025 | 17.768 | 0,26 |
| 7.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 09/01/2025 | 6.909 | 0,10 |
| 6.000.000 | USD | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 03/02/2025 | 5.905 | 0,09 |
| 10.000.000 | USD | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 13/01/2025 | 9.863 | 0,14 |
| 10.000.000 | USD | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 14/01/2025 | 9.862 | 0,14 |
| 25.220.000 | USD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN, 5.09%, 29/10/2024 | 25.223 | 0,37 |
| 16.700.000 | CAD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 17/12/2024 | 12.246 | 0,18 |
| 5.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 29/10/2024 | 4.980 | 0,07 |
| 10.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 08/11/2024 | 9.947 | 0,14 |
| 10.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 15/11/2024 | 9.938 | 0,14 |
| 5.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 13/12/2024 | 4.952 | 0,07 |
| 27.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 26.660 | 0,39 |
| 10.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 9.874 | 0,14 |
| 5.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 06/01/2025 | 4.937 | 0,07 |
| 13.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 09/01/2025 | 12.832 | 0,19 |
| 11.000.000 | USD | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 07/02/2025 | 10.820 | 0,16 |
| | | Japan - Gesamt | 237.085 | 3,44 |
| Niederlande (30. September 2023: 3,02 %) | | | | |
| 50.000.000 | USD | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 14/02/2025 | 49.135 | 0,71 |
| 16.000.000 | USD | Cooperatieve Rabobank UA, 0.00%, 08/11/2024 | 15.916 | 0,23 |
| 5.000.000 | USD | Cooperatieve Rabobank UA, 0.00%, 13/02/2025 | 4.913 | 0,07 |
| 40.000.000 | USD | Cooperatieve Rabobank UA, 0.00%, 30/05/2025 | 38.868 | 0,56 |
| 35.000.000 | USD | ING Bank NV, 0.00%, 26/11/2024 | 34.736 | 0,51 |
| 10.000.000 | USD | ING Bank NV, 0.00%, 02/01/2025 | 9.878 | 0,14 |
| 27.500.000 | USD | ING Bank NV, 0.00%, 20/02/2025 | 27.005 | 0,39 |
| 37.000.000 | USD | ING Bank NV, 0.00%, 05/03/2025 | 36.280 | 0,53 |
| 14.000.000 | USD | ING Bank NV, 0.00%, 26/03/2025 | 13.695 | 0,20 |
| | | Niederlande - Gesamt | 230.426 | 3,34 |
| Norwegen (30. September 2023: 1,28 %) | | | | |
| 25.000.000 | USD | DNB Bank ASA, 0.00%, 02/01/2025 | 24.700 | 0,36 |
| 15.000.000 | USD | DNB Bank ASA, 0.00%, 02/05/2025 | 14.622 | 0,21 |
| | | Norwegen - Gesamt | 39.322 | 0,57 |
| Südkorea (30. September 2023: 1,46 %) | | | | |
| 20.000.000 | USD | KEB Hana Bank, 0.00%, 21/10/2024 | 19.943 | 0,29 |
| 20.000.000 | USD | KEB Hana Bank, 0.00%, 12/12/2024 | 19.805 | 0,29 |
| 25.000.000 | USD | KEB Hana Bank, 0.00%, 24/01/2025 | 24.625 | 0,36 |
| 31.000.000 | USD | KEB Hana Bank, 0.00%, 04/03/2025 | 30.399 | 0,44 |
| 50.000.000 | USD | Korea Development Bank (The), 0.00%, 13/11/2024 | 49.703 | 0,72 |
| | | Südkorea - Gesamt | 144.475 | 2,10 |
| Schweden (30. September 2023: 1,50 %) | | | | |
| 30.000.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.03%, 11/04/2025 | 29.997 | 0,43 |
| 7.393.000 | USD | Svenska Handelsbanken AB, 5.39%, 19/03/2025 | 7.420 | 0,11 |
| | | Schweden - Gesamt | 37.417 | 0,54 |
| Schweiz (30. September 2023: 1,00 %) | | | | |
| 10.000.000 | USD | UBS AG, 0.00%, 19/02/2025 | 9.823 | 0,15 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Einlagenzertifikate (Fortsetzung) | | | | |
| Schweiz (Fortsetzung) | | | | |
| 10.000.000 | USD | UBS AG, 0.00%, 10/03/2025 | 9.802 | 0,14 |
| | | Schweiz - Gesamt | 19.625 | 0,29 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 3,31 %) | | | | |
| 57.000.000 | USD | Barclays Bank plc, 0.00%, 10/10/2024 | 56.924 | 0,82 |
| 25.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 04/11/2024 | 24.881 | 0,36 |
| 10.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 20/11/2024 | 9.931 | 0,14 |
| 20.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 16/12/2024 | 19.796 | 0,29 |
| 30.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 03/03/2025 | 29.420 | 0,43 |
| 24.000.000 | USD | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 20/03/2025 | 23.491 | 0,34 |
| 34.690.000 | USD | Lloyds Bank Corporate Markets plc, 5.51%, 27/05/2025 | 34.932 | 0,51 |
| 37.750.000 | USD | Lloyds Bank Corporate Markets plc, 5.10%, 25/07/2025 | 37.991 | 0,55 |
| 5.000.000 | USD | NatWest Markets plc, 0.00%, 22/01/2025 | 4.927 | 0,07 |
| 32.160.000 | USD | Standard Chartered Bank, 5.20%, 08/01/2025 | 32.185 | 0,47 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 274.478 | 3,98 |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 2,94 %) | | | | |
| 23.530.000 | USD | Bank of America NA, 5.24%, 14/02/2025 | 23.536 | 0,34 |
| 13.740.000 | USD | HSBC Bank USA NA, FRN, 5.16%, 12/03/2025 | 13.747 | 0,20 |
| 8.250.000 | USD | HSBC Bank USA NA, FRN, 5.19%, 20/05/2025 | 8.253 | 0,12 |
| 34.500.000 | USD | HSBC Bank USA NA, 5.79%, 25/11/2024 | 34.538 | 0,50 |
| 12.500.000 | USD | HSBC Bank USA NA, 5.50%, 09/05/2025 | 12.569 | 0,18 |
| | | Vereinigte Staaten - Gesamt | 92.643 | 1,34 |
| Anlagen in Einlagenzertifikaten - Gesamt | | | 1.894.054 | 27,48 |
| Commercial Papers (30. September 2023: 52,81 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 5,45 %) | | | | |
| 26.000.000 | USD | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 02/01/2025 | 25.681 | 0,37 |
| 20.590.000 | USD | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 14/01/2025 | 20.317 | 0,30 |
| 38.000.000 | USD | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 26/06/2025 | 36.824 | 0,54 |
| 10.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 08/11/2024 | 9.948 | 0,15 |
| 14.010.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 5.19%, 19/11/2024 | 14.012 | 0,20 |
| 12.000.000 | USD | Commonwealth Bank of Australia, 0.00%, 08/01/2025 | 11.849 | 0,17 |
| 10.000.000 | USD | Export Finance & Insurance Corp., 0.00%, 16/12/2024 | 9.899 | 0,14 |
| 34.480.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 27/11/2024 | 34.214 | 0,50 |
| 39.940.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 20/06/2025 | 38.726 | 0,56 |
| 7.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 5.23%, 24/06/2025 | 7.004 | 0,10 |
| 50.000.000 | USD | Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 25/06/2025 | 48.447 | 0,70 |
| 35.000.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 5.09%, 18/02/2025 | 35.012 | 0,51 |
| 6.840.000 | USD | National Australia Bank Ltd., 5.09%, 02/04/2025 | 6.842 | 0,10 |
| 13.250.000 | USD | Queensland Treasury Corp., 0.00%, 18/03/2025 | 12.979 | 0,19 |
| 30.000.000 | USD | Suncorp-Metway Ltd., 0.00%, 25/11/2024 | 29.778 | 0,43 |
| 19.520.000 | USD | Telstra Group Ltd., 0.00%, 17/12/2024 | 19.313 | 0,28 |
| | | Australien - Gesamt | 360.845 | 5,24 |
| Belgien (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 29.320.000 | USD | Euroclear Bank SA, 0.00%, 17/04/2025 | 28.634 | 0,41 |
| | | Belgien - Gesamt | 28.634 | 0,41 |
| Bermuda (30. September 2023: 0,22 %) | | | | |
| 25.250.000 | USD | Brookfield Renewable Partners LP, 0.00%, 01/10/2024 | 25.247 | 0,37 |
| 5.750.000 | USD | Brookfield Renewable Partners LP, 0.00%, 02/10/2024 | 5.748 | 0,08 |
| 28.250.000 | USD | Brookfield Renewable Partners LP, 0.00%, 03/10/2024 | 28.238 | 0,41 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Bermuda (Fortsetzung) | | | | |
| 20.500.000 | USD | Brookfield Renewable Partners LP, 0.00%, 04/10/2024 | 20.489 | 0,30 |
| | | Bermuda - Gesamt | 79.722 | 1,16 |
| Kanada (30. September 2023: 7,38 %) | | | | |
| 15.000.000 | USD | Bank of Montreal, 5.07%, 03/12/2024 | 15.003 | 0,22 |
| 6.500.000 | USD | Bell Canada, Inc., 0.00%, 22/10/2024 | 6.480 | 0,09 |
| 21.000.000 | USD | Bell Canada, Inc., 0.00%, 25/10/2024 | 20.928 | 0,30 |
| 15.654.000 | USD | CDP Financial, Inc., 0.00%, 04/10/2024 | 15.646 | 0,23 |
| 38.120.000 | USD | CDP Financial, Inc., 0.00%, 02/01/2025 | 37.660 | 0,55 |
| 28.840.000 | USD | CDP Financial, Inc., 0.00%, 03/02/2025 | 28.385 | 0,41 |
| 10.000.000 | USD | CDP Financial, Inc., 0.00%, 07/02/2025 | 9.838 | 0,14 |
| 5.000.000 | USD | CDP Financial, Inc., 0.00%, 29/04/2025 | 4.875 | 0,07 |
| 5.000.000 | USD | CDP Financial, Inc., 0.00%, 14/05/2025 | 4.867 | 0,07 |
| 5.000.000 | USD | Export Development Canada, 0.00%, 10/01/2025 | 4.935 | 0,07 |
| 5.000.000 | USD | Export Development Canada, 0.00%, 14/01/2025 | 4.933 | 0,07 |
| 15.000.000 | USD | Federation des caisses Desjardins du Quebec (The), 0.00%, 21/01/2025 | 14.788 | 0,21 |
| 34.490.000 | USD | National Bank of Canada, 0.00%, 06/11/2024 | 34.320 | 0,50 |
| 11.820.000 | USD | National Bank of Canada, 0.00%, 25/02/2025 | 11.602 | 0,17 |
| 15.000.000 | USD | National Bank of Canada, 0.00%, 30/04/2025 | 14.618 | 0,21 |
| 25.000.000 | USD | National Bank of Canada, 0.00%, 23/05/2025 | 24.305 | 0,35 |
| 42.420.000 | USD | National Bank of Canada, 0.00%, 12/06/2025 | 41.155 | 0,60 |
| 9.190.000 | USD | National Bank of Canada, 5.21%, 19/09/2025 | 9.191 | 0,13 |
| 14.250.000 | USD | Nutrien Ltd., 0.00%, 09/10/2024 | 14.232 | 0,21 |
| 13.500.000 | USD | Ontario Teachers' Finance Trust, 0.00%, 09/10/2024 | 13.484 | 0,20 |
| 21.000.000 | USD | Province of Quebec Canada, 0.00%, 04/03/2025 | 20.607 | 0,30 |
| 24.600.000 | USD | Royal Bank of Canada, 0.00%, 15/10/2024 | 24.551 | 0,36 |
| 25.250.000 | CAD | TransCanada PipeLines Ltd., 0.00%, 23/10/2024 | 18.630 | 0,27 |
| | | Kanada - Gesamt | 395.033 | 5,73 |
| Finnland (30. September 2023: 1,18 %) | | | | |
| 20.000.000 | USD | Kuntarahoitus OYJ, 0.00%, 14/01/2025 | 19.735 | 0,29 |
| | | Finnland - Gesamt | 19.735 | 0,29 |
| Frankreich (30. September 2023: 4,26 %) | | | | |
| 22.000.000 | USD | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 13/12/2024 | 21.787 | 0,32 |
| 10.000.000 | USD | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 17/01/2025 | 9.861 | 0,14 |
| 35.000.000 | USD | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 22/01/2025 | 34.493 | 0,50 |
| 20.000.000 | USD | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 03/02/2025 | 19.686 | 0,29 |
| 28.750.000 | USD | BPCE SA, 0.00%, 09/10/2024 | 28.715 | 0,42 |
| 18.000.000 | USD | BPCE SA, 0.00%, 09/12/2024 | 17.836 | 0,26 |
| 28.000.000 | USD | BPCE SA, 0.00%, 28/01/2025 | 27.583 | 0,40 |
| 15.000.000 | USD | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.00%, 20/03/2025 | 14.688 | 0,21 |
| 6.000.000 | USD | Satellite SASU, 0.00%, 25/10/2024 | 5.980 | 0,09 |
| 50.000.000 | USD | Societe Generale SA, 0.00%, 02/10/2024 | 49.987 | 0,72 |
| 30.000.000 | USD | Societe Generale SA, 0.00%, 27/11/2024 | 29.772 | 0,43 |
| | | Frankreich - Gesamt | 260.388 | 3,78 |
| Deutschland (30. September 2023: 4,23 %) | | | | |
| 38.000.000 | USD | Deutsche Bank AG, 0.00%, 12/12/2024 | 37.639 | 0,55 |
| 15.000.000 | USD | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.00%, 03/01/2025 | 14.819 | 0,22 |
| 5.000.000 | USD | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.00%, 03/01/2025 | 4.940 | 0,07 |
| 28.000.000 | USD | NRW. Bank, 0.00%, 04/11/2024 | 27.871 | 0,40 |
| 22.650.000 | USD | NRW. Bank, 0.00%, 17/03/2025 | 22.186 | 0,32 |
| | | Deutschland - Gesamt | 107.455 | 1,56 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| 5.000.000 | USD | Irland (30. September 2023: 0,00 %) Matchpoint Finance plc, 0.00%, 09/01/2025 | 4.935 | 0,07 |
| | | Irland - Gesamt | 4.935 | 0,07 |
| 35.250.000 | USD | Japan (30. September 2023: 0,00 %) MUFG Bank Ltd., 0.00%, 11/12/2024 | 34.917 | 0,51 |
| | | Japan - Gesamt | 34.917 | 0,51 |
| | | Luxemburg (30. September 2023: 0,33 %) | - | - |
| 20.000.000 | USD | Niederlande (30. September 2023: 0,00 %) BNG Bank NV, 0.00%, 06/01/2025 | 19.752 | 0,29 |
| 10.000.000 | USD | Toyota Motor Finance (Netherlands) BV, 0.00%, 15/11/2024 | 9.939 | 0,14 |
| | | Niederlande - Gesamt | 29.691 | 0,43 |
| 11.000.000 | USD | Neuseeland (30. September 2023: 1,29 %) ASB Bank Ltd., 5.04%, 13/03/2025 | 11.000 | 0,16 |
| 15.000.000 | USD | New Zealand (Government of), 0.00%, 18/12/2024 | 14.848 | 0,22 |
| 10.000.000 | USD | New Zealand Local Government Funding Agency Ltd., 0.00%, 15/11/2024 | 9.939 | 0,14 |
| 33.000.000 | USD | New Zealand Local Government Funding Agency Ltd., 0.00%, 20/11/2024 | 32.778 | 0,48 |
| 33.610.000 | USD | Westpac Securities NZ Ltd., 0.00%, 09/01/2025 | 33.174 | 0,48 |
| 13.000.000 | USD | Westpac Securities NZ Ltd., 0.00%, 16/05/2025 | 12.647 | 0,18 |
| | | Neuseeland - Gesamt | 114.386 | 1,66 |
| 22.920.000 | USD | Norwegen (30. September 2023: 0,83 %) DNB ASA, 0.00%, 01/04/2025 | 22.415 | 0,32 |
| | | Norwegen - Gesamt | 22.415 | 0,32 |
| | | Singapur (30. September 2023: 0,44 %) | - | - |
| 10.000.000 | USD | Südkorea (30. September 2023: 0,36 %) Korea Development Bank (The), 0.00%, 14/11/2024 | 9.939 | 0,14 |
| 23.000.000 | USD | Korea Development Bank (The), 0.00%, 07/01/2025 | 22.702 | 0,33 |
| | | Südkorea - Gesamt | 32.641 | 0,47 |
| 30.000.000 | USD | Spanien (30. September 2023: 1,27 %) Banco Santander SA, 5.29%, 07/01/2025 | 30.023 | 0,43 |
| 8.400.000 | USD | Banco Santander SA, 0.00%, 07/04/2025 | 8.207 | 0,12 |
| | | Spanien - Gesamt | 38.230 | 0,55 |
| 15.000.000 | USD | Supranational (30. September 2023: 0,00 %) Council of Europe Development Bank, 0.00%, 01/11/2024 | 14.937 | 0,22 |
| 27.000.000 | USD | European Investment Bank, 0.00%, 06/11/2024 | 26.873 | 0,39 |
| 10.000.000 | USD | European Investment Bank, 0.00%, 14/04/2025 | 9.769 | 0,14 |
| | | Supranational - Gesamt | 51.579 | 0,75 |
| 50.000.000 | USD | Schweden (30. September 2023: 0,15 %) Kommuninvest i Sverige AB, 0.00%, 12/02/2025 | 49.141 | 0,71 |
| 15.000.000 | USD | Kommuninvest i Sverige AB, 0.00%, 18/02/2025 | 14.732 | 0,22 |
| 24.000.000 | USD | Kommuninvest i Sverige AB, 0.00%, 03/03/2025 | 23.534 | 0,34 |
| 25.000.000 | USD | Swedbank AB, 5.13%, 05/02/2025 | 25.013 | 0,36 |
| | | Schweden - Gesamt | 112.420 | 1,63 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| | | Schweiz (30. September 2023: 0,36 %) | - | - |
| | | Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 2,60 %) | | |
| 21.650.000 | USD | Lloyds Bank Corporate Markets plc, 0.00%, 03/02/2025 | 21.307 | 0,31 |
| 34.250.000 | USD | LSEGA Financing plc, 0.00%, 01/10/2024 | 34.245 | 0,50 |
| 13.750.000 | USD | LSEGA Financing plc, 0.00%, 04/10/2024 | 13.742 | 0,20 |
| 7.250.000 | USD | NatWest Markets plc, 0.00%, 24/06/2025 | 7.029 | 0,10 |
| 40.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 07/10/2024 | 39.962 | 0,58 |
| 30.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 10/10/2024 | 29.959 | 0,44 |
| 15.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 11/10/2024 | 14.978 | 0,22 |
| 50.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 23/10/2024 | 49.845 | 0,72 |
| 5.000.000 | USD | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 23/10/2024 | 4.984 | 0,07 |
| 40.000.000 | USD | Sumitomo Corp. Capital Europe plc, 0.00%, 15/10/2024 | 39.918 | 0,58 |
| 30.000.000 | USD | Sumitomo Corp. Capital Europe plc, 0.00%, 23/10/2024 | 29.906 | 0,43 |
| 40.000.000 | USD | Sumitomo Corp. Capital Europe plc, 0.00%, 01/11/2024 | 39.825 | 0,58 |
| | | Vereinigtes Königreich - Gesamt | 325.700 | 4,73 |
| | | Vereinigte Staaten (30. September 2023: 22,46 %) | | |
| 11.990.000 | USD | ABN AMRO Funding USA LLC, 0.00%, 01/10/2024 | 11.988 | 0,17 |
| 20.400.000 | USD | Alinghi Funding Co. LLC, 0.00%, 22/10/2024 | 20.339 | 0,30 |
| 18.290.000 | USD | Alinghi Funding Co. LLC, 0.00%, 08/01/2025 | 18.055 | 0,26 |
| 12.490.000 | USD | American Honda Finance Corp., 0.00%, 04/10/2024 | 12.483 | 0,18 |
| 9.780.000 | USD | American Honda Finance Corp., 0.00%, 09/12/2024 | 9.687 | 0,14 |
| 22.500.000 | USD | American Honda Finance Corp., 0.00%, 12/11/2024 | 22.366 | 0,32 |
| 28.000.000 | USD | Aquitaine Funding Co. LLC, 0.00%, 01/11/2024 | 27.878 | 0,40 |
| 28.300.000 | USD | BofA Securities, Inc., 0.00%, 15/11/2024 | 28.126 | 0,41 |
| 8.000.000 | USD | BofA Securities, Inc., 0.00%, 25/07/2025 | 7.724 | 0,11 |
| 40.970.000 | USD | BofA Securities, Inc., 0.00%, 19/09/2025 | 39.338 | 0,57 |
| 39.750.000 | USD | Citigroup Global Markets, Inc., 0.00%, 16/06/2025 | 38.541 | 0,56 |
| 19.300.000 | USD | Citigroup Global Markets, Inc., 0.00%, 17/06/2025 | 18.711 | 0,27 |
| 23.750.000 | USD | Consolidated Edison, Inc., 0.00%, 03/10/2024 | 23.740 | 0,34 |
| 42.150.000 | USD | CRH America Finance, Inc., 0.00%, 07/10/2024 | 42.110 | 0,61 |
| 10.000.000 | USD | CRH America Finance, Inc., 0.00%, 21/10/2024 | 9.971 | 0,14 |
| 5.000.000 | USD | CRH America Finance, Inc., 0.00%, 25/10/2024 | 4.983 | 0,07 |
| 9.350.000 | USD | Dominion Energy, Inc., 0.00%, 09/10/2024 | 9.338 | 0,14 |
| 19.475.000 | USD | Henkel Corp., 0.00%, 30/10/2024 | 19.398 | 0,28 |
| 85.750.000 | USD | Hitachi America Capital Ltd., 0.00%, 02/10/2024 | 85.727 | 1,24 |
| 13.000.000 | CAD | Honda Cda Fin Inc Med Term Nts Zero 24, 0.00%, 12/11/2024 | 9.575 | 0,14 |
| 51.000.000 | USD | HP, Inc., 0.00%, 01/10/2024 | 50.993 | 0,74 |
| 14.950.000 | USD | HSBC USA, Inc., 0.00%, 14/02/2025 | 14.688 | 0,21 |
| 23.345.000 | USD | HSBC USA, Inc., 0.00%, 06/06/2025 | 22.639 | 0,33 |
| 15.630.000 | USD | HSBC USA, Inc., 0.00%, 25/06/2025 | 15.117 | 0,22 |
| 11.840.000 | USD | HSBC USA, Inc., 0.00%, 19/08/2025 | 11.379 | 0,17 |
| 7.750.000 | USD | Intercontinental Exchange, Inc., 0.00%, 10/10/2024 | 7.739 | 0,11 |
| 5.500.000 | USD | J.P. Morgan Securities LLC, 5.06%, 03/02/2025 | 5.500 | 0,08 |
| 102.250.000 | USD | Keurig Dr Pepper, Inc., 0.00%, 01/10/2024 | 102.236 | 1,48 |
| 17.000.000 | USD | Keurig Dr Pepper, Inc., 0.00%, 02/10/2024 | 16.995 | 0,25 |
| 3.750.000 | USD | Marriott International, Inc., 0.00%, 09/10/2024 | 3.745 | 0,05 |
| 6.500.000 | USD | Microchip Technology, Inc., 0.00%, 24/10/2024 | 6.478 | 0,09 |
| 14.500.000 | USD | Microchip Technology, Inc., 0.00%, 01/11/2024 | 14.434 | 0,21 |
| 28.750.000 | USD | Mitsubishi HC Finance America LLC, 0.00%, 21/10/2024 | 28.666 | 0,42 |
| 38.250.000 | USD | NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 0.00%, 07/10/2024 | 38.213 | 0,55 |
| 3.250.000 | USD | NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 0.00%, 29/10/2024 | 3.237 | 0,05 |
| 41.750.000 | USD | Penske Truck Leasing Co. LP, 0.00%, 04/10/2024 | 41.727 | 0,61 |
| 7.250.000 | USD | Penske Truck Leasing Co. LP, 0.00%, 11/10/2024 | 7.239 | 0,11 |
| 8.250.000 | USD | Protective Life Corp., 0.00%, 08/01/2025 | 8.143 | 0,12 |
| 4.250.000 | USD | Protective Life Corp., 0.00%, 15/01/2025 | 4.191 | 0,06 |
| 19.289.000 | USD | Ryder System, Inc., 0.00%, 07/10/2024 | 19.271 | 0,28 |
| 39.250.000 | USD | Ryder System, Inc., 0.00%, 09/10/2024 | 39.202 | 0,57 |
| 14.000.000 | USD | Spire, Inc., 0.00%, 03/10/2024 | 13.994 | 0,20 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|---|----------------------|-------------------------------|
| Commercial Papers (Fortsetzung) | | | | |
| Vereinigte Staaten (Fortsetzung) | | | | |
| 11.500.000 | USD | Spire, Inc., 0.00%, 08/10/2024 | 11.487 | 0,17 |
| 24.110.000 | USD | Spire, Inc., 0.00%, 23/10/2024 | 24.033 | 0,35 |
| 19.300.000 | USD | Spire, Inc., 0.00%, 28/10/2024 | 19.225 | 0,28 |
| 51.500.000 | USD | Sysco Corp., 0.00%, 01/10/2024 | 51.493 | 0,75 |
| 35.200.000 | USD | Toyota Industries Commercial Finance, Inc., 0.00%, 04/10/2024 | 35.181 | 0,51 |
| 11.250.000 | USD | Toyota Industries Commercial Finance, Inc., 0.00%, 19/03/2025 | 11.013 | 0,16 |
| 11.000.000 | USD | Vulcan Materials Co., 0.00%, 08/10/2024 | 10.988 | 0,16 |
| 16.000.000 | USD | VW Credit, Inc., 0.00%, 01/10/2024 | 15.998 | 0,23 |
| 2.500.000 | USD | VW Credit, Inc., 0.00%, 07/10/2024 | 2.498 | 0,04 |
| 25.250.000 | USD | VW Credit, Inc., 0.00%, 08/10/2024 | 25.222 | 0,37 |
| 17.000.000 | USD | VW Credit, Inc., 0.00%, 11/10/2024 | 16.974 | 0,25 |
| 19.170.000 | USD | VW Credit, Inc., 0.00%, 18/10/2024 | 19.122 | 0,28 |
| 51.000.000 | USD | VW Credit, Inc., 0.00%, 28/10/2024 | 50.802 | 0,74 |
| 80.000.000 | USD | Western Union Co. (The), 0.00%, 01/10/2024 | 79.989 | 1,16 |
| Vereinigte Staaten - Gesamt | | | 1.309.929 | 19,01 |
| Anlagen in Commercial Papers - Gesamt | | | 3.328.655 | 48,30 |
| Termineinlagen (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| Kanada (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 201.000.000 | USD | Royal Bank of Canada, 4.83%, 01/10/2024 | 201.000 | 2,92 |
| Kanada - Gesamt | | | 201.000 | 2,92 |
| Anlagen in Termineinlagen - Gesamt | | | 201.000 | 2,92 |
| Bankakzepte (30. September 2023: 2,75 %) | | | | |
| Kanada (30. September 2023: 2,75 %) | | | | |
| | | | - | - |
| Anlagen in Bankakzepten - Gesamt | | | - | - |
| ANLEIHEN | | | | |
| Staatsanleihen (30. September 2023: 1,60 %) | | | | |
| Schweden (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 13.000.000 | USD | Kommuninvest I Sverige AB, 2.75%, 01/03/2025 | 12.903 | 0,19 |
| Schweden - Gesamt | | | 12.903 | 0,19 |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 1,60 %) | | | | |
| | | | - | - |
| Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt | | | 12.903 | 0,19 |
| Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2023: 7,97 %) | | | | |
| Australien (30. September 2023: 0,56 %) | | | | |
| 12.540.000 | USD | National Australia Bank Ltd., FRN, 5.42%, 29/01/2026 | 12.561 | 0,18 |
| 25.202.000 | USD | Westpac Banking Corp., FRN, 5.16%, 18/11/2024 | 25.209 | 0,36 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|--|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| ANLEIHEN (Fortsetzung) | | | | |
| Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung) | | | | |
| Australien (Fortsetzung) | | | | |
| 11.470.000 | USD | Westpac Banking Corp., FRN, 5.58%, 17/11/2025 | 11.510 | 0,17 |
| 6.915.000 | USD | Westpac Banking Corp., FRN, 5.42%, 29/01/2026 | 6.918 | 0,10 |
| Australien - Gesamt | | | 56.198 | 0,81 |
| Kanada (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 35.000.000 | CAD | Bank of Nova Scotia (The), 0.00%, 21/10/2024 | 25.849 | 0,37 |
| 19.674.000 | CAD | Sumitomo Mitsui Banking Corp. of Canada, 0.00%, 28/10/2024 | 14.509 | 0,21 |
| 25.000.000 | CAD | Sumitomo Mitsui Banking Corp. of Canada, 0.00%, 18/11/2024 | 18.391 | 0,27 |
| 25.000.000 | USD | Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 5.55%, 29/08/2025 | 25.013 | 0,36 |
| Kanada - Gesamt | | | 83.762 | 1,21 |
| Frankreich (30. September 2023: 0,34 %) | | | | |
| 15.000.000 | USD | Societe Generale SA, FRN, 5.93%, 29/09/2025 | 15.044 | 0,22 |
| Frankreich - Gesamt | | | 15.044 | 0,22 |
| Japan (30. September 2023: 1,36 %) | | | | |
| 20.000.000 | CAD | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 22/10/2024 | 14.760 | 0,22 |
| 20.000.000 | CAD | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 25/10/2024 | 14.755 | 0,21 |
| 25.000.000 | CAD | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 17/12/2024 | 18.334 | 0,27 |
| 20.000.000 | CAD | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 04/11/2024 | 14.737 | 0,21 |
| Japan - Gesamt | | | 62.586 | 0,91 |
| Niederlande (30. September 2023: 0,27 %) | | | | |
| 20.000.000 | USD | BNG Bank NV, 5.15%, 28/02/2025 | 20.017 | 0,29 |
| 12.200.000 | USD | Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 5.59%, 18/07/2025 | 12.237 | 0,18 |
| 12.600.000 | USD | Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 5.60%, 09/01/2026 | 12.650 | 0,18 |
| Niederlande - Gesamt | | | 44.904 | 0,65 |
| Singapur (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 2.778.000 | USD | Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd., 4.65%, 19/05/2025 | 2.781 | 0,04 |
| Singapur - Gesamt | | | 2.781 | 0,04 |
| Schweiz (30. September 2023: 0,24 %) | | | | |
| 7.124.000 | USD | UBS AG, 1.38%, 13/01/2025 | 7.047 | 0,10 |
| 9.852.000 | USD | UBS AG, 2.95%, 09/04/2025 | 9.754 | 0,14 |
| 10.850.000 | USD | UBS AG, FRN, 5.78%, 11/09/2025 | 10.908 | 0,16 |
| Schweiz - Gesamt | | | 27.709 | 0,40 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 0,00 %) | | | | |
| 13.500.000 | CAD | Sumitomo Mitsui Banking Corp. Europe Ltd., 0.00%, 09/10/2024 | 9.984 | 0,15 |
| Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | 9.984 | 0,15 |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 5,20 %) | | | | |
| 4.290.000 | USD | AbbVie, Inc., 2.60%, 21/11/2024 | 4.275 | 0,06 |
| 11.080.000 | USD | Amazon.com, Inc., 0.80%, 03/06/2025 | 10.820 | 0,16 |
| 46.071.000 | USD | American Express Co., FRN, 4.99%, 01/05/2026 | 46.119 | 0,67 |
| 10.000.000 | USD | American Honda Finance Corp., FRN, 5.66%, 23/04/2025 | 10.023 | 0,14 |
| 25.855.000 | USD | American Honda Finance Corp., FRN, 5.47%, 14/08/2025 | 25.900 | 0,38 |
| 10.000.000 | USD | American Honda Finance Corp., FRN, 5.69%, 03/10/2025 | 10.036 | 0,15 |
| 15.075.000 | USD | American Honda Finance Corp., FRN, 5.40%, 12/01/2026 | 15.078 | 0,22 |
| 34.970.000 | USD | Bank of America Corp., FRN, 3.37%, 23/01/2026 | 34.775 | 0,50 |

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| ANLEIHEN (Fortsetzung) | | | | |
| Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung) | | | | |
| Vereinigte Staaten (Fortsetzung) | | | | |
| 7.315.000 | USD | Bank of New York Mellon (The), FRN, 5.30%, 13/03/2026 | 7.320 | 0,11 |
| 24.571.000 | USD | Bank of New York Mellon Corp. (The), 2.10%, 24/10/2024 | 24.526 | 0,35 |
| 16.030.000 | USD | BMW US Capital LLC, FRN, 5.66%, 13/08/2026 | 16.090 | 0,23 |
| 6.595.000 | USD | Bristol-Myers Squibb Co., FRN, 5.35%, 20/02/2026 | 6.613 | 0,10 |
| 18.010.000 | USD | Citibank NA, FRN, 5.46%, 30/04/2026 | 18.021 | 0,26 |
| 8.250.000 | USD | Citibank NA, FRN, 5.58%, 06/08/2026 | 8.273 | 0,12 |
| 6.148.000 | USD | Citigroup, Inc., FRN, 2.01%, 25/01/2026 | 6.086 | 0,09 |
| 45.000.000 | USD | Citigroup, Inc., FRN, 3.11%, 08/04/2026 | 44.556 | 0,65 |
| 22.220.000 | USD | Intercontinental Exchange, Inc., 3.65%, 23/05/2025 | 22.056 | 0,32 |
| 4.074.000 | USD | John Deere Capital Corp., 4.95%, 06/06/2025 | 4.091 | 0,06 |
| 19.865.000 | USD | John Deere Capital Corp., FRN, 5.39%, 03/07/2025 | 19.906 | 0,29 |
| 7.665.000 | USD | John Deere Capital Corp., FRN, 5.36%, 22/10/2025 | 7.678 | 0,11 |
| 13.750.000 | USD | John Deere Capital Corp., FRN, 5.29%, 06/03/2026 | 13.762 | 0,20 |
| 29.217.000 | USD | JPMorgan Chase & Co., FRN, 2.60%, 24/02/2026 | 28.929 | 0,42 |
| 96.768.000 | USD | JPMorgan Chase & Co., FRN, 2.08%, 22/04/2026 | 95.224 | 1,38 |
| 9.010.000 | USD | Mercedes-Benz Finance North America LLC, 5.50%, 27/11/2024 | 9.013 | 0,13 |
| 15.000.000 | USD | Mercedes-Benz Finance North America LLC, 3.30%, 19/05/2025 | 14.888 | 0,22 |
| 4.832.000 | USD | Mercedes-Benz Finance North America LLC, 5.38%, 01/08/2025 | 4.861 | 0,07 |
| 34.800.000 | USD | Mercedes-Benz Finance North America LLC, FRN, 5.44%, 01/08/2025 | 34.863 | 0,51 |
| 15.940.000 | USD | Mercedes-Benz Finance North America LLC, FRN, 5.50%, 31/07/2026 | 15.961 | 0,23 |
| 14.030.000 | USD | Microsoft Corp., 2.70%, 12/02/2025 | 13.936 | 0,20 |
| 35.000.000 | USD | Morgan Stanley, 3.70%, 23/10/2024 | 34.966 | 0,51 |
| 10.984.000 | USD | Morgan Stanley, FRN, 1.16%, 21/10/2025 | 10.962 | 0,16 |
| 10.955.000 | USD | Morgan Stanley Bank NA, FRN, 5.80%, 16/07/2025 | 10.993 | 0,16 |
| 9.000.000 | USD | National Rural Utilities Cooperative Finance Corp., FRN, 5.58%, 07/05/2025 | 9.018 | 0,13 |
| 20.625.000 | USD | National Securities Clearing Corp., 5.05%, 21/11/2024 | 20.622 | 0,30 |
| 14.200.000 | USD | New York Life Global Funding, FRN, 5.55%, 13/06/2025 | 14.236 | 0,21 |
| 12.000.000 | USD | Northwestern Mutual Global Funding, FRN, 5.55%, 13/06/2025 | 12.034 | 0,17 |
| 6.315.000 | USD | PepsiCo, Inc., FRN, 5.26%, 12/11/2024 | 6.317 | 0,09 |
| 15.000.000 | USD | Protective Life Global Funding, FRN, 5.60%, 10/04/2026 | 15.037 | 0,22 |
| 15.000.000 | USD | Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.22%, 18/10/2024 | 14.970 | 0,22 |
| 11.925.000 | USD | Toyota Motor Credit Corp., FRN, 5.33%, 09/12/2024 | 11.930 | 0,17 |
| 26.420.000 | USD | Toyota Motor Credit Corp., FRN, 5.13%, 24/02/2025 | 26.415 | 0,38 |
| 15.700.000 | USD | Toyota Motor Credit Corp., FRN, 5.32%, 15/05/2026 | 15.695 | 0,23 |
| 9.395.000 | USD | UnitedHealth Group, Inc., FRN, 5.39%, 15/07/2026 | 9.424 | 0,14 |
| 29.590.000 | USD | Wells Fargo Bank NA, FRN, 5.68%, 01/08/2025 | 29.660 | 0,43 |
| 10.000.000 | USD | Wells Fargo Bank NA, FRN, 5.59%, 15/01/2026 | 10.028 | 0,14 |
| | | Vereinigte Staaten - Gesamt | 825.986 | 11,99 |
| Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt | | | 1.128.954 | 16,38 |
| Anlagen in Anleihen - Gesamt | | | 1.141.857 | 16,57 |

| Beschreibung | Kontrahent | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|--|-----------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------|
| Devisenterminkontrakte¹ | | | | |
| Buy USD 18,678,357; Sell CAD 25,167,685 | UBS | 23.10.2024 | 39 | – |
| Buy USD 61,092; Sell CAD 82,315 ² | Toronto-Dominion Bank | 23.10.2024 | – | – |
| Buy USD 14,596,091; Sell CAD 19,596,091 | State Street | 28.10.2024 | 81 | – |
| Buy USD 58,030; Sell CAD 77,909 ² | Toronto-Dominion Bank | 28.10.2024 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn - Gesamt (30. September 2023: 0,02 %) | | | 120 | – |

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Beschreibung | Kontrahent | Fälligkeits-termin | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto-inventarwerts |
|---|-----------------------|--------------------|-------------------|---------------------------|
| Devisenterminkontrakte¹ (Fortsetzung) | | | | |
| Anteilklasse Heritage (CHF Hedged) | | | | |
| Buy CHF 42,942,723; Sell USD 50,779,574 | State Street | 02.10.2024 | 128 | – |
| Buy USD 2,679,614; Sell CHF 2,250,412 | State Street | 02.10.2024 | 12 | – |
| Nicht realisierter Gewinn - Gesamt (30. September 2023: 0,00 %)³ | | | 140 | – |
| Anteilklasse Heritage (SGD Hedged) | | | | |
| Buy SGD 20,926,003; Sell USD 16,081,403 | State Street | 02.10.2024 | 242 | 0,01 |
| Nicht realisierter Gewinn - Gesamt (30. September 2023: 0,00 %)³ | | | 242 | 0,01 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2023: 0,02 %) | | | 502 | 0,01 |
| Devisenterminkontrakte¹ | | | | |
| Buy USD 115,498; Sell CAD 157,140 | Toronto-Dominion Bank | 09.10.2024 | (1) | – |
| Buy USD 9,807,062; Sell CAD 13,342,860 | State Street | 09.10.2024 | (71) | – |
| Buy USD 14,681,407; Sell CAD 20,000,000 | State Street | 22.10.2024 | (130) | – |
| Buy USD 612,231; Sell CAD 834,400 | Toronto-Dominion Bank | 24.10.2024 | (6) | – |
| Buy USD 25,069,127; Sell CAD 34,165,600 | State Street | 24.10.2024 | (234) | (0,01) |
| Buy USD 163,506; Sell CAD 225,400 | UBS | 25.10.2024 | (3) | – |
| Buy USD 14,346,826; Sell CAD 19,774,600 | Citibank | 25.10.2024 | (299) | (0,01) |
| Buy USD 236,266; Sell CAD 321,600 | NatWest Markets | 04.11.2024 | (2) | – |
| Buy USD 14,457,034; Sell CAD 19,678,400 | State Street | 04.11.2024 | (121) | – |
| Buy USD 103,037; Sell CAD 140,790 | NatWest Markets | 12.11.2024 | (1) | – |
| Buy USD 9,411,457; Sell CAD 12,859,210 | Toronto-Dominion Bank | 12.11.2024 | (117) | – |
| Buy USD 130,667; Sell CAD 177,250 | Goldman Sachs | 18.11.2024 | (1) | – |
| Buy USD 18,298,657; Sell CAD 24,822,750 | State Street | 18.11.2024 | (97) | – |
| Buy USD 127,516; Sell CAD 173,012 | Goldman Sachs | 17.12.2024 | (1) | – |
| Buy USD 12,181,846; Sell CAD 16,526,988 | Citibank | 17.12.2024 | (76) | – |
| Buy USD 18,415,466; Sell CAD 25,000,000 | NatWest Markets | 17.12.2024 | (126) | – |
| Nicht realisierter Verlust - Gesamt (30. September 2023: (0,02) %) | | | (1.286) | (0,02) |
| Anteilklasse Heritage (CHF Hedged) | | | | |
| Buy USD 15,594,950; Sell CHF 13,183,911 | State Street | 02.10.2024 | (34) | – |
| Nicht realisierter Verlust - Gesamt (30. September 2023: (0,06) %) | | | (34) | – |
| Anteilklasse Heritage (SGD Hedged) | | | | |
| Nicht realisierter Verlust - Gesamt (30. September 2023: 0,00 %)³ | | | – | – |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2023: (0,08) %) | | | (1.320) | (0,02) |

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|-------------------------|-------------------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt | 6.566.068 | 95,28 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt | (1.320) | (0,02) |
| Zahlungsmittel | 15.811 | 0,23 |
| Zahlungsmitteläquivalente | | |
| Bestand Währung Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (30. September 2023: 4,43 %) | | |
| 308.081.696 USD BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Dis) ⁴ | 308.082 | 4,47 |
| Zahlungsmitteläquivalente - Gesamt | <u>308.082</u> | <u>4,47</u> |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | 2.614 | 0,04 |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert | <u>6.891.255</u> | <u>100,00</u> |

Analyse des Gesamtvermögens

| | % des Gesamt- vermögens |
|---|-------------------------------|
| Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 2,36 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 13,91 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c) | 77,28 |
| Investmentfonds (CIS) | 4,39 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 0,01 |
| Sonstige Vermögenswerte | <u>2,05</u> |
| Gesamtvermögen | <u>100,00</u> |

¹Devisenterminkontrakte, die bei einem Kontrahenten mit der gleichen Kaufwährung, Verkaufswährung und Fälligkeit gehalten werden, werden gegebenenfalls als Summe ausgewiesen. Aktiv- und Passivpositionen werden nicht verrechnet.

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

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

⁴Dem Fonds nahestehende Partei.

| Derivative Finanzinstrumente | Basisengagement Tsd. USD |
|-------------------------------------|-------------------------------------|
| Devisenterminkontrakte | 252.582 |

BLACKROCK ICS US TREASURY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Investitionen | Zeitwert Tsd. USD | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--|----------------------|-------------------------------|
| ANLEIHEN | | | | |
| Staatsanleihen (30. September 2023: 42,52 %) | | | | |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 42,52 %) | | | | |
| 34.020.000 | USD | US Treasury, 1.50%, 31/10/2024 | 33.920 | 0,12 |
| 30.050.000 | USD | US Treasury, 2.25%, 31/12/2024 | 29.848 | 0,10 |
| 60.960.000 | USD | US Treasury, 1.13%, 28/02/2025 | 60.013 | 0,21 |
| 75.943.000 | USD | US Treasury, 2.75%, 28/02/2025 | 75.250 | 0,26 |
| 5.570.000 | USD | US Treasury, 3.88%, 31/03/2025 | 5.539 | 0,02 |
| 737.040.000 | USD | US Treasury, FRN, 4.73%, 31/10/2024 | 737.086 | 2,54 |
| 319.475.000 | USD | US Treasury, FRN, 4.79%, 31/01/2025 | 319.519 | 1,10 |
| 500.000.000 | USD | US Treasury, FRN, 4.76%, 30/04/2025 | 500.301 | 1,72 |
| 814.475.000 | USD | US Treasury, FRN, 4.72%, 31/07/2025 | 814.360 | 2,81 |
| 354.000.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 01/10/2024 ¹ | 354.000 | 1,22 |
| 256.000.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 03/10/2024 ¹ | 255.926 | 0,88 |
| 600.000.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 08/10/2024 ¹ | 599.394 | 2,06 |
| 645.757.600 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 10/10/2024 ¹ | 644.918 | 2,22 |
| 63.500.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 15/10/2024 ¹ | 63.371 | 0,22 |
| 336.600.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 17/10/2024 ¹ | 335.833 | 1,16 |
| 1.352.900.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 22/10/2024 ¹ | 1.348.876 | 4,65 |
| 122.563.600 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 24/10/2024 ¹ | 122.160 | 0,42 |
| 898.855.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 29/10/2024 ¹ | 895.468 | 3,09 |
| 407.981.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 31/10/2024 ¹ | 406.232 | 1,40 |
| 727.200.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 05/11/2024 ¹ | 723.614 | 2,49 |
| 1.496.388.400 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 07/11/2024 ¹ | 1.489.007 | 5,13 |
| 90.645.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 12/11/2024 ¹ | 90.104 | 0,31 |
| 311.100.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 14/11/2024 ¹ | 309.137 | 1,06 |
| 97.939.900 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 19/11/2024 ¹ | 97.256 | 0,33 |
| 772.855.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 21/11/2024 ¹ | 767.251 | 2,64 |
| 448.585.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 26/11/2024 ¹ | 445.128 | 1,53 |
| 647.458.400 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 29/11/2024 ¹ | 642.088 | 2,21 |
| 239.118.600 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 03/12/2024 ¹ | 236.995 | 0,82 |
| 342.040.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 05/12/2024 ¹ | 338.896 | 1,17 |
| 354.105.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 10/12/2024 ¹ | 350.669 | 1,21 |
| 321.545.900 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 12/12/2024 ¹ | 318.398 | 1,10 |
| 411.600.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 17/12/2024 ¹ | 407.216 | 1,40 |
| 334.785.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 19/12/2024 ¹ | 331.001 | 1,14 |
| 84.366.300 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 24/12/2024 ¹ | 83.398 | 0,29 |
| 335.415.600 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 26/12/2024 ¹ | 331.444 | 1,14 |
| 390.800.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 31/12/2024 ¹ | 386.002 | 1,33 |
| 380.800.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 02/01/2025 ¹ | 376.202 | 1,30 |
| 379.700.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 07/01/2025 ¹ | 374.728 | 1,29 |
| 163.540.100 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 09/01/2025 ¹ | 161.232 | 0,56 |
| 344.795.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 14/01/2025 ¹ | 340.028 | 1,17 |
| 342.540.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 21/01/2025 ¹ | 337.593 | 1,16 |
| 132.363.700 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 23/01/2025 ¹ | 130.446 | 0,45 |
| 269.660.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 28/01/2025 ¹ | 265.711 | 0,92 |
| 134.400.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 30/01/2025 ¹ | 132.173 | 0,45 |
| 182.400.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 13/02/2025 ¹ | 179.126 | 0,62 |
| 256.186.400 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 20/02/2025 ¹ | 251.410 | 0,87 |
| 188.572.500 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 03/04/2025 ¹ | 184.554 | 0,64 |
| 192.000.000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 10/07/2025 ¹ | 184.818 | 0,64 |
| Vereinigte Staaten - Gesamt | | | 17.867.639 | 61,57 |
| Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt | | | 17.867.639 | 61,57 |
| Anlagen in Anleihen - Gesamt | | | 17.867.639 | 61,57 |

BLACKROCK ICS US TREASURY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2024

| Bestand | Währung | Kontrahent | Zinssätze | Fälligkeits- termin | Zeitwert Tsd. EUR | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------|--------------------------------|-----------|------------------------|----------------------|-------------------------------|
| Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2023: 55,67 %) | | | | | | |
| Kanada (30. September 2023: 7,99 %) | | | | | | |
| 1.800.000.000 | USD | TD Securities (USA) LLC | 4,88 % | 01.10.2024 | 1.800.000 | 6,20 |
| Kanada - Gesamt | | | | | 1.800.000 | 6,20 |
| Frankreich (30. September 2023: 30,09 %) | | | | | | |
| 2.850.000.000 | USD | BNP Paribas SA | 4,87 % | 01.10.2024 | 2.850.000 | 9,82 |
| 190.000.000 | USD | BNP Paribas SA | 4,87 % | 01.10.2024 | 190.000 | 0,65 |
| 1.037.000.000 | USD | Credit Agricole SA | 4,88 % | 01.10.2024 | 1.037.000 | 3,57 |
| 290.000.000 | USD | Credit Agricole SA | 4,88 % | 01.10.2024 | 290.000 | 1,00 |
| 1.125.000.000 | USD | Natixis SA | 4,88 % | 01.10.2024 | 1.125.000 | 3,88 |
| 1.173.000.000 | USD | Societe Generale SA | 4,88 % | 01.10.2024 | 1.173.000 | 4,04 |
| Frankreich - Gesamt | | | | | 6.665.000 | 22,96 |
| Vereinigtes Königreich (30. September 2023: 2,22 %) | | | | | | |
| 1.012.000.000 | USD | Bank of Nova Scotia plc | 4,86 % | 01.10.2024 | 1.012.000 | 3,49 |
| 155.000.000 | USD | Citigroup Global Markets, Inc. | 4,87 % | 01.10.2024 | 155.000 | 0,53 |
| 72.000.000 | USD | Citigroup Global Markets, Inc. | 4,87 % | 01.10.2024 | 72.000 | 0,25 |
| 1.765.000.000 | USD | Wells Fargo Securities LLC | 4,88 % | 01.10.2024 | 1.765.000 | 6,08 |
| Vereinigtes Königreich - Gesamt | | | | | 3.004.000 | 10,35 |
| Vereinigte Staaten (30. September 2023: 15,37 %) | | | | | | |
| 402.000.000 | USD | Bofa Securities Inc. | 4,87 % | 01.10.2024 | 402.000 | 1,39 |
| 295.000.000 | USD | Bofa Securities Inc. | 4,87 % | 01.10.2024 | 295.000 | 1,02 |
| Vereinigte Staaten - Gesamt | | | | | 697.000 | 2,41 |
| Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt | | | | | 12.166.000 | 41,92 |
| | | | | | Zeitwert | % des Netto- |
| | | | | | Tsd. USD | inventarwerts |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt | | | | | 30.033.639 | 103,49 |
| Zahlungsmittel | | | | | 506.027 | 1,74 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | | | | (1.519.271) | (5,23) |
| Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert | | | | | 29.020.395 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | | | | % des |
| Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | | | | | Gesamt- |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | | | | | | vermögens |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | | 1,83 |
| Gesamtvermögen | | | | | | 100,00 |

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

BLACKROCK ICS EURO GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| Käufe | | |
|-----------------|---|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Kosten Tsd. EUR |
| 316.500.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 14/11/2024 | 310.926 |
| 300.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 05/06/2024 | 297.241 |
| 225.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 28/08/2024 | 223.083 |
| 140.000.000 | Kingdom of the Netherlands, 0.00%, 29/07/2024 | 139.800 |
| 140.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 23/05/2024 | 138.728 |
| 125.000.000 | Kingdom of the Netherlands, 0.00%, 23/10/2024 | 124.644 |
| 125.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 16/10/2024 | 122.772 |
| 100.000.000 | Republic of Austria, 0.00%, 02/05/2024 | 99.677 |
| 100.000.000 | Republic of Austria, 0.00%, 04/11/2024 | 99.415 |
| 100.000.000 | Republic of Austria, 0.00%, 04/09/2024 | 99.068 |
| 100.000.000 | European Union Bill, 0.00%, 06/09/2024 | 98.501 |
| 80.000.000 | Republic of Austria, 0.00%, 02/04/2024 | 79.776 |
| 75.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 24/04/2024 | 74.277 |
| 75.000.000 | European Union Bill, 0.00%, 08/11/2024 | 73.901 |
| 73.108.000 | European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 19/09/2024 | 71.777 |
| 62.700.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 04/01/2024 | 62.117 |
| 60.000.000 | European Union Bill, 0.00%, 04/10/2024 | 59.028 |
| 50.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 04/12/2024 | 49.601 |
| 50.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 08/01/2025 | 49.563 |
| 50.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 20/11/2024 | 49.560 |
| 50.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 03/07/2024 | 49.556 |
| 50.000.000 | Belgium Treasury Bill, 0.00%, 09/01/2025 | 49.461 |
| 50.000.000 | European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 17/10/2024 | 49.079 |
| 50.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 11/12/2024 | 49.062 |
| 45.000.000 | European Union Bill, 0.00%, 10/05/2024 | 44.643 |
| 41.100.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 17/01/2024 | 40.724 |
| 40.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 10/04/2024 | 39.623 |
| 35.000.000 | Republic of Austria, 0.00%, 09/08/2024 | 34.950 |
| 35.000.000 | Republic of Austria, 0.00%, 21/10/2024 | 34.897 |
| 35.000.000 | Republic of Austria, 0.00%, 09/09/2024 | 34.890 |
| Verkäufe | | |
| Menge | Investitionen | Erlöse Tsd. EUR |
| 100.000.000 | European Union Bill, 0.00%, 06/09/2024 | 99.742 |
| 75.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 24/04/2024 | 74.945 |
| 36.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 17/01/2024 | 35.952 |

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

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| Käufe | | |
|--------------|---|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Kosten Tsd. EUR |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 01/11/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 25/10/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 20/10/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 14/11/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 04/10/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 17/10/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 24/11/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 17/11/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 29/11/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 01/12/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 05/10/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 05/12/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 19/12/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 22/12/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 03/10/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 07/12/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 06/10/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 10/10/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 11/10/2023 | 249.973 |
| 250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 12/10/2023 | 249.973 |

| Verkäufe | | |
|-----------------|---|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Erlöse Tsd. EUR |
| 117.000.000 | Credit Agricole SA, 0.00%, 10/04/2024 | 116.486 |
| 60.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 28/06/2024 | 59.852 |
| 57.500.000 | HSBC Continental Europe SA, 0.00%, 14/10/2024 | 56.708 |
| 32.000.000 | Toronto-Dominion Bank (The), 4.41%, 17/06/2024 | 32.008 |
| 31.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 18/06/2024 | 30.960 |
| 30.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 17/06/2024 | 29.956 |
| 22.500.000 | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 12/02/2024 | 22.493 |
| 20.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 29/04/2024 | 19.882 |
| 16.000.000 | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 02/04/2024 | 15.938 |
| 10.000.000 | NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 09/07/2024 | 9.965 |

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

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| Käufe | | |
|---------------|---|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Kosten Tsd. EUR |
| 1.937.300.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 04/01/2024 | 1.919.300 |
| 1.500.000.000 | Kingdom of the Netherlands, 0.00%, 10/09/2024 | 1.498.927 |
| 1.500.000.000 | Kingdom of Nether, 0.00%, 19/01/2024 | 1.498.858 |
| 1.495.000.000 | Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 0.00%, 12/08/2024 | 1.493.928 |
| 1.495.000.000 | Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 0.00%, 12/09/2024 | 1.490.271 |
| 1.350.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 03/10/2023 | 1.349.854 |
| 1.300.000.000 | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 05/06/2024 | 1.291.422 |
| 1.250.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 04/10/2023 | 1.249.865 |
| 1.258.900.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 17/01/2024 | 1.247.357 |
| 1.225.000.000 | Kingdom of the Netherlands, 0.00%, 23/10/2024 | 1.221.580 |
| 1.200.000.000 | Kingdom of the Netherlands, 0.00%, 25/07/2024 | 1.198.285 |
| 1.050.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 05/10/2023 | 1.049.887 |
| 1.000.000.000 | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 31/01/2024 | 999.238 |
| 1.000.000.000 | NRW. Bank, 0.00%, 08/03/2024 | 999.238 |
| 1.000.000.000 | NRW. Bank, 0.00%, 21/05/2024 | 999.236 |
| 1.000.000.000 | NRW. Bank, 0.00%, 14/05/2024 | 999.234 |
| 1.000.000.000 | Jyske Bank A/S, 0.00%, 24/07/2024 | 998.563 |
| 1.000.000.000 | Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 0.00%, 07/03/2024 | 998.490 |
| 1.000.000.000 | Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 0.00%, 08/02/2024 | 998.482 |
| 1.000.000.000 | Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 0.00%, 22/02/2024 | 998.480 |

| Verkäufe | | |
|-----------------|---|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Erlöse Tsd. EUR |
| 797.900.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 17/01/2024 | 796.112 |
| 496.000.000 | HSBC Continental Europe SA, 0.00%, 14/10/2024 | 489.166 |
| 441.500.000 | Belfius Bank SA, 0.00%, 31/01/2024 | 441.064 |
| 400.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 14/02/2024 | 398.991 |
| 383.000.000 | Credit Agricole SA, 0.00%, 10/04/2024 | 381.318 |
| 328.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 10/01/2024 | 327.417 |
| 325.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 31/01/2024 | 323.939 |
| 318.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 18/06/2024 | 317.597 |
| 295.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 17/06/2024 | 294.570 |
| 250.000.000 | KBC Bank NV, 0.00%, 31/10/2023 | 249.700 |
| 249.500.000 | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 13/02/2024 | 248.899 |
| 225.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 20/11/2023 | 224.358 |
| 224.000.000 | Mitsubishi Corporation Finance plc, 0.00%, 05/01/2024 | 222.909 |
| 219.000.000 | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 02/04/2024 | 218.149 |
| 218.000.000 | Toronto-Dominion Bank (The), 4.41%, 17/06/2024 | 218.053 |
| 200.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 22/01/2024 | 199.630 |
| 200.000.000 | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 05/04/2024 | 199.481 |
| 180.000.000 | La Banque Postale SA, 0.00%, 29/04/2024 | 178.934 |
| 150.000.000 | Norinchukin Bank (The), 0.00%, 20/02/2024 | 149.524 |
| 140.000.000 | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 11/01/2024 | 139.893 |
| 140.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 28/06/2024 | 139.656 |
| 100.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 05/02/2024 | 99.847 |
| 75.000.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 24/04/2024 | 74.945 |

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

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| Käufe | | |
|--------------|--|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Kosten Tsd. EUR |
| 7.286.494 | BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0) | 750.000 |
| 150.000.000 | Purple Protected Asset, FRN, 3.49%, 18/09/2025 | 150.000 |
| 150.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 06/01/2025 | 147.728 |
| 145.000.000 | Belfius Bank SA, FRN, 3.87%, 17/09/2026 | 145.000 |
| 150.000.000 | Credit Agricole SA, 0.00%, 28/02/2025 | 144.435 |
| 150.000.000 | Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 31/10/2024 | 144.065 |
| 140.000.000 | Standard Chartered Bank, 0.00%, 12/05/2025 | 134.912 |
| 130.000.000 | Banco Santander SA, 0.00%, 02/04/2025 | 127.956 |
| 107.400.000 | NatWest Markets plc, FRN, 4.31%, 09/01/2026 | 107.400 |
| 106.000.000 | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 04/11/2024 | 103.896 |
| 100.000.000 | Nationwide Building Society, FRN, 4.08%, 10/11/2025 | 100.000 |
| 100.000.000 | Realty Income Corp., 0.00%, 20/03/2024 | 99.665 |
| 100.000.000 | Realty Income Corp., 0.00%, 20/11/2023 | 99.621 |
| 100.000.000 | BASF SE, 0.00%, 31/07/2024 | 99.400 |
| 100.000.000 | National Grid North America, Inc., 0.00%, 02/01/2024 | 99.316 |
| 100.000.000 | Jyske Bank A/S, 0.00%, 28/05/2024 | 99.314 |
| 100.000.000 | Realty Income Corp., 0.00%, 20/05/2024 | 99.293 |
| 100.000.000 | Realty Income Corp., 0.00%, 20/02/2024 | 98.938 |
| 100.000.000 | UBS AG, 0.00%, 09/06/2025 | 96.403 |
| 100.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 07/03/2025 | 96.300 |

| Verkäufe | | |
|-----------------|--|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Erlöse Tsd. EUR |
| 6.321.265 | BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0) | 650.223 |
| 211.000.000 | Macquarie Bank Ltd., FRN, 4.61%, 20/10/2023 | 211.029 |
| 144.000.000 | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 08/12/2023 | 143.968 |
| 125.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 17/11/2023 | 124.877 |
| 100.000.000 | Royal Bank of Scotland International Ltd. (The), 0.00%, 01/11/2023 | 99.870 |
| 87.000.000 | OP Corporate Bank plc, FRN, 4.92%, 17/05/2024 | 87.064 |
| 67.000.000 | Deutsche Bank AG, 0.00%, 05/04/2024 | 66.883 |
| 62.000.000 | HSBC Continental Europe SA, FRN, 4.91%, 28/06/2024 | 62.062 |
| 60.000.000 | DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main, FRN, 3.96%, 28/02/2025 | 60.089 |
| 50.000.000 | Royal Bank of Scotland International Ltd. (The), 0.00%, 04/06/2024 | 49.862 |
| 15.000.000 | Heineken NV, 0.00%, 27/06/2024 | 14.975 |

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

BLACKROCK ICS STERLING GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| Käufe | | | Kosten |
|-------------|-------------------------------------|--|----------|
| Menge | Investitionen | | Tsd. GBP |
| 656.918.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 25/11/2024 | | 643.838 |
| 302.100.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 19/08/2024 | | 298.133 |
| 300.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 16/12/2024 | | 292.425 |
| 250.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 23/09/2024 | | 246.683 |
| 251.278.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 05/08/2024 | | 245.219 |
| 236.647.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 30/12/2024 | | 230.690 |
| 220.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 28/05/2024 | | 215.554 |
| 218.468.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 29/07/2024 | | 214.049 |
| 205.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 05/02/2024 | | 203.168 |
| 201.119.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 09/09/2024 | | 198.607 |
| 180.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 10/06/2024 | | 176.900 |
| 163.697.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 04/11/2024 | | 160.707 |
| 150.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 19/02/2024 | | 148.045 |
| 140.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 26/02/2024 | | 138.171 |
| 137.900.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 27/08/2024 | | 135.213 |
| 125.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 20/05/2024 | | 121.770 |
| 120.450.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 13/11/2023 | | 119.966 |
| 120.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 20/11/2023 | | 119.518 |
| 120.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 03/06/2024 | | 118.449 |
| 110.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 01/07/2024 | | 108.595 |
| 100.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 06/11/2023 | | 99.599 |
| 100.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 04/12/2023 | | 99.598 |
| 100.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 02/01/2024 | | 99.587 |
| 100.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 08/01/2024 | | 98.683 |
| 100.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 27/01/2025 | | 97.520 |
| 91.927.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 08/07/2024 | | 89.597 |
| 85.400.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 16/09/2024 | | 84.326 |
| 78.628.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 22/07/2024 | | 77.815 |
| 75.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 12/02/2024 | | 74.319 |
| 75.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 07/05/2024 | | 73.030 |
| 65.934.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 08/04/2024 | | 65.083 |
| 61.379.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 27/11/2023 | | 61.132 |
| 60.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 22/01/2024 | | 59.210 |
| 60.000.000 | UK Treasury Bill, 0.00%, 15/01/2024 | | 59.209 |

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

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| Käufe | | |
|--------------|---|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Kosten Tsd. GBP |
| 200.000.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.46%, 05/03/2024 | 200.000 |
| 200.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 05/04/2024 | 197.343 |
| 180.000.000 | Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 16/01/2024 | 178.153 |
| 170.000.000 | Toronto-Dominion Bank (The), 5.74%, 01/11/2024 | 170.000 |
| 150.000.000 | ABN AMRO Bank NV, 0.00%, 21/02/2025 | 145.969 |
| 144.000.000 | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 27/03/2024 | 143.396 |
| 144.000.000 | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 27/02/2024 | 142.049 |
| 138.000.000 | Matchpoint Finance plc, 0.00%, 27/06/2024 | 136.160 |
| 130.000.000 | ING Bank NV, 0.00%, 19/02/2025 | 126.136 |
| 125.000.000 | National Westminster Bank plc, 0.00%, 06/11/2023 | 124.876 |
| 125.000.000 | National Westminster Bank plc, 0.00%, 30/10/2023 | 124.876 |
| 125.000.000 | National Westminster Bank plc, 0.00%, 16/10/2023 | 124.876 |
| 125.000.000 | National Westminster Bank plc, 0.00%, 23/10/2023 | 124.876 |
| 120.000.000 | Mizuho Bank Ltd., 5.45%, 05/03/2024 | 120.000 |
| 120.000.000 | Royal Bank of Canada, FRN, 5.30%, 08/07/2025 | 120.000 |
| 112.500.000 | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 0.00%, 06/01/2025 | 109.794 |
| 112.500.000 | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 0.00%, 08/01/2025 | 109.763 |
| 107.000.000 | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 0.00%, 01/02/2024 | 105.343 |
| 105.000.000 | Nordea Bank Abp, 0.00%, 25/07/2024 | 102.185 |
| 104.000.000 | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 0.00%, 11/07/2024 | 101.288 |

| Verkäufe | | |
|-----------------|---|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Erlöse Tsd. GBP |
| 50.000.000 | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 07/10/2024 | 49.919 |

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

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| Käufe | | |
|---------------|--|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Kosten Tsd. GBP |
| 1.356.000.000 | Nationwide Building Society, 5.18%, 15/04/2024 | 1.356.000 |
| 1.354.000.000 | Nationwide Building Society, 5.20%, 03/07/2024 | 1.354.000 |
| 1.353.000.000 | Nationwide Building Society, 5.20%, 28/05/2024 | 1.353.000 |
| 1.352.000.000 | Nationwide Building Society, 5.20%, 22/05/2024 | 1.352.000 |
| 1.351.000.000 | Nationwide Building Society, 5.20%, 16/05/2024 | 1.351.000 |
| 1.348.000.000 | Nationwide Building Society, 5.19%, 25/04/2024 | 1.348.000 |
| 1.348.000.000 | Nationwide Building Society, 5.19%, 30/04/2024 | 1.348.000 |
| 1.348.000.000 | Nationwide Building Society, 5.20%, 07/05/2024 | 1.348.000 |
| 1.347.000.000 | Nationwide Building Society, 5.20%, 12/07/2024 | 1.347.000 |
| 1.347.000.000 | Nationwide Building Society, 5.20%, 08/07/2024 | 1.347.000 |
| 1.346.000.000 | Nationwide Building Society, 5.18%, 19/04/2024 | 1.346.000 |
| 1.346.000.000 | Nationwide Building Society, 4.95%, 20/09/2024 | 1.346.000 |
| 1.345.000.000 | Nationwide Building Society, 5.20%, 10/05/2024 | 1.345.000 |
| 1.345.000.000 | Nationwide Building Society, 4.95%, 19/08/2024 | 1.345.000 |
| 1.341.000.000 | Nationwide Building Society, 5.18%, 03/04/2024 | 1.341.000 |
| 1.341.000.000 | Nationwide Building Society, 5.18%, 09/04/2024 | 1.341.000 |
| 1.341.000.000 | Nationwide Building Society, 4.95%, 14/08/2024 | 1.341.000 |
| 1.341.000.000 | Nationwide Building Society, 4.95%, 16/09/2024 | 1.341.000 |
| 1.340.000.000 | Nationwide Building Society, 5.18%, 28/03/2024 | 1.340.000 |
| 1.339.000.000 | Nationwide Building Society, 5.18%, 24/11/2023 | 1.339.000 |

| Verkäufe | | |
|-----------------|---|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Erlöse Tsd. GBP |
| 231.000.000 | Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 07/10/2024 | 230.625 |

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

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| Käufe | | |
|--------------|--|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Kosten Tsd. GBP |
| 205.000.000 | BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund - Agency (Dis) Shares | 205.000 |
| 80.000.000 | Banco Santander SA, 0.00%, 21/05/2024 | 77.834 |
| 80.000.000 | Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 18/07/2025 | 76.056 |
| 75.000.000 | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 01/10/2024 | 74.006 |
| 75.000.000 | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 25/03/2025 | 73.221 |
| 69.000.000 | Toyota Financial Services (UK) plc, 0.00%, 14/06/2024 | 68.990 |
| 70.000.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 17/01/2025 | 66.533 |
| 70.000.000 | Societe Generale SA, 0.00%, 13/05/2025 | 66.515 |
| 67.000.000 | Bank of Montreal, 0.00%, 13/06/2025 | 63.598 |
| 65.000.000 | Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 0.00%, 24/06/2024 | 63.271 |
| 66.000.000 | Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 01/11/2024 | 62.377 |
| 60.000.000 | BNP Paribas SA, 5.60%, 28/05/2024 | 60.000 |
| 60.000.000 | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 07/03/2024 | 59.199 |
| 60.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 07/03/2024 | 59.199 |
| 60.000.000 | Nordea Bank Abp, 0.00%, 30/05/2025 | 57.822 |
| 60.000.000 | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 02/04/2025 | 57.061 |
| 60.000.000 | Banco Santander SA, 0.00%, 20/05/2025 | 57.010 |
| 60.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 10/03/2025 | 56.966 |
| 66.000.000 | Johnson Controls International plc, 0.00%, 04/01/2024 | 56.561 |
| 56.000.000 | Corelux SA, 0.00%, 07/08/2024 | 55.234 |

| Verkäufe | | |
|-----------------|---|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Erlöse Tsd. GBP |
| 290.000.000 | BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund - Agency (Dis) Shares | 290.000 |
| 75.000.000 | MUFG Bank Ltd., 0.00%, 01/10/2024 | 74.938 |
| 60.000.000 | Toronto-Dominion Bank (The), 0.00%, 22/04/2024 | 59.827 |
| 56.000.000 | Corelux SA, 0.00%, 07/08/2024 | 55.944 |
| 51.000.000 | Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 01/11/2024 | 50.242 |
| 35.000.000 | Norinchukin Bank (The), 0.00%, 05/09/2024 | 34.991 |
| 15.000.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 12/04/2024 | 14.906 |
| 15.000.000 | BPCE SA, 0.00%, 24/06/2024 | 14.748 |
| 10.000.000 | Lloyds Bank Corporate Markets plc, 0.00%, 17/05/2024 | 9.977 |

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

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| Käufe | | |
|--------------|---|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Kosten Tsd. USD |
| 87.000.000 | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 11/10/2024 | 86.769 |
| 85.000.000 | Kingdom of the Netherlands, 0.00%, 22/01/2024 | 84.580 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 31/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 03/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 04/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 05/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 06/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 11/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 12/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 13/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 17/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 18/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 19/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 20/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 24/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 25/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 26/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 27/10/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 01/11/2023 | 74.989 |
| 75.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 02/11/2023 | 74.989 |

| Verkäufe | | |
|-----------------|---|----------------------------|
| Menge | Investitionen | Erlöse Tsd. USD |
| 42.000.000 | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 09/07/2024 | 41.907 |
| 13.500.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 20/03/2025 | 13.175 |
| 13.000.000 | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 23/10/2023 | 12.967 |
| 12.000.000 | Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 25/07/2024 | 11.988 |
| 11.000.000 | ANZ New Zealand (Int'l) Ltd., 0.00%, 20/08/2024 | 10.907 |
| 11.000.000 | Sanofi SA, 0.00%, 21/08/2024 | 10.905 |
| 10.000.000 | ING (U.S.) Funding LLC, 5.08%, 12/11/2024 | 10.003 |
| 10.000.000 | Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.00%, 09/07/2024 | 9.979 |
| 9.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 13/05/2024 | 8.987 |
| 8.000.000 | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 20/06/2024 | 7.943 |
| 7.000.000 | Credit Industriel et Commercial, 5.42%, 05/06/2025 | 6.997 |

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

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| Käufe | | Kosten |
|---------------|---|-----------------|
| Menge | Investitionen | Tsd. USD |
| 1.663.000.000 | Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 11/10/2024 | 1.658.579 |
| 1.408.000.000 | Kingdom of the Netherlands, 0.00%, 22/01/2024 | 1.401.039 |
| 1.261.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 11/04/2024 | 1.260.812 |
| 1.260.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 12/04/2024 | 1.259.812 |
| 1.260.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 15/04/2024 | 1.259.437 |
| 1.226.350.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 27/09/2024 | 1.226.184 |
| 1.226.350.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 30/09/2024 | 1.225.853 |
| 1.202.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 22/04/2024 | 1.201.463 |
| 1.200.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2024 | 1.195.081 |
| 1.193.400.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 27/06/2024 | 1.193.222 |
| 1.193.400.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 28/06/2024 | 1.193.222 |
| 1.185.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 01/05/2024 | 1.184.824 |
| 1.160.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 16/04/2024 | 1.159.827 |
| 1.160.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 17/04/2024 | 1.159.827 |
| 1.149.300.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 26/04/2024 | 1.149.129 |
| 1.148.700.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 04/09/2024 | 1.148.529 |
| 1.148.700.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 03/09/2024 | 1.148.016 |
| 1.144.150.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 26/09/2024 | 1.143.996 |
| 1.137.700.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 30/08/2024 | 1.137.531 |
| 1.131.000.000 | Barclays Bank plc, 0.00%, 30/04/2024 | 1.130.832 |

| Verkäufe | | Erlöse |
|-----------------|---|-----------------|
| Menge | Investitionen | Tsd. USD |
| 360.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 30/04/2024 | 357.210 |
| 238.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 13/05/2024 | 237.646 |
| 229.500.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 20/03/2025 | 218.801 |
| 200.000.000 | Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 25/07/2024 | 199.794 |
| 200.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 26/03/2024 | 199.678 |
| 200.000.000 | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.00%, 26/08/2024 | 198.993 |
| 186.000.000 | Bank of Montreal, 0.00%, 03/07/2024 | 185.219 |
| 160.000.000 | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 23/10/2023 | 159.596 |
| 150.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 01/10/2024 | 148.486 |
| 140.000.000 | ING (U.S.) Funding LLC, 5.08%, 12/11/2024 | 140.036 |
| 131.000.000 | Credit Industriel et Commercial, 5.52%, 05/06/2025 | 130.949 |
| 125.000.000 | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 20/06/2024 | 124.103 |
| 124.000.000 | Bank of America NA, 5.59%, 01/04/2024 | 124.018 |

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

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| Käufe | | | Kosten |
|--------------|--|--|-----------------|
| Menge | Investitionen | | Tsd. USD |
| 218.500.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 25/06/2024 | | 218.431 |
| 213.032.238 | BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Dis) | | 213.032 |
| 200.750.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 07/06/2024 | | 200.673 |
| 198.000.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 27/06/2024 | | 197.942 |
| 196.500.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 02/04/2024 | | 196.401 |
| 188.000.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 23/05/2024 | | 187.925 |
| 181.750.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 28/06/2024 | | 181.684 |
| 180.518.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 03/04/2024 | | 180.457 |
| 180.000.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 26/06/2024 | | 179.973 |
| 180.000.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 12/06/2024 | | 179.954 |
| 178.500.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 24/06/2024 | | 178.418 |
| 178.000.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 02/07/2024 | | 177.973 |
| 175.000.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 22/05/2024 | | 174.973 |
| 175.000.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 09/05/2024 | | 174.927 |
| 175.000.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 18/04/2024 | | 174.905 |
| 175.000.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 30/05/2024 | | 174.904 |
| 173.000.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 20/06/2024 | | 172.938 |
| 172.500.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 08/05/2024 | | 172.428 |
| 170.500.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 21/02/2024 | | 170.428 |
| 170.250.000 | Western Union Co. (The), 0.00%, 18/06/2024 | | 170.224 |

| Verkäufe | | | Erlöse |
|-----------------|--|--|-----------------|
| Menge | Investitionen | | Tsd. USD |
| 103.963.700 | BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund – Anteilklasse Agency (Dis) | | 103.964 |
| 40.930.000 | NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 0.00%, 21/08/2024 | | 40.850 |
| 32.500.000 | Penske Truck Leasing Co. LP, 0.00%, 22/02/2024 | | 32.460 |
| 28.250.000 | Vulcan Materials Co., 0.00%, 02/01/2024 | | 28.201 |
| 27.250.000 | Spire, Inc., 0.00%, 02/01/2024 | | 27.203 |
| 25.000.000 | VW Credit, Inc., 0.00%, 01/08/2024 | | 24.970 |
| 25.000.000 | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 23/10/2023 | | 24.937 |
| 20.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 27/02/2024 | | 19.962 |
| 15.250.000 | Versailles CP, 0.00%, 02/01/2024 | | 15.225 |
| 15.000.000 | Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 20/06/2024 | | 14.892 |
| 10.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 20/02/2024 | | 9.991 |
| 10.000.000 | Westpac Securities NZ Ltd., 0.00%, 23/02/2024 | | 9.987 |
| 10.000.000 | Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 05/01/2024 | | 9.967 |
| 10.000.000 | Bank of Montreal, 0.00%, 03/07/2024 | | 9.958 |
| 7.790.000 | American Honda Finance Corp., 0.00%, 21/02/2024 | | 7.781 |

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

BLACKROCK ICS US TREASURY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| Käufe | | | Kosten |
|---------------|-------------------------------------|--|-----------------|
| Menge | Investitionen | | Tsd. USD |
| 2.119.538.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 25/07/2024 | | 2.098.445 |
| 2.100.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 23/01/2024 | | 2.084.193 |
| 1.642.688.400 | US Treasury Bill, 0.00%, 07/11/2024 | | 1.621.968 |
| 1.584.100.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 26/03/2024 | | 1.567.287 |
| 1.578.529.800 | US Treasury Bill, 0.00%, 20/06/2024 | | 1.552.044 |
| 1.519.745.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 08/08/2024 | | 1.509.224 |
| 1.395.871.300 | US Treasury Bill, 0.00%, 19/09/2024 | | 1.385.293 |
| 1.387.299.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2024 | | 1.369.221 |
| 1.368.400.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 22/10/2024 | | 1.357.979 |
| 1.297.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 04/01/2024 | | 1.289.193 |
| 1.280.971.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 13/02/2024 | | 1.265.510 |
| 1.200.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 09/01/2024 | | 1.195.067 |
| 1.199.930.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2024 | | 1.182.324 |
| 1.089.779.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 11/01/2024 | | 1.083.060 |
| 1.037.447.900 | US Treasury Bill, 0.00%, 06/08/2024 | | 1.021.286 |
| 1.000.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 27/02/2024 | | 995.893 |
| 1.000.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 28/11/2023 | | 995.882 |
| 970.100.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 24/09/2024 | | 958.606 |
| 919.650.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024 | | 913.980 |
| 900.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 14/12/2023 | | 894.440 |
| 898.855.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 29/10/2024 | | 893.178 |
| 859.920.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 27/08/2024 | | 853.040 |
| 855.113.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 22/08/2024 | | 840.768 |
| 839.400.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 05/11/2024 | | 830.391 |
| 814.475.000 | US Treasury, FRN, 4.72%, 31/07/2025 | | 814.347 |
| 830.091.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 18/07/2024 | | 809.199 |
| 816.272.200 | US Treasury Bill, 0.00%, 07/05/2024 | | 805.470 |
| 810.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 01/02/2024 | | 804.220 |
| 795.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 05/12/2023 | | 794.418 |
| 797.793.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2024 | | 784.513 |
| 786.900.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 07/12/2023 | | 782.034 |
| 792.355.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 21/11/2024 | | 775.769 |
| 750.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 12/03/2024 | | 746.920 |
| 758.058.400 | US Treasury Bill, 0.00%, 29/11/2024 | | 740.894 |
| 737.040.000 | US Treasury, FRN, 4.73%, 31/10/2024 | | 737.376 |
| 738.700.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 17/09/2024 | | 733.775 |
| 710.305.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 03/09/2024 | | 707.398 |

| Verkäufe | | | Erlöse |
|-----------------|-------------------------------------|--|-----------------|
| Menge | Investitionen | | Tsd. USD |
| 984.100.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 26/03/2024 | | 974.514 |
| 970.100.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 24/09/2024 | | 961.273 |
| 963.293.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 14/12/2023 | | 960.184 |
| 740.749.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 01/02/2024 | | 739.671 |
| 710.305.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 03/09/2024 | | 709.517 |
| 700.110.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 02/11/2023 | | 699.473 |
| 674.020.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 15/02/2024 | | 670.975 |
| 575.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 20/06/2024 | | 568.592 |
| 560.100.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 08/02/2024 | | 558.151 |
| 535.723.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 19/03/2024 | | 530.635 |
| 500.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 15/08/2024 | | 495.733 |
| 490.700.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 23/07/2024 | | 489.575 |
| 482.597.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2024 | | 477.222 |
| 450.000.000 | US Treasury, FRN, 5.43%, 31/07/2024 | | 450.003 |
| 452.764.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2024 | | 448.679 |
| 425.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 04/01/2024 | | 424.482 |
| 425.583.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 07/03/2024 | | 422.211 |
| 396.320.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 11/06/2024 | | 395.392 |
| 370.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 26/09/2024 | | 369.500 |
| 356.845.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 27/08/2024 | | 353.776 |
| 338.002.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 21/12/2023 | | 337.174 |
| 329.678.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 26/12/2023 | | 328.685 |
| 325.045.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2024 | | 324.546 |

BLACKROCK ICS US TREASURY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

| Verkäufe (Fortsetzung) | | Erlöse |
|------------------------|-------------------------------------|----------|
| Menge | Investitionen | Tsd. USD |
| 304.340.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 22/08/2024 | 300.136 |
| 300.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 28/12/2023 | 299.957 |
| 300.050.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 21/03/2024 | 299.097 |
| 299.600.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 16/07/2024 | 298.660 |
| 260.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 05/12/2024 | 255.355 |
| 258.554.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 04/04/2024 | 254.312 |
| 250.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 18/06/2024 | 249.351 |
| 246.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 02/07/2024 | 245.622 |
| 241.200.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 15/10/2024 | 238.682 |
| 235.600.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 30/07/2024 | 234.323 |
| 229.979.600 | US Treasury Bill, 0.00%, 19/09/2024 | 229.891 |
| 213.762.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024 | 212.978 |
| 212.023.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 27/02/2024 | 211.802 |
| 200.000.000 | US Treasury Bill, 0.00%, 11/01/2024 | 199.942 |

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

INFORMATIONEN FÜR ANLEGER IN DER SCHWEIZ (UNGEPRÜFT)

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

Weitere Informationen über die herangezogenen Performanceindikatoren und Berechnungsmethoden sind dem Abschnitt Performanceübersicht im Bericht des Investmentmanagers zu entnehmen. Die Währung jeder einzelnen Klasse ist in der Anmerkung zum Abschluss zu dem den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert aufgeführt.

| Name des Fonds | Auflegungsdatum | 2023 | | 2022 | | 2021 | |
|--|--------------------|------------------------|----------------------------|------------------------|----------------------------|------------------------|----------------------------|
| | | Fonds- rendite % | Benchmark- rendite % | Fonds- rendite % | Benchmark- rendite % | Fonds- rendite % | Benchmark- rendite % |
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc) | 30. April 2010 | 3,13 | 3,31 | (0,21) | (0,01) | (0,75) | (0,57) |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Acc) | 24. April 2013 | 3,49 | 3,31 | 0,06 | (0,01) | (0,60) | (0,69) |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc) | 30. April 2010 | 3,29 | 3,31 | 0,01 | (0,01) | (0,74) | (0,69) |
| BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Core | 30. April 2010 | 3,07 | 3,32 | (0,06) | k. A. | (0,65) | (0,66) |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc) | 23. September 2010 | 4,64 | 4,71 | 1,29 | 1,40 | (0,01) | 0,06 |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Dis) | 22. Juli 2019 | 4,75 | 4,71 | 1,39 | 1,40 | k. A. | (0,07) |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc) | 30. April 2010 | 4,77 | 4,71 | 1,40 | 1,40 | 0,01 | (0,07) |
| BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Core | 30. April 2010 | 4,74 | 4,71 | 1,33 | 1,39 | (0,05) | (0,06) |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Dis) | 24. Juli 2019 | 5,30 | 4,99 | 1,77 | 1,64 | 0,02 | (0,03) |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc) | 30. April 2010 | 5,33 | 4,99 | 1,78 | 1,64 | 0,02 | (0,03) |
| BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Select | 23. September 2010 | 5,54 | 5,21 | 1,89 | 1,70 | 0,08 | 0,05 |
| BlackRock ICS US Treasury Fund - Anteilklasse Core (Acc) | 30. April 2010 | 5,10 | 4,99 | 1,56 | 1,64 | 0,01 | 0,04 |

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

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

Die TER für jede Anteilklasse, mit Ausnahme der primären Anteilklasse, ist in der folgenden Tabelle für den Zwölfmonatszeitraum zum 30. September 2024 angegeben:

| Name des Fonds | Klasse des Fonds | TER (in %) |
|---|------------------------------------|------------|
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | Anteilklasse Admin III (Acc T0) | 0,45 |
| | Anteilklasse Admin III (Dis) | 0,45 |
| | Anteilklasse Agency (Acc) | 0,03 |
| | Anteilklasse Agency (Dis) | 0,03 |
| | Anteilklasse Core (Acc T0) | 0,20 |
| | Anteilklasse Core (Dis) | 0,20 |
| | Anteilklasse G Accumulating | 0,20 |
| | Anteilklasse G Accumulating T0 | 0,20 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc T0) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Dis) | 0,13 |
| | Anteilklasse Premier (Acc T0) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Acc) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Dis) | 0,10 |
| | Anteilklasse Select (Acc T0) | 0,15 |
| Anteilklasse Select (Dis) | 0,15 | |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | Anteilklasse Admin III (Acc) | 0,45 |
| | Anteilklasse Agency (Acc T0) | 0,03 |
| | Anteilklasse Core (Acc T0) | 0,20 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc T0) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc) | 0,13 |
| | Anteilklasse Premier (Acc T0) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Acc T2) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Acc) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Dis) | 0,10 |
| | Anteilklasse Select (Acc T0) | 0,15 |
| | Anteilklasse Select (Acc) | 0,15 |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | Anteilklasse Admin I (Acc T0) | 0,25 |
| | Anteilklasse Admin I (Acc) | 0,25 |
| | Anteilklasse Admin II (Acc T0) | 0,30 |
| | Anteilklasse Admin II (Acc) | 0,30 |
| | Anteilklasse Admin III (Acc T0) | 0,45 |
| | Anteilklasse Admin III (Acc) | 0,45 |
| | Anteilklasse Admin III (Dis) | 0,45 |
| | Anteilklasse Admin IV (Acc) | 0,70 |
| | Anteilklasse Agency (Acc T0) | 0,03 |
| | Anteilklasse Agency (Acc) | 0,03 |
| | Anteilklasse Agency (Dis) | 0,03 |
| | Anteilklasse Aon Captives (Acc T0) | 0,16 |
| | Anteilklasse Core (Acc T0) | 0,20 |
| | Anteilklasse Core (Dis) | 0,20 |
| | Anteilklasse G Accumulating T0 | 0,20 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc T0) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Dis) | 0,13 |
| | Anteilklasse Premier (Acc T0) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Acc T2) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Acc) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Dis) | 0,10 |
| | Anteilklasse Select (Acc T0) | 0,15 |
| Anteilklasse Select (Acc) | 0,15 | |
| Anteilklasse Select (Dis) | 0,15 | |
| BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | Anteilklasse Admin III | 0,45 |
| | Anteilklasse Agency | 0,03 |
| | Anteilklasse Heritage (Dis) | 0,00 |
| | Anteilklasse Heritage | 0,13 |
| | Anteilklasse J (Acc) | 0,06 |
| | Anteilklasse J (Dis) | 0,06 |
| | Anteilklasse Premier (Dis) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier | 0,10 |
| | Anteilklasse Select | 0,15 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

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

| Name des Fonds | Klasse des Fonds | TER (in %) |
|--|--------------------------------|------------|
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | Anteilklasse Admin III (Dis) | 0,45 |
| | Anteilklasse Agency (Acc T0) | 0,03 |
| | Anteilklasse Agency (Dis) | 0,03 |
| | Anteilklasse Core (Acc T0) | 0,20 |
| | Anteilklasse Core (Dis) | 0,20 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc T0) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Dis) | 0,13 |
| | Anteilklasse Premier (Acc T0) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Acc) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Dis) | 0,10 |
| | Anteilklasse Select (Acc T0) | 0,15 |
| | Anteilklasse Select (Dis) | 0,15 |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | Anteilklasse Agency (Acc T0) | 0,03 |
| | Anteilklasse Agency (Acc) | 0,03 |
| | Anteilklasse Agency (Dis) | 0,03 |
| | Anteilklasse Core (Acc T0) | 0,20 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc T0) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Dis) | 0,13 |
| | Anteilklasse J (Acc T3) | 0,06 |
| | Anteilklasse Premier (Acc T0) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Acc) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Dis) | 0,10 |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund | Anteilklasse Admin I (Acc) | 0,25 |
| | Anteilklasse Admin I (Dis) | 0,25 |
| | Anteilklasse Admin II (Acc) | 0,30 |
| | Anteilklasse Admin II (Dis) | 0,30 |
| | Anteilklasse Admin III (Acc) | 0,45 |
| | Anteilklasse Admin III (Dis) | 0,45 |
| | Anteilklasse Admin IV (Acc) | 0,70 |
| | Anteilklasse Agency (Acc) | 0,03 |
| | Anteilklasse Agency (Dis) | 0,03 |
| | Anteilklasse Aon Captives | 0,15 |
| | Anteilklasse Core (Dis) | 0,20 |
| | Anteilklasse G Distributing I | 0,15 |
| | Anteilklasse G Distributing II | 0,00 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Dis) | 0,13 |
| | Anteilklasse Premier (Acc) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Dis T1) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Dis) | 0,10 |
| | Anteilklasse S (Acc) | 0,10 |
| | Anteilklasse Select (Acc) | 0,15 |
| Anteilklasse Select (Dis) | 0,15 | |
| BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund | Anteilklasse Agency (Dis) | 0,03 |
| | Anteilklasse Agency | 0,03 |
| | Anteilklasse Heritage (Dis) | 0,00 |
| | Anteilklasse Heritage | 0,13 |
| | Anteilklasse J (Acc) | 0,06 |
| | Anteilklasse J (Dis) | 0,06 |
| | Anteilklasse Premier (Dis) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier | 0,10 |
| | Anteilklasse Select | 0,15 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | Anteilklasse Agency (Acc T0) | 0,03 |
| | Anteilklasse Agency (Dis) | 0,03 |
| | Anteilklasse Core (Acc T0) | 0,20 |
| | Anteilklasse Core (Acc) | 0,02 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc T0) | 0,12 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Dis) | 0,13 |
| | Anteilklasse Premier (Acc T0) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Acc) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Dis) | 0,10 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

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

| Name des Fonds | Klasse des Fonds | TER (in %) |
|--|--|---------------------|
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Fortsetzung) | Anteilklasse Select (Dis) | 0,15 |
| | | |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | Anteilklasse Admin I (Acc) | 0,25 |
| | Anteilklasse Admin I (Dis) | 0,25 |
| | Anteilklasse Admin II (Acc) | 0,30 |
| | Anteilklasse Admin II (Dis) | 0,30 |
| | Anteilklasse Admin III (Acc) | 0,45 |
| | Anteilklasse Admin III (Dis) | 0,45 |
| | Anteilklasse Admin IV (Acc T0) | 0,70 |
| | Anteilklasse Admin IV (Acc) | 0,70 |
| | Anteilklasse Admin IV (Dis) | 0,70 |
| | Anteilklasse Agency (Acc T0) | 0,03 |
| | Anteilklasse Agency (Acc) | 0,03 |
| | Anteilklasse Agency (Dis) | 0,03 |
| | Anteilklasse Aon Captives | 0,15 |
| | Anteilklasse Core (Acc T0) | 0,20 |
| | Anteilklasse Core (Dis) | 0,20 |
| | Anteilklasse G Accumulating II | 0,25 |
| | Anteilklasse G Accumulating | 0,20 |
| | Anteilklasse G Distributing I | 0,15 |
| | Anteilklasse G Distributing | 0,20 |
| | Anteilklasse G Heritage (Acc) | 0,13 |
| | Anteilklasse G Heritage (Dis) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc T0) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Dis) | 0,13 |
| | Klasse N | 0,20 |
| | Anteilklasse Premier (Acc T0) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Acc) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Dis) | 0,10 |
| | Anteilklasse Select (Acc) | 0,15 |
| | Anteilklasse Select (Dis) | 0,15 |
| | BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | Anteilklasse Agency |
| Anteilklasse Core | | 0,20 |
| Anteilklasse Heritage (CHF Hedged) | | 0,15 |
| Anteilklasse Heritage (Dis) | | 0,00 |
| Anteilklasse Heritage (SGD Hedged) | | 0,15 |
| Anteilklasse Heritage | | 0,13 |
| Anteilklasse J (Acc) | | 0,06 |
| Anteilklasse J (Dis) | | 0,06 |
| Anteilklasse Premier (Dis) | | 0,10 |
| Anteilklasse Premier | | 0,10 |
| | | |
| BlackRock ICS US Treasury Fund | Anteilklasse Admin III (Dis) | 0,45 |
| | Anteilklasse Agency (Acc) | 0,03 |
| | Anteilklasse Agency (Dis) | 0,03 |
| | Anteilklasse Core (Dis) | 0,20 |
| | Anteilklasse E (Dis) | 0,07 |
| | Anteilklasse G Accumulating | 0,20 |
| | Anteilklasse G Distributing | 0,20 |
| | Anteilklasse G Heritage (Acc) | 0,13 |
| | Anteilklasse G Heritage (Dis) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Acc) | 0,13 |
| | Anteilklasse Heritage (Dis) | 0,13 |
| | Klasse N | 0,00 |
| | Anteilklasse Premier (Acc) | 0,10 |
| | Anteilklasse Premier (Dis) | 0,10 |
| | Anteilklasse Select (Dis) | 0,15 |

TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN (UNGEPRÜFT)

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

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

TRANSAKTIONSKOSTEN (UNGEPRÜFT)

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

VERRECHNUNGSPROVISIONEN (SOFT COMMISSIONS) (UNGEPRÜFT)

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2024 wurden vom Investmentmanager im Namen der jeweiligen Fonds keine Vereinbarungen über Verrechnungsprovisionen abgeschlossen.

WECHSELSEITIGE ANLAGEN (UNGEPRÜFT)

Jeder unten aufgeführte Fonds hielt zum 30. September 2024 die folgenden wechselseitigen Anlagen im Umbrella. Diese Anlagen wurden zu Darstellungszwecken der konsolidierten Ergebnisse des Unternehmens nicht eliminiert.

| Fonds | Wechselseitige Anlagen im Umbrella | Zeitwert Tsd. GBP | % des Gesamt- nettoinventar- werts des Umbrella |
|---|---|----------------------|--|
| BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund | BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0) | 84.116 | 0,04 |
| BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund | BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Dis) | 229.680 | 0,11 |

GESAMTRISIKOEXPOSITION (UNGEPRÜFT)

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

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

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

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

HEBELWIRKUNG (UNGEPRÜFT)

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT)

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

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

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

Vergütungssteuerung

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

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

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

(a) MDCC

Die Aufgaben des MDCC lauten wie folgt:

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

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

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

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

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

(b) Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

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

Zu den Verantwortlichkeiten der Aufsichtsfunktion gehören:

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Entscheidungsfindungsprozess

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

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

Jährliche Boni werden aus einem Bonuspool gezahlt.

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

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

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

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

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

Kontrollfunktionen

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

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

Verbindung zwischen Zahlung und Leistung

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Verbindung zwischen Zahlung und Leistung (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Identifizierte Mitarbeiter

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

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

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

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

Quantitative Angaben zur Vergütung

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

Vergütungsinformationen auf Ebene der einzelnen Fonds sind nicht ohne Weiteres verfügbar. Es werden Angaben gemacht zu (a) den Mitarbeitern der Verwaltungsgesellschaft; (b) Mitarbeitern der Geschäftsleitung; (c) Mitarbeitern, die das Risikoprofil des Fonds wesentlich beeinflussen können und (d) Mitarbeitern von Unternehmen, an die das Portfoliomanagement und das Risikomanagement formell delegiert wurden.

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

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT)

Techniken des effizienten Portfoliomanagements

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

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

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

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

Umgekehrte Repogeschäfte

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

Die nachstehende Tabelle enthält Angaben zu den umgekehrten Repogeschäften als prozentualer Anteil des Nettoinventarwerts der einzelnen Fonds zum 30. September 2024 und zu den Renditen im Geschäftsjahr zum 30. September 2024.

| Fonds | Währung | Umgekehrte Repogeschäfte | |
|---|---------|--------------------------|------------------------------|
| | | % des NIW | Erzielte Gesamtrenditen Tsd. |
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | EUR | 82,10 | 72.948 |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | EUR | 12,92 | 24.479 |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | EUR | 15,97 | 276.885 |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | GBP | 84,83 | 191.048 |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | GBP | 27,94 | 104.201 |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund | GBP | 20,41 | 396.907 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | USD | 14,03 | 43.555 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | USD | 6,31 | 331.848 |
| BlackRock ICS US Treasury Fund | USD | 41,92 | 538.821 |

Alle Renditen aus umgekehrten Repogeschäften werden dem jeweiligen Fonds zugerechnet und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Aufteilung von Gewinnen mit der Verwaltungsgesellschaft des Fonds oder anderen Dritten.

Die folgende Tabelle enthält Angaben zum Wert der umgekehrten Repogeschäfte und zugehöriger erhaltener Sicherheiten, aufgeteilt nach Kontrahenten, zum 30. September 2024.

| Kontrahent | Gründungsland des Kontrahenten | Umgekehrte Repogeschäfte | |
|------------------------------------|--------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|
| | | Entliehener Betrag Tsd. EUR | Erhaltene Sicherheiten Tsd. EUR |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigte Staaten von Amerika | 400.000 | 411.355 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce | Kanada | 300.000 | 304.844 |
| Goldman Sachs International | Vereinigtes Königreich | 300.000 | 308.398 |
| Natixis SA | Frankreich | 250.000 | 253.822 |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 200.000 | 204.083 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung)

| Kontrahent | Gründungsland der Kontrahenten | Umgekehrte Repogeschäfte | |
|---|--------------------------------|--------------------------|------------------------|
| | | Entliehener Betrag | Erhaltene Sicherheiten |
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund (Fortsetzung) | | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| National Australia Bank Ltd. | Australien | 200.000 | 202.946 |
| NatWest Markets plc | Vereinigtes Königreich | 200.000 | 204.917 |
| Santander UK plc | Spanien | 200.000 | 205.657 |
| Societe Generale | Frankreich | 200.000 | 202.640 |
| Bank of Nova Scotia plc | Kanada | 200.000 | 202.997 |
| Credit Agricole Corporate and Investment Bank | Frankreich | 150.000 | 151.996 |
| MUFG Securities EMEA plc | Japan | 150.000 | 152.555 |
| | Vereinigte Staaten von Amerika | | |
| BofA Securities Europe SA | Amerika | 5.000 | 5.129 |
| Gesamt | | 2.755.000 | 2.811.339 |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| NatWest Markets plc | Vereinigtes Königreich | 500.000 | 515.258 |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 300.000 | 305.139 |
| Goldman Sachs International | Vereinigtes Königreich | 100.000 | 102.533 |
| Gesamt | | 900.000 | 922.930 |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigte Staaten von Amerika | 2.100.000 | 2.152.099 |
| ING Bank NV | Niederlande | 1.500.000 | 1.521.117 |
| Bank of Nova Scotia plc | Kanada | 1.400.000 | 1.417.040 |
| NatWest Markets plc | Vereinigtes Königreich | 1.300.000 | 1.326.499 |
| Natixis SA | Frankreich | 1.250.000 | 1.261.176 |
| Societe Generale | Frankreich | 600.000 | 606.150 |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 500.000 | 507.675 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce | Kanada | 400.000 | 407.396 |
| Goldman Sachs International | Vereinigtes Königreich | 400.000 | 412.239 |
| Santander UK plc | Spanien | 350.000 | 358.500 |
| National Australia Bank Ltd. | Australien | 300.000 | 305.370 |
| MUFG Securities EMEA plc | Japan | 250.000 | 255.100 |
| Credit Agricole Corporate and Investment Bank | Frankreich | 200.000 | 202.168 |
| Gesamt | | 10.550.000 | 10.732.529 |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Canadian Imperial Bank of Commerce | Kanada | 700.000 | 700.000 |
| Bank of Nova Scotia plc | Kanada | 450.000 | 450.000 |
| Credit Agricole Corporate and Investment Bank | Frankreich | 400.000 | 400.000 |
| MUFG Securities EMEA plc | Japan | 400.000 | 400.000 |
| | Vereinigte Staaten von Amerika | | |
| J.P. Morgan Securities plc | Amerika | 350.000 | 356.161 |
| Barclays Bank plc | Vereinigtes Königreich | 300.000 | 308.257 |
| Santander UK plc | Spanien | 300.000 | 300.000 |
| Standard Chartered Bank | Vereinigtes Königreich | 300.000 | 300.000 |
| Toronto-Dominion Bank (The) | Kanada | 300.000 | 300.000 |
| NatWest Markets plc | Vereinigtes Königreich | 250.000 | 255.056 |
| Societe Generale | Frankreich | 250.000 | 254.379 |
| Goldman Sachs International | Vereinigtes Königreich | 250.000 | 257.421 |
| HSBC Bank plc | Vereinigtes Königreich | 200.000 | 204.183 |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 195.000 | 196.744 |
| National Australia Bank Ltd. | Australien | 150.000 | 152.815 |
| DBS Bank Ltd. | Singapur | 100.000 | 100.000 |
| Gesamt | | 4.895.000 | 4.935.016 |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Canadian Imperial Bank of Commerce | Kanada | 400.001 | 400.000 |
| Bank of Nova Scotia plc | Kanada | 300.000 | 300.000 |
| Toronto-Dominion Bank (The) | Kanada | 300.000 | 300.000 |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 255.000 | 258.313 |
| Standard Chartered Bank | Vereinigtes Königreich | 250.001 | 250.000 |
| Barclays Bank plc | Vereinigtes Königreich | 250.000 | 254.503 |
| National Australia Bank Ltd. | Australien | 250.000 | 254.656 |
| NatWest Markets plc | Vereinigtes Königreich | 200.000 | 204.292 |
| DBS Bank Ltd. | Singapur | 200.000 | 200.000 |
| Santander UK plc | Spanien | 200.000 | 200.000 |
| Goldman Sachs International | Vereinigtes Königreich | 150.000 | 154.453 |
| Gesamt | | 2.755.002 | 2.776.217 |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund | | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Toronto-Dominion Bank (The) | Kanada | 1.400.001 | 1.400.000 |
| Santander UK plc | Spanien | 1.000.000 | 1.000.000 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung)

| Kontrahent | Gründungsland der Kontrahenten | Umgekehrte Repogeschäfte | |
|--|--------------------------------|--------------------------|------------------------|
| | | Entliehener Betrag | Erhaltene Sicherheiten |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund (Fortsetzung) | | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| DBS Bank Ltd. | Singapur | 700.000 | 700.000 |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigte Staaten von Amerika | 650.000 | 664.224 |
| Citigroup Global Markets Ltd. | Vereinigte Staaten von Amerika | 500.000 | 509.598 |
| Bank of Nova Scotia plc | Kanada | 450.000 | 450.000 |
| MUFG Securities EMEA plc | Japan | 400.000 | 400.000 |
| Goldman Sachs International | Vereinigtes Königreich | 400.000 | 411.874 |
| Barclays Bank plc | Vereinigtes Königreich | 400.000 | 411.208 |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 400.000 | 404.520 |
| Standard Chartered Bank | Vereinigtes Königreich | 350.000 | 350.000 |
| Bank of Montreal | Kanada | 300.000 | 300.000 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce | Kanada | 300.000 | 300.000 |
| HSBC Bank plc | Vereinigtes Königreich | 250.000 | 255.849 |
| NatWest Markets plc | Vereinigtes Königreich | 250.000 | 255.550 |
| National Australia Bank Ltd. | Australien | 200.000 | 203.755 |
| Societe Generale | Frankreich | 150.000 | 151.979 |
| Gesamt | | 8.100.001 | 8.168.557 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Citigroup Global Markets, Inc. | Vereinigte Staaten von Amerika | 225.000 | 227.828 |
| Bofa Securities Inc. | Vereinigte Staaten von Amerika | 205.000 | 207.953 |
| J.P. Morgan Securities LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | 170.000 | 172.518 |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 15.000 | 15.212 |
| Gesamt | | 615.000 | 623.511 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Wells Fargo Securities LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | 1.500.000 | 1.537.751 |
| TD Securities (USA) LLC | Kanada | 1.065.000 | 1.090.955 |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 895.000 | 912.334 |
| Citigroup Global Markets, Inc. | Vereinigte Staaten von Amerika | 523.000 | 528.072 |
| J.P. Morgan Securities LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | 492.000 | 535.038 |
| Bofa Securities Inc. | Vereinigte Staaten von Amerika | 389.000 | 396.053 |
| Royal Bank of Canada | Amerika | 389.000 | 396.053 |
| Credit Agricole SA | Kanada | 250.000 | 255.594 |
| | Frankreich | 45.000 | 45.689 |
| Gesamt | | 5.159.000 | 5.301.486 |
| BlackRock ICS US Treasury Fund | | Tsd. USD | Tsd. USD |
| BNP Paribas SA | Frankreich | 3.040.000 | 3.074.914 |
| TD Securities (USA) LLC | Kanada | 1.800.000 | 1.829.981 |
| Wells Fargo Securities LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | 1.765.000 | 1.774.728 |
| Credit Agricole SA | Frankreich | 1.327.000 | 1.334.655 |
| Societe Generale SA | Frankreich | 1.173.000 | 1.184.287 |
| Natixis SA | Frankreich | 1.125.000 | 1.136.580 |
| Bank of Nova Scotia plc | Frankreich | 1.012.000 | 1.022.397 |
| Bofa Securities Inc. | Kanada | 1.012.000 | 1.022.397 |
| | Vereinigte Staaten von Amerika | 697.000 | 707.783 |
| Citigroup Global Markets, Inc. | Vereinigte Staaten von Amerika | 227.000 | 229.167 |
| Gesamt | | 12.166.000 | 12.294.492 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung)

Die nachstehende Tabelle enthält eine Analyse des Fälligkeitsprofils der umgekehrten Repogeschäfte zum 30. September 2024.

| | Währung | Fälligkeitsprofil | | Gesamt Tsd. |
|---|----------------|-------------------|---------------------|----------------|
| | | 1 Tag Tsd. | 2-7 Tage Tsd. | |
| Umgekehrte Repogeschäfte | | | | |
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | EUR | 2.255.000 | 500.000 | 2.755.000 |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | EUR | 850.000 | 50.000 | 900.000 |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | EUR | 9.500.000 | 1.050.000 | 10.550.000 |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | GBP | 3.995.000 | 900.000 | 4.895.000 |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | GBP | 2.355.001 | 400.001 | 2.755.002 |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund | GBP | 7.250.001 | 850.000 | 8.100.001 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | USD | 615.000 | - | 615.000 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | USD | 5.159.000 | - | 5.159.000 |
| BlackRock ICS US Treasury Fund | 12.166.000 USD | | | -12.166.000 |

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

Analyse der Sicherheitenwährung

Die nachstehende Tabelle enthält eine Analyse nach Währung der Bar- und Sachsicherheiten, die der jeweilige Fonds zum 30. September 2024 in Form der Vollrechtsübertragung in Bezug auf umgekehrte Repogeschäfte erhalten hat.

| Währung | Erhaltene | Geleistete | Erhaltene | Geleistete |
|--|-----------------|-----------------|-------------------|------------------|
| | Barsicherheiten | Barsicherheiten | Sachsicherheiten | Sachsicherheiten |
| | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | | | | |
| Umgekehrte Repogeschäfte | | | | |
| EUR | - | - | 2.811.339 | - |
| Gesamt | - | - | 2.811.339 | - |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | | | | |
| Umgekehrte Repogeschäfte | | | | |
| EUR | - | - | 922.930 | - |
| Gesamt | - | - | 922.930 | - |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | | | | |
| Umgekehrte Repogeschäfte | | | | |
| EUR | - | - | 10.732.529 | - |
| Gesamt | - | - | 10.732.529 | - |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | | | | |
| Umgekehrte Repogeschäfte | | | | |
| GBP | - | - | 4.935.016 | - |
| Gesamt | - | - | 4.935.016 | - |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | | | | |
| Umgekehrte Repogeschäfte | | | | |
| GBP | - | - | 2.776.217 | - |
| Gesamt | - | - | 2.776.217 | - |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund | | | | |
| Umgekehrte Repogeschäfte | | | | |
| GBP | - | - | 8.168.557 | - |
| Gesamt | - | - | 8.168.557 | - |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | | | | |
| Umgekehrte Repogeschäfte | | | | |
| USD | - | - | 623.511 | - |
| Gesamt | - | - | 623.511 | - |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | | | | |
| Umgekehrte Repogeschäfte | | | | |
| USD | - | - | 5.301.486 | - |
| Gesamt | - | - | 5.301.486 | - |
| BlackRock ICS US Treasury Fund | | | | |
| Umgekehrte Repogeschäfte | | | | |
| USD | - | - | 12.294.492 | - |
| Gesamt | - | - | 12.294.492 | - |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Analyse der Art, Qualität und Fälligkeit der Sicherheit

Die nachstehende Tabelle enthält eine Analyse der Art, Qualität und Fälligkeit der von den einzelnen Fonds in Form der Vollrechtsübertragung in Bezug auf umgekehrte Repogeschäfte erhaltenen Sachsicherheiten zum 30. September 2024.

| Art und Qualität der Sicherheit | Fälligkeitsprofil | | | | | | | Gesamt |
|--|-------------------|------------|---------------|----------------|------------------|-------------------|-------------|-------------------|
| | 1 Tag | 2 - 7 Tage | 8 - 30 Tage | 31 - 90 Tage | 91 - 365 Tage | Mehr als 365 Tage | Unbefristet | |
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | – | – | 25.515 | 48.416 | 231.101 | 2.506.307 | – | 2.811.339 |
| Gesamt | – | – | 25.515 | 48.416 | 231.101 | 2.506.307 | – | 2.811.339 |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | – | – | 6.399 | 8.187 | 320.484 | 587.860 | – | 922.930 |
| Gesamt | – | – | 6.399 | 8.187 | 320.484 | 587.860 | – | 922.930 |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR | Tsd. EUR |
| Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | – | – | 9.808 | 684.586 | 1.266.732 | 8.771.403 | – | 10.732.529 |
| Gesamt | – | – | 9.808 | 684.586 | 1.266.732 | 8.771.403 | – | 10.732.529 |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | – | – | – | – | – | 4.935.016 | – | 4.935.016 |
| Gesamt | – | – | – | – | – | 4.935.016 | – | 4.935.016 |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | – | – | – | – | – | 2.776.217 | – | 2.776.217 |
| Gesamt | – | – | – | – | – | 2.776.217 | – | 2.776.217 |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP | Tsd. GBP |
| Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | – | – | – | – | 58.801 | 8.109.756 | – | 8.168.557 |
| Gesamt | – | – | – | – | 58.801 | 8.109.756 | – | 8.168.557 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | – | – | – | – | – | 623.511 | – | 623.511 |
| Gesamt | – | – | – | – | – | 623.511 | – | 623.511 |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

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

| Art und Qualität der Sicherheit | Fälligkeitsprofil | | | | | | Unbefristet | Gesamt |
|---|-------------------|------------|-------------|---------------|----------------|-------------------|-------------|-------------------|
| | 1 Tag | 2 - 7 Tage | 8 - 30 Tage | 31 - 90 Tage | 91 - 365 Tage | Mehr als 365 Tage | | |
| | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD | Tsd. USD |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | | | | | | | | |
| Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | – | – | – | 106 | 212.559 | 5.088.821 | – | 5.301.486 |
| Gesamt | – | – | – | 106 | 212.559 | 5.088.821 | – | 5.301.486 |
| BlackRock ICS US Treasury Fund | | | | | | | | |
| Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | – | – | 58 | 48.749 | 629.634 | 11.616.051 | – | 12.294.492 |
| Gesamt | – | – | 58 | 48.749 | 629.634 | 11.616.051 | – | 12.294.492 |

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

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

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

Weiterverwendung der erhaltenen Sicherheiten

Sachsicherheiten, die in Form der Vollrechtsübertragung in Bezug auf umgekehrte Repogeschäfte erhalten wurden, können verkauft, reinvestiert oder verpfändet werden.

Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

Zum 30. September 2024 werden alle Sachsicherheiten, die jeder Fonds im Rahmen von umgekehrten Repogeschäften erhält, von der Verwahrstelle des Fonds (oder durch ihre Beauftragten) gehalten, mit Ausnahme von Dreiparteien-Transaktionen mit umgekehrten Repogeschäften, die bei dem Dreiparteien-Agenten gehalten werden.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Konzentration der erhaltenen Sicherheiten

Die nachstehende Tabelle führt die zehn größten Emittenten nach Wert der vom jeweiligen Fonds IN Form der Vollrechtsübertragung erhaltenen Sachsicherheiten für Transaktionen mit umgekehrten Repogeschäften zum 30. September 2024 auf.

| Emittent | Wert |
|--|-------------------|
| BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund | Tsd. EUR |
| France Government | 1.713.147 |
| German Treasury | 1.098.041 |
| Finnish Government | 151 |
| Gesamt | 2.811.339 |
| BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund | Tsd. EUR |
| German Treasury | 762.712 |
| France Government | 68.658 |
| Netherlands Government | 63.534 |
| Finnish Government | 28.026 |
| Gesamt | 922.930 |
| BlackRock ICS Euro Liquidity Fund | Tsd. EUR |
| France Government | 6.928.051 |
| German Treasury | 2.906.081 |
| Netherlands Government | 814.171 |
| Finnish Government | 84.226 |
| Gesamt | 10.732.529 |
| BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund | Tsd. GBP |
| UK Treasury | 4.935.016 |
| Gesamt | 4.935.016 |
| BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund | Tsd. GBP |
| UK Treasury | 2.776.217 |
| Gesamt | 2.776.217 |
| BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund | Tsd. GBP |
| UK Treasury | 8.168.557 |
| Gesamt | 8.168.557 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund | Tsd. USD |
| Ginnie Mae | 380.471 |
| US Treasury | 243.040 |
| Gesamt | 623.511 |
| BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund | Tsd. USD |
| Freddie Mac | 2.130.886 |
| US Treasury | 1.195.806 |
| Ginnie Mae | 1.119.273 |
| Fannie Mae | 855.521 |
| Gesamt | 5.301.486 |
| BlackRock ICS US Treasury Fund | Tsd. USD |
| US Treasury | 12.294.492 |
| Gesamt | 12.294.492 |

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT)

Glossar und Schlüsseldefinitionen

Die nachstehenden Angaben im regelmäßigen Bericht beziehen sich auf das Jahr bis zum 30. September 2024 (der „Bezugszeitraum“). Die Vergleichsinformationen werden für die Geschäftsjahre zum 30. September 2023 und zum 30. September 2022, die „vorherigen Bezugszeiträume“, vorgelegt.

Alle für die Anlagen des Fonds dargestellten Daten und anderen angegebenen quantitativen Kennzahlen wurden auf der Grundlage eines Durchschnitts des Werts der gehandelten und gehaltenen Anlagen für aktiv verwaltete Fonds zu jedem Quartalsende in dem Bezugszeitraum angegeben, für den der Fonds die Kriterien eines Artikel-8- oder Artikel-9-Fonds erfüllt. Bei den Kennzahlen, die mit Nachhaltigkeitsindikatoren dargestellt werden, bezieht sich die entsprechende Kennzahlenberechnung auf die Anlagen, für die zugrunde liegende ESG-Daten verfügbar sind, und nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen.

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

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

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

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

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

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

Haftungsausschluss

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



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

Name des Produkts:

BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300TSWW0QQLCYQP55

Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? | |
|---|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____ % <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____ % | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von _ % an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt |

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die mit dem Fonds während des Bezugszeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den nachfolgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“. Er gibt Auskunft darüber, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Sicherstellung, dass mindestens 80 % der Vermögenswerte des Fonds (solche, die nicht in staatlichen und öffentlichen Wertpapieren und Instrumenten angelegt sind) überdurchschnittliche Umweltpraktiken aufweisen, wie sie von MSCI oder einem anderen externen Anbieter von ESG-Research, den der Investmentmanager von Zeit zu Zeit nutzt, ermittelt wurden

Der Fonds soll weiterhin 20% weniger Treibhausgasemissionen (gemessen anhand von Daten von MSCI) haben als sein Anlageuniversum der Liquiditätsfonds.

Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologischchemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen

Ausschluss von Emittenten, die Einkünfte aus der direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Komponenten von Atomwaffen oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Zusatzleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen.

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Handel und Angebot von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen.

Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Munition für Kleinwaffen herstellen, die für den Einzelhandelsverkauf an Zivilisten bestimmt sind

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition für zivile Zwecke erzielen.

Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten

Ausschluss von Emittenten, die ein MSCI-ESG-Rating von CCC haben.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Mit dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben
 Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.
 Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen
 Gewährleistung, dass über 90 % der Emittenten der Wertpapiere, in die der Fonds investiert ein ESG-Rating aufweisen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

| Nachhaltigkeitsindikator | Messgröße | Performance | | |
|--|---|--------------------------|------------------------|------------------------|
| | | 2024 | 2023 | 2022 |
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # Anzahl der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |
| Sicherstellung, dass mindestens 80 % der Vermögenswerte des Fonds (solche, die nicht in staatlichen und öffentlichen Wertpapieren und Instrumenten angelegt sind) überdurchschnittliche Umweltpraktiken aufweisen, wie sie von MSCI oder einem anderen externen Anbieter von ESG-Research, den der Investmentmanager von Zeit zu Zeit nutzt, ermittelt wurden. | % der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel), die eine überdurchschnittliche Umweltbewertung gemäß den MSCI-Ratingkriterien aufweisen | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % |
| Der Fonds soll weiterhin 20% weniger Treibhausgasemissionen (gemessen anhand von Daten von MSCI) haben als sein Anlageuniversum der Liquiditätsfonds. | Reduzierung der CO2-Emissionsintensität des Portfolios um % im Vergleich zum Universum, in das investiert wird | 92,78 % | 94,84 % | k.A. ¹ |
| Gewährleistung, dass über 90 % der Emittenten der Wertpapiere, in die der Fonds investiert (unter Ausschluss von Geldmarktfonds) ein ESG-Rating aufweisen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden | % der Emittenten mit ESG-Rating | Über 90 % der Emittenten | k.A. ² | k.A. ² |

¹Der Indikator wurde im Dezember 2022 in die Anlagestrategie aufgenommen, weshalb er in den vorherigen Bezugszeiträumen nicht berichtet wurde.

²Der Indikator wurde im November 2023 in die Anlagestrategie aufgenommen, weshalb er in den vorherigen Bezugszeiträumen nicht berichtet wurde.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die obige Tabelle gibt Aufschluss über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren in den vorangegangenen Bezugszeiträumen (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

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

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

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

– Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte beachten Sie den folgenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem beschrieben wird, wie der Fonds die PAI auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

– Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

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

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



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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen („E&S-Kriterien“), die oben dargelegt sind (siehe „Inwiefern wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“). Der Investmentmanager hat festgestellt, dass diese PAIs als Teil der Anlageauswahlkriterien berücksichtigt wurden. Der spezifische Nachhaltigkeitsindikator des Fonds stimmt unter Umständen nicht in vollem Umfang mit der regulatorischen Definition des entsprechenden PAI überein, der in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards (Regulatory Technical Standards, „RTS“) aufgeführt ist.

| Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen | Nachhaltigkeitsindikatoren |
|--|--|
| Treibhausgasemissionen (THG) (Scope 1/2) | Reduzierung der CO2-Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds |
| THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | Reduzierung der CO2-Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung auf der Grundlage von Kernenergie oder dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen |
| Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Emissionen in Wasser | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

| Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen | Nachhaltigkeitsindikatoren |
|--|---|
| Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt |
| Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen |



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2023 bis zum 30. September 2024.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|--------|-------------------------|------------------------|
| DNB Bank ASA Regs 2024-11-04 | Banken | 2,57 % | Norwegen |
| Credit Agricole SA (London Branch) 2025-01-02 | Banken | 2,47 % | Vereinigtes Königreich |
| DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss 2024-04-02 | Banken | 1,89 % | Deutschland |
| DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss 2024-01-02 | Banken | 1,87 % | Deutschland |
| Tri-Party Natwest Markets Plc 2024-10-01 | Banken | 1,85 % | Europäische Union |
| DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss 2024-10-01 | Banken | 1,73 % | Deutschland |
| DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss 2024-07-01 | Banken | 1,70 % | Deutschland |
| Banque Federative du Credit Mutuel Regs 2024-11-04 | Banken | 1,50 % | Frankreich |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp (Brus 2024-07-01) | Banken | 1,48 % | Belgien |
| Banque Federative du Credit Mutuel Regs 2025-01-06 | Banken | 1,47 % | Frankreich |
| Toronto-Dominion Bank (London Bran 2024-07-18) | Banken | 1,43 % | Vereinigtes Königreich |
| Tri-Party Natwest Markets Plc 2024-01-02 | Banken | 1,29 % | Europäische Union |
| Tri-Party Natwest Markets Plc 2024-04-02 | Banken | 1,11 % | Europäische Union |
| Tri-Party BNP Paribas 2024-01-02 | Banken | 1,11 % | Europäische Union |
| Tri-Party BNP Paribas 2024-10-01 | Banken | 1,11 % | Europäische Union |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

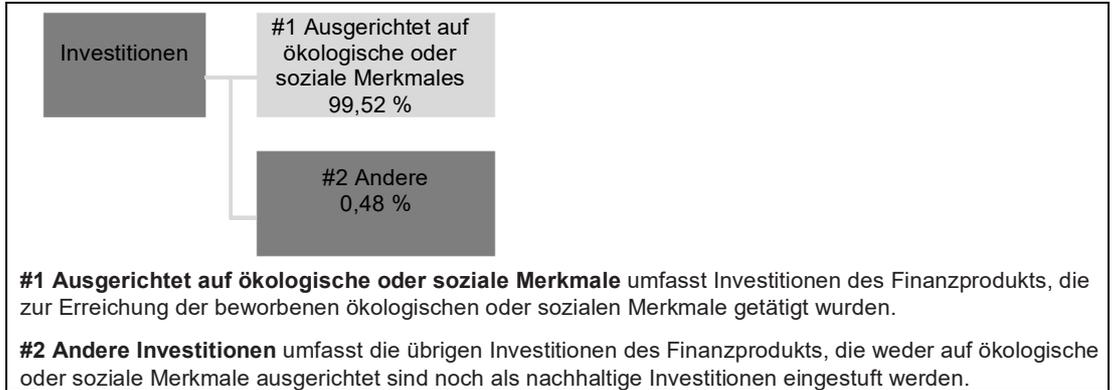
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensallokation des Fonds für den laufenden und vorangegangene Bezugszeiträume.

| Vermögensallokation | % der Investitionen | | |
|---|---------------------|---------|---------|
| | 2024 | 2023 | 2022 |
| #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale | 99,52 % | 97,36 % | 97,88 % |
| #2 Andere | 0,48 % | 2,64 % | 2,12 % |

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren mit einem Anteil von Mehr als 1 %, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|----------------------|----------------------|---------------------|
| Banken | Banken | 84,58 % |
| Sonstige Finanzwerte | Sonstige Finanzwerte | 13,01 % |
| Staatsnahe Titel | Agency-Anleihen | 2,18 % |
| Finanzunternehmen | Finanzunternehmen | 1,14 % |

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilsektoren (wie im Branchenklassifikationssystem von Barclays definiert): Integriert, Unabhängig, Midstream, Ölfelddienstleistungen, Raffination oder Metall- und Bergbauunternehmen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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



In welchem Maß waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.

• Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

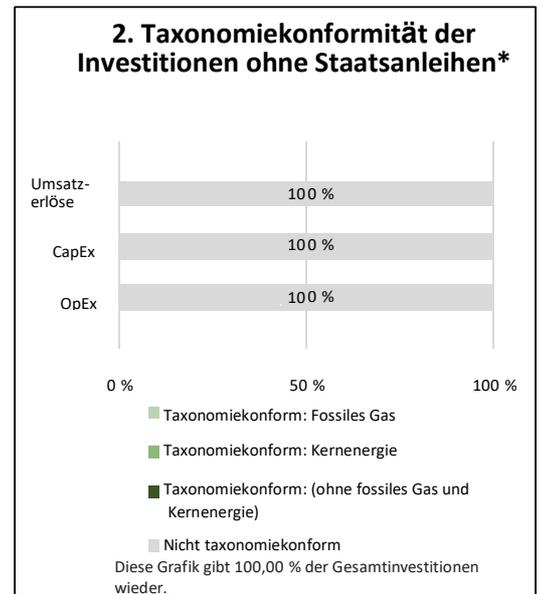
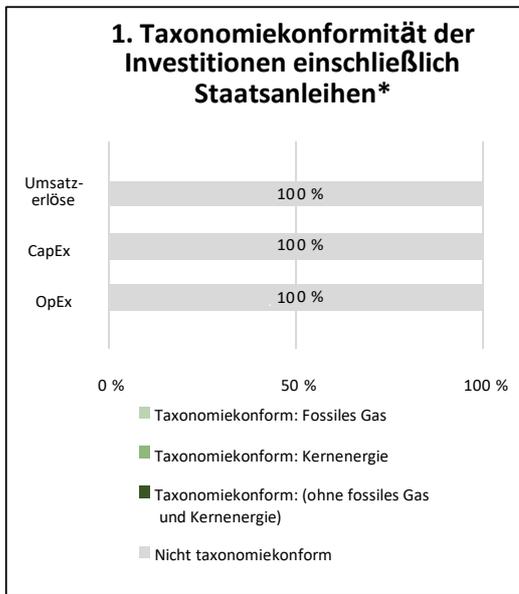
- Ja**
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein**

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



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

Für den Bezugszeitraum wurden 0,00 % der Investitionen des Fonds in Staatsanleihen gehalten.

| Taxonomiekonformität (einschließlich Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|----------|----------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Nicht taxonomiekonform | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % |

| Taxonomiekonformität (ohne Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|----------|----------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Nicht taxonomiekonform | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Die vom Fonds während des Bezugszeitraums gehaltenen Investitionen trugen zu den folgenden ökologischen Zielen der EU-Taxonomie bei:

| | % der Investitionen |
|------------------------------|----------------------------|
| Klimaschutz | 0,00 % |
| Anpassung an den Klimawandel | 0,00 % |

Die in der obigen Tabelle dargestellten Daten sind ungeprüft und wurden weder vom Abschlussprüfer des Fonds noch von einer dritten Partei geprüft. Die Bewertung der Konformität mit der EU-Taxonomie basiert auf den Daten eines externen Anbieters. Die Quelle dieser Daten ist eine Kombination aus gleichwertigen und gemeldeten Daten. Gleichwertige Daten, die den technischen Kriterien der EU-Taxonomie entsprechen, führen zu einem Ergebnis in Bezug auf die Eignung oder die Taxonomiekonformität der Unternehmen, für die uns keine gemeldeten Daten vorliegen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum beliefen sich die Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten wie folgt:

| | % der Investitionen |
|---------------------------|----------------------------|
| Übergangstätigkeiten | 0,00 % |
| Ermöglichende Tätigkeiten | 0,00 % |

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

Für vorherige Bezugszeiträume waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.



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



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Investitionen umfassten Zahlungsmitteläquivalente. Diese Bestände machen allerdings nicht mehr als 20 % aus. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Investmentmanager hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Investmentmanager überprüft regelmäßig die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Investmentmanager davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Investmentmanager mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Investmentmanager kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

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

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



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

Name des Produkts:
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300YBCJ4SKWVANO22

Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? | |
|--|--|
| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von _ % an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____% | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt |

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die mit dem Fonds während des Bezugszeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den nachfolgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“. Er gibt Auskunft darüber, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

| Mit dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale |
|---|
| Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologischchemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen |
| Ausschluss von Emittenten, die Einkünfte aus der direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Komponenten von Atomwaffen oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Zusatzleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen. |
| Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten |
| Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen |
| Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen. |
| Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Handel und Angebot von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen. |
| Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Munition für Kleinwaffen herstellen, die für den Einzelhandelsverkauf an Zivilisten bestimmt sind |
| Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition für zivile Zwecke erzielen. |
| Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten |
| Ausschluss von Emittenten, die ein MSCI-ESG-Rating von CCC haben. |
| Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben. |
| Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

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

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

| Nachhaltigkeitsindikator | Messgröße | Performance | | |
|--|-------------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| | | 2024 | 2023 | 2022 |
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # Anzahl der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |

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

Die obige Tabelle gibt Aufschluss über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren in den vorangegangenen Bezugszeiträumen (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte beachten Sie den folgenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem beschrieben wird, wie der Fonds die PAI auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

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



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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen („E&S-Kriterien“), die oben dargelegt sind (siehe „Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“). Der Investmentmanager hat festgestellt, dass diese PAIs als Teil der Anlageauswahlkriterien berücksichtigt wurden. Der spezifische Nachhaltigkeitsindikator des Fonds stimmt unter Umständen nicht in vollem Umfang mit der regulatorischen Definition des entsprechenden PAI überein, der in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards (Regulatory Technical Standards, „RTS“) aufgeführt ist.

| Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen | Nachhaltigkeitsindikatoren |
|--|---|
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten |
| Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Emissionen in Wasser | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten |
| Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologischchemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen |



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2023 bis zum 30. September 2024.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|--------|-------------------------|------------------------|
| Erste Group Bank Ag Euro 2024-07-01 | Banken | 1,78 % | Österreich |
| Erste Group Bank Ag Euro 2024-04-02 | Banken | 1,62 % | Österreich |
| DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss 2024-07-01 | Banken | 1,60 % | Deutschland |
| Banque Federative du Credit Mutuel Regs 2024-11-04 | Banken | 1,53 % | Frankreich |
| DNB Bank ASA Regs 2024-11-04 | Banken | 1,33 % | Norwegen |
| Erste Group Bank Ag Euro 2024-01-02 | Banken | 1,30 % | Österreich |
| Toronto-Dominion Bank (London Bran 2024-07-18 | Banken | 1,13 % | Vereinigtes Königreich |
| Banque Federative du Credit Mutuel Regs 2025-01-06 | Banken | 1,07 % | Frankreich |
| Erste Group Bank Ag Euro 2024-10-01 | Banken | 1,05 % | Österreich |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

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

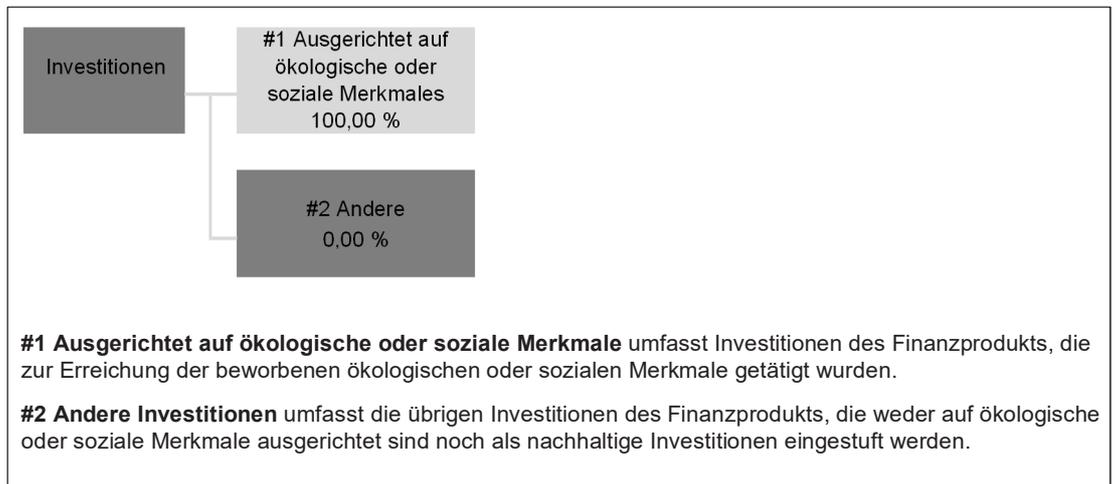
| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|------------------|-------------------------|------------------------|
| Credit Agricole SA (London Branch) 2025-01-02 | Banken | 1,02 % | Vereinigtes Königreich |
| BPCE SA 2024-11-08 | Banken | 0,87 % | Frankreich |
| Toronto-Dominion Bank (London Bran Regs) 2024-08-19 | Banken | 0,85 % | Vereinigtes Königreich |
| DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss 2024-04-02 | Banken | 0,84 % | Deutschland |
| France (Republic Of) Regs 2024-01-04 | US-Schatzwechsel | 0,82 % | Frankreich |
| Toronto-Dominion Bank (London Bran) 2025-02-26 | Banken | 0,76 % | Vereinigtes Königreich |



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

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- **Wie sah die Vermögensallokation aus?**



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensallokation des Fonds für den laufenden und vorangegangene Bezugszeiträume.

| Vermögensallokation | % der Investitionen | | |
|---|---------------------|---------|---------|
| | 2024 | 2023 | 2022 |
| #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale | 100,00 % | 97,18 % | 92,09 % |
| #2 Andere | 0,00 % ¹ | 2,82 % | 7,91 % |

¹Das Nettoengagement in „anderen“ Vermögenswerten betrug bedingt durch die im Fonds gehaltenen Derivatepositionen -2,32 %.

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

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren mit einem Anteil von Mehr als 1 %, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|----------------------|----------------------|---------------------|
| Banken | Banken | 75,68 % |
| Sonstige Finanzwerte | Sonstige Finanzwerte | 7,85 % |
| Staatsnahe Titel | Agency-Anleihen | 6,20 % |
| US-Schatzwechsel | US-Schatzwechsel | 5,80 % |
| Staatsnahe Titel | Kommunalanleihen | 4,86 % |
| Finanzunternehmen | Finanzunternehmen | 2,25 % |

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilsektoren (wie im Branchenklassifikationssystem von Barclays definiert): Integriert, Unabhängig, Midstream, Ölfelddienstleistungen, Raffination oder Metall- und Bergbauunternehmen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

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

- Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



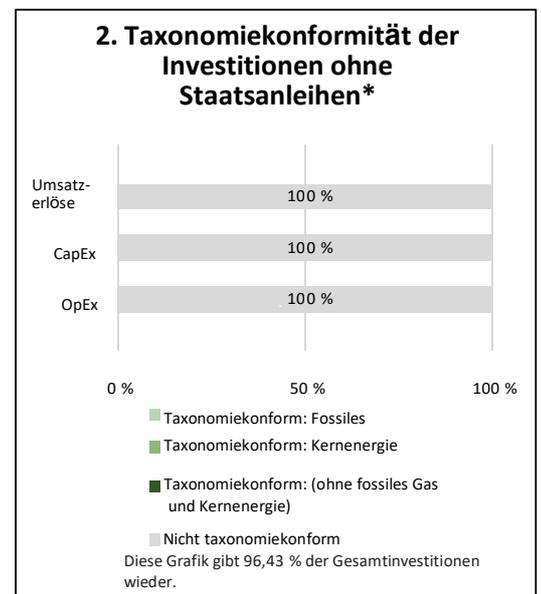
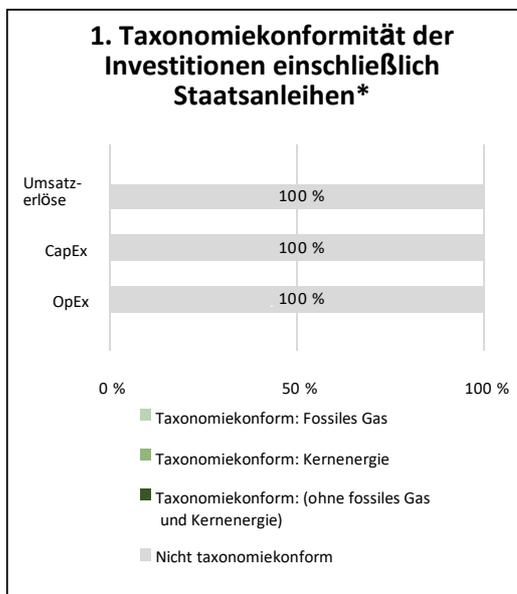
In welchem Maß waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

- Ja**
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein**

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



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

Für den Bezugszeitraum wurden 3,57 % der Investitionen des Fonds in Staatsanleihen gehalten. Aufgrund der begrenzten Verfügbarkeit von Daten konnte die Taxonomiekonformität dieser Engagements nicht ermittelt werden.

| Taxonomiekonformität (einschließlich Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|---------|---------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,01 % | 0,01 % | 0,01 % |
| Nicht taxonomiekonform | 99,99 % | 99,99 % | 99,99 % |

| Taxonomiekonformität (ohne Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|---------|---------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,01 % | 0,01 % | 0,01 % |
| Nicht taxonomiekonform | 99,99 % | 99,99 % | 99,99 % |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

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

Die vom Fonds während des Bezugszeitraums gehaltenen Investitionen trugen zu den folgenden ökologischen Zielen der EU-Taxonomie bei:

| Ökologische Ziele | % der Investitionen |
|------------------------------|---------------------|
| Klimaschutz | 0,01 % |
| Anpassung an den Klimawandel | 0,00 % |

Die in der obigen Tabelle dargestellten Daten sind ungeprüft und wurden weder vom Abschlussprüfer des Fonds noch von einer dritten Partei geprüft. Die Bewertung der Konformität mit der EU-Taxonomie basiert auf den Daten eines externen Anbieters. Die Quelle dieser Daten ist eine Kombination aus gleichwertigen und gemeldeten Daten. Gleichwertige Daten, die den technischen Kriterien der EU-Taxonomie entsprechen, führen zu einem Ergebnis in Bezug auf die Eignung oder die Taxonomiekonformität der Unternehmen, für die uns keine gemeldeten Daten vorliegen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum beliefen sich die Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten wie folgt:

| | % der Investitionen |
|---------------------------|---------------------|
| Übergangstätigkeiten | 0,00 % |
| Ermöglichende Tätigkeiten | 0,00 % |

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

Für vorherige Bezugszeiträume waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.



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



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Investitionen umfassten Zahlungsmitteläquivalente. Diese Bestände machen allerdings nicht mehr als 20 % aus. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Investmentmanager hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Investmentmanager überprüft regelmäßig die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Investmentmanager davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Investmentmanager mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Investmentmanager kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

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

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



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

Name des Produkts:
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300MWO3KX3D7D2N57

Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? | |
|--|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von _ % an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___% | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt |

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die mit dem Fonds während des Bezugszeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den nachfolgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“. Er gibt Auskunft darüber, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

- Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologischchemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen
- Ausschluss von Emittenten, die Einkünfte aus der direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Komponenten von Atomwaffen oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Zusatzleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Handel und Angebot von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Munition für Kleinwaffen herstellen, die für den Einzelhandelsverkauf an Zivilisten bestimmt sind
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition für zivile Zwecke erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten
- Ausschluss von Emittenten, die ein MSCI-ESG-Rating von CCC haben.
- Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben
- Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.
- Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

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

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

| Nachhaltigkeitsindikator | Messgröße | Performance | | |
|--|-------------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| | | 2024 | 2023 | 2022 |
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # Anzahl der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |

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

Die obige Tabelle gibt Aufschluss über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren in den vorangegangenen Bezugszeiträumen (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte beachten Sie den folgenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem beschrieben wird, wie der Fonds die PAI auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

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



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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen („E&S-Kriterien“), die oben dargelegt sind (siehe „Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“). Der Investmentmanager hat festgestellt, dass diese PAIs als Teil der Anlageauswahlkriterien berücksichtigt wurden. Der spezifische Nachhaltigkeitsindikator des Fonds stimmt unter Umständen nicht in vollem Umfang mit der regulatorischen Definition des entsprechenden PAI überein, der in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards (Regulatory Technical Standards, „RTS“) aufgeführt ist.

| Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen | Nachhaltigkeitsindikatoren |
|--|---|
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten |
| Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Emissionen in Wasser | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten |
| Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, angereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen |



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|-----------------------|-------------------------|------------------------|
| Toyota Motor Finance (Netherlands) MTN Regs 2025-05-28 | Zyklische Konsumgüter | 4,44 % | Niederlande |
| BPCE SA MTN Regs 2025-07-18 | Banken | 4,21 % | Frankreich |
| Lloyds Bank Corporate Markets Plc MTN Regs 2025-08-30 | Banken | 3,40 % | Vereinigtes Königreich |
| Toronto-Dominion Bank (London Bran 2024-09-18 | Banken | 3,38 % | Vereinigtes Königreich |
| DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss Regs 2025-02-28 | Banken | 3,35 % | Deutschland |

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2023 bis zum 30. September 2024.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

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

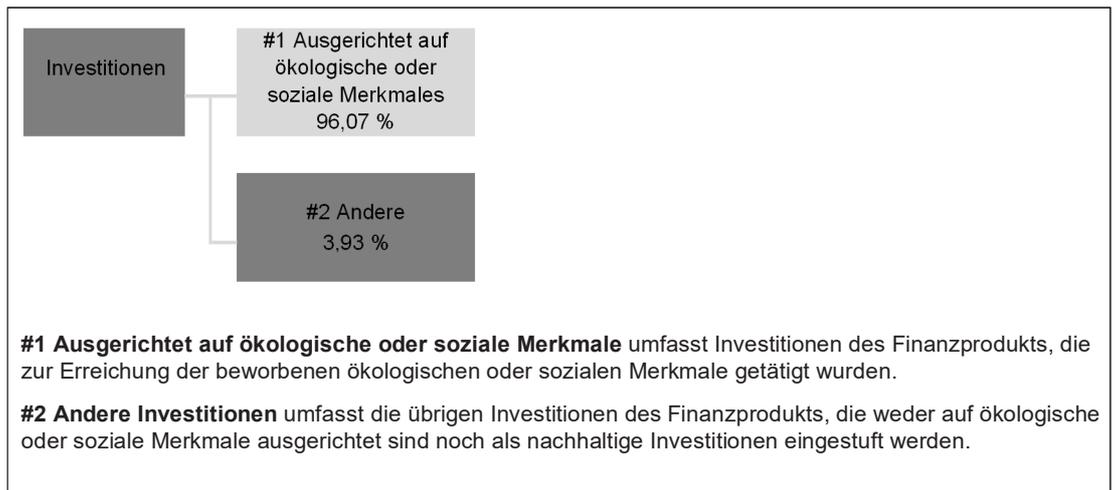
| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|----------------|-------------------------|------------------------|
| Metropolitan Life Global Funding I Regs 2025-06-18 | Versicherungen | 3,14 % | Vereinigte Staaten |
| Macquarie Bank Ltd Regs 2024-10-31 | Banken | 3,07 % | Australien |
| Standard Chartered Bank MTN Regs 2025-03-03 | Banken | 2,49 % | Vereinigtes Königreich |
| Credit Agricole SA (London Branch) 2025-02-28 | Banken | 2,29 % | Vereinigtes Königreich |
| ABN AMRO Bank NV MTN Regs 2025-01-10 | Banken | 2,14 % | Niederlande |
| Nationwide Building Society MTN Regs 2025-11-10 | Banken | 2,10 % | Vereinigtes Königreich |
| Natwest Markets Plc MTN Regs 2026-01-09 | Banken | 1,70 % | Vereinigtes Königreich |
| HSBC Continental Europe SA Regs 2024-06-28 | Banken | 1,69 % | Frankreich |
| Banco Santander SA MTN Regs 2025-01-16 | Banken | 1,64 % | Spanien |
| Barclays Bank Plc 2025-03-07 | Banken | 1,52 % | Vereinigtes Königreich |



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

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensallokation des Fonds für den laufenden und vorangegangene Bezugszeiträume.

| Vermögensallokation | % der Investitionen | | |
|---|---------------------|---------|---------|
| | 2024 | 2023 | 2022 |
| #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale | 96,07 % | 95,49 % | 97,29 % |
| #2 Andere | 3,93 % | 4,51 % | 2,71 % |

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren mit einem Anteil von Mehr als 1 %, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|-----------------------|-------------------------|---------------------|
| Banken | Banken | 72,30 % |
| Sonstige Finanzwerte | Sonstige Finanzwerte | 10,63 % |
| Zyklische Konsumgüter | Auto | 5,55 % |
| Versicherungen | Lebensversicherung | 3,61 % |
| Finanzunternehmen | Finanzunternehmen | 2,46 % |
| Strom | Strom | 1,81 % |
| REITs | Einzelhandel-REIT | 1,37 % |
| Kommunikation | Medien und Unterhaltung | 1,20 % |

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilsektoren (wie im Branchenklassifikationssystem von Barclays definiert): Integriert, Unabhängig, Midstream, Ölfelddienstleistungen, Raffination oder Metall- und Bergbauunternehmen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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

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

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



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

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.

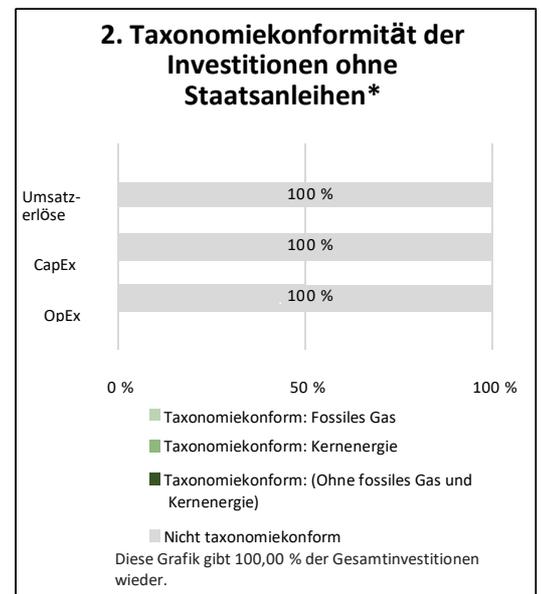
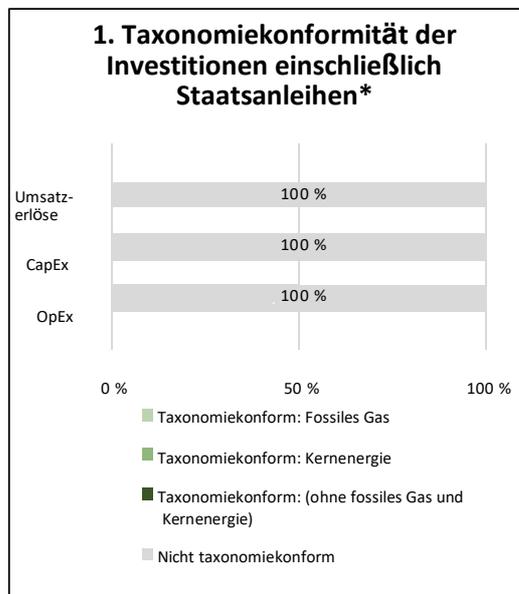
- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

Ja

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



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

Für den Bezugszeitraum wurden 0,00 % der Investitionen des Fonds in Staatsanleihen gehalten.

| Taxonomiekonformität (einschließlich Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|---------|----------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,13 % | 0,12 % | 0,00 % |
| Nicht taxonomiekonform | 99,87 % | 99,88 % | 100,00 % |

| Taxonomiekonformität (ohne Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|---------|----------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,13 % | 0,12 % | 0,00 % |
| Nicht taxonomiekonform | 99,87 % | 99,88 % | 100,00 % |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

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

Die vom Fonds während des Bezugszeitraums gehaltenen Investitionen trugen zu den folgenden ökologischen Zielen der EU-Taxonomie bei:

| Ökologische Ziele | % der Investitionen |
|------------------------------|---------------------|
| Klimaschutz | 0,13 % |
| Anpassung an den Klimawandel | 0,00 % |

Die in der obigen Tabelle dargestellten Daten sind ungeprüft und wurden weder vom Abschlussprüfer des Fonds noch von einer dritten Partei geprüft. Die Bewertung der Konformität mit der EU-Taxonomie basiert auf den Daten eines externen Anbieters. Die Quelle dieser Daten ist eine Kombination aus gleichwertigen und gemeldeten Daten. Gleichwertige Daten, die den technischen Kriterien der EU-Taxonomie entsprechen, führen zu einem Ergebnis in Bezug auf die Eignung oder die Taxonomiekonformität der Unternehmen, für die uns keine gemeldeten Daten vorliegen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum beliefen sich die Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten wie folgt:

| | % der Investitionen |
|---------------------------|---------------------|
| Übergangstätigkeiten | 0,00 % |
| Ermöglichende Tätigkeiten | 0,01 % |

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

Für vorherige Bezugszeiträume waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.



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



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Investitionen umfassten Zahlungsmitteläquivalente. Diese Bestände machen allerdings nicht mehr als 20 % aus. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Investmentmanager hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Investmentmanager überprüft regelmäßig die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Investmentmanager davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Investmentmanager mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Investmentmanager kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:

BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300PS1MQ5RT4H4U08

Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? | |
|---|---|
| <input checked="" type="radio"/> Ja | <input checked="" type="radio"/> Nein |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____% | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von _ % an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt |

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die mit dem Fonds während des Bezugszeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den nachfolgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“. Er gibt Auskunft darüber, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Sicherstellung, dass mindestens 80 % der Vermögenswerte des Fonds (solche, die nicht in staatlichen und öffentlichen Wertpapieren und Instrumenten angelegt sind) überdurchschnittliche Umweltpraktiken aufweisen, wie sie von MSCI oder einem anderen externen Anbieter von ESG-Research, den der Investmentmanager von Zeit zu Zeit nutzt, ermittelt wurden

Der Fonds soll weiterhin 20% weniger Treibhausgasemissionen (gemessen anhand von Daten von MSCI) haben als sein Anlageuniversum der Liquiditätsfonds.

Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologischchemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen

Ausschluss von Emittenten, die Einkünfte aus der direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Komponenten von Atomwaffen oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Zusatzleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen.

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Handel und Angebot von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen.

Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Munition für Kleinwaffen herstellen, die für den Einzelhandelsverkauf an Zivilisten bestimmt sind

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition für zivile Zwecke erzielen.

Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten

Ausschluss von Emittenten, die ein MSCI-ESG-Rating von CCC haben.

Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben

Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.



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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Mit dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

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

Gewährleistung, dass über 90 % der Emittenten der Wertpapiere, in die der Fonds investiert ein ESG-Rating aufweisen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden

Gewährleistung, dass über 90 % der Emittenten der Wertpapiere, in die der Fonds investiert ein ESG-Rating aufweisen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden

• Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

| Nachhaltigkeitsindikator | Messgröße | Performance | | |
|---|---|--------------------------|------------------------|------------------------|
| | | 2024 | 2023 | 2022 |
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # Anzahl der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |
| Sicherstellung, dass mindestens 80 % der Vermögenswerte des Fonds (solche, die nicht in staatlichen und öffentlichen Wertpapieren und Instrumenten angelegt sind) überdurchschnittliche Umweltpraktiken aufweisen, wie sie von MSCI oder einem anderen externen Anbieter von ESG-Research, den der Investmentmanager von Zeit zu Zeit nutzt, ermittelt wurden | % der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel), die eine überdurchschnittliche Umweltbewertung gemäß den MSCI-Ratingkriterien aufweisen | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % |
| Der Fonds soll weiterhin 20% weniger Treibhausgasemissionen (gemessen anhand von Daten von MSCI) haben als sein Anlageuniversum der Liquiditätsfonds. | Reduzierung der CO2-Emissionsintensität des Portfolios um % im Vergleich zum Universum, in das investiert wird | 94,09 % | 94,75 % | k.A. ¹ |
| Gewährleistung, dass über 90 % der Emittenten der Wertpapiere, in die der Fonds investiert (unter Ausschluss von Geldmarktfonds) ein ESG-Rating aufweisen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden | % der Emittenten mit ESG-Rating | Über 90 % der Emittenten | k.A. ² | k.A. ² |

¹Der Indikator wurde im Dezember 2022 in die Anlagestrategie aufgenommen, weshalb er in den vorherigen Bezugszeiträumen nicht berichtet wurde.

²Der Indikator wurde im November 2023 in die Anlagestrategie aufgenommen, weshalb er in den vorherigen Bezugszeiträumen nicht berichtet wurde.

• ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die obige Tabelle gibt Aufschluss über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren in den vorangegangenen Bezugszeiträumen (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

• Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

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

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**
Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.
- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**
Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte beachten Sie den folgenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem beschrieben wird, wie der Fonds die PAI auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.
- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**
Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

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

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

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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen („E&S-Kriterien“), die oben dargelegt sind (siehe „Inwiefern wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“). Der Investmentmanager hat festgestellt, dass diese PAIs als Teil der Anlageauswahlkriterien berücksichtigt wurden. Der spezifische Nachhaltigkeitsindikator des Fonds stimmt unter Umständen nicht in vollem Umfang mit der regulatorischen Definition des entsprechenden PAI überein, der in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards (Regulatory Technical Standards, „RTS“) aufgeführt ist.

| Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen | Nachhaltigkeitsindikatoren |
|--|--|
| Treibhausgasemissionen (THG) (Scope 1/2) | Reduzierung der CO ₂ -Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds |
| THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | Reduzierung der CO ₂ -Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung auf der Grundlage von Kernenergie oder dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen |
| Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

| Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen | Nachhaltigkeitsindikatoren |
|--|---|
| Emissionen in Wasser | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt |
| Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen |



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2023 bis zum 30. September 2024.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|------------------|-------------------------|------------------------|
| Toronto-Dominion Bank (London Branch 2024-11-01) | Banken | 1,89 % | Vereinigtes Königreich |
| HM Treasury GB 2024-07-01 | US-Schatzwechsel | 1,88 % | Vereinigtes Königreich |
| HM Treasury GB 2024-04-02 | US-Schatzwechsel | 1,35 % | Vereinigtes Königreich |
| Mizuho Bank Ltd (London Branch) GB 2024-10-01 | Banken | 1,10 % | Vereinigtes Königreich |
| Tri-Party Barclays Bank Plc 2024-01-02 | Banken | 1,08 % | Vereinigtes Königreich |
| Royal Bank of Canada (London Branch MTN Regs 2024-07-08) | Banken | 1,05 % | Vereinigtes Königreich |
| Banque Federative du Credit Mutuel Regs 2024-04-02 | Banken | 0,99 % | Frankreich |
| HM Treasury GB 2024-01-02 | US-Schatzwechsel | 0,94 % | Vereinigtes Königreich |
| Bred Banque Populaire GB 2024-10-01 | Banken | 0,88 % | Frankreich |
| MUFG Bank Ltd (London Branch) GB 2024-07-01 | Banken | 0,83 % | Vereinigtes Königreich |
| MUFG Bank Ltd (London Branch) GB 2024-04-02 | Banken | 0,82 % | Vereinigtes Königreich |
| MUFG Bank Ltd (London Branch) GB 2024-01-02 | Banken | 0,81 % | Vereinigtes Königreich |
| Tri-Party BNP Paribas 2024-01-02 | Banken | 0,81 % | Vereinigtes Königreich |
| Tri-Party National Australia Bank 2024-01-02 | Banken | 0,81 % | Vereinigtes Königreich |
| -Party BNP Paribas 2024-10-01 | Banken | 0,69 % | Vereinigtes Königreich |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

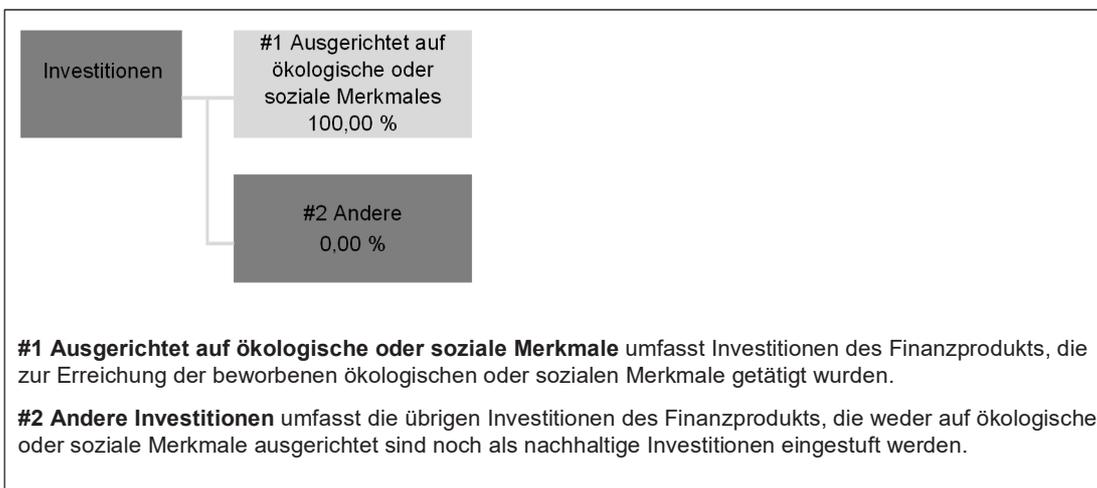
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensallokation des Fonds für den laufenden und vorangegangene Bezugszeiträume.

| Vermögensallokation | % der Investitionen | | |
|---|---------------------|---------|---------|
| | 2024 | 2023 | 2022 |
| #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale | 100,00 % | 97,34 % | 97,55 % |
| #2 Andere | 0,00 % ¹ | 2,66 % | 2,45 % |

¹Das Nettoengagement in „anderen“ Vermögenswerten betrug bedingt durch die im Fonds gehaltenen Derivatepositionen -0,74 %.

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren mit einem Anteil von Mehr als 1 %, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|-----------------------|----------------------|---------------------|
| Banken | Banken | 91,11 % |
| US-Schatzwechsel | US-Schatzwechsel | 4,57 % |
| Finanzunternehmen | Finanzunternehmen | 2,60 % |
| Sonstige Finanzwerte | Sonstige Finanzwerte | 2,51 % |
| Zyklische Konsumgüter | Auto | 1,99 % |

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilsektoren (wie im Branchenklassifikationssystem von Barclays definiert): Integriert, Unabhängig, Midstream, Ölfelddienstleistungen, Raffination oder Metall- und Bergbauunternehmen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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



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

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.

• Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

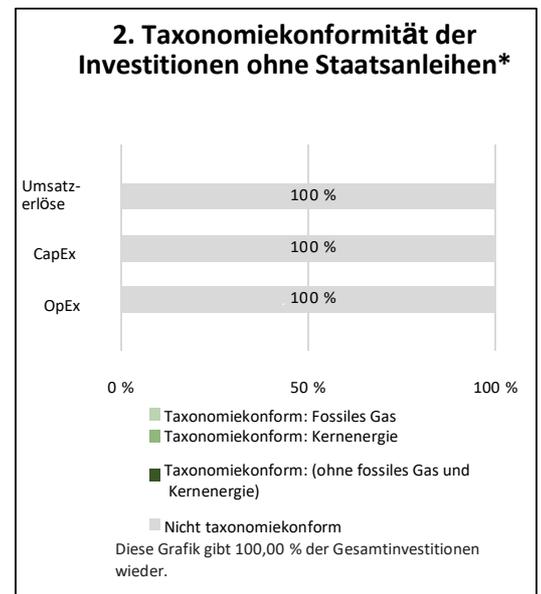
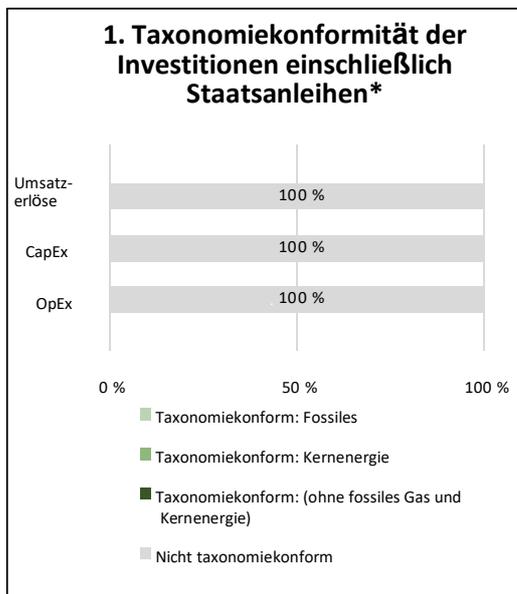
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

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

Mit Blick auf die EU-Taxonomekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



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

Für den Bezugszeitraum wurden 0,00 % der Investitionen des Fonds in Staatsanleihen gehalten.

| Taxonomekonformität (einschließlich Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|--|--------------|----------|----------|
| Taxonomekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Nicht taxonomiekonform | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % |

| Taxonomekonformität (ohne Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|--|--------------|----------|----------|
| Taxonomekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Nicht taxonomiekonform | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Die vom Fonds während des Bezugszeitraums gehaltenen Investitionen trugen zu den folgenden ökologischen Zielen der EU-Taxonomie bei:

| Ökologische Ziele | % der Investitionen |
|------------------------------|---------------------|
| Klimaschutz | 0,00 % |
| Anpassung an den Klimawandel | 0,00 % |

Die in der obigen Tabelle dargestellten Daten sind ungeprüft und wurden weder vom Abschlussprüfer des Fonds noch von einer dritten Partei geprüft. Die Bewertung der Konformität mit der EU-Taxonomie basiert auf den Daten eines externen Anbieters. Die Quelle dieser Daten ist eine Kombination aus gleichwertigen und gemeldeten Daten. Gleichwertige Daten, die den technischen Kriterien der EU-Taxonomie entsprechen, führen zu einem Ergebnis in Bezug auf die Eignung oder die Taxonomiekonformität der Unternehmen, für die uns keine gemeldeten Daten vorliegen.

• **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum beliefen sich die Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten wie folgt:

| | % der Investitionen |
|---------------------------|---------------------|
| Übergangstätigkeiten | 0,00 % |
| Ermöglichende Tätigkeiten | 0,00 % |

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

Für vorherige Bezugszeiträume waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.



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



• **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



• **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



• **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Investitionen umfassten Zahlungsmitteläquivalente. Diese Bestände machen allerdings nicht mehr als 20 % aus. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.



• **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Investmentmanager hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Investmentmanager überprüft regelmäßig die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Investmentmanager davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Investmentmanager mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Investmentmanager kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

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

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



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

Name des Produkts:
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300KXRVZGAAWQCG88

Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? | |
|---|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | <input type="checkbox"/> <input checked="" type="radio"/> Nein |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____% | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von _ % an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt |

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die mit dem Fonds während des Bezugszeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den nachfolgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“. Er gibt Auskunft darüber, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

- Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologischchemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen
- Ausschluss von Emittenten, die Einkünfte aus der direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Komponenten von Atomwaffen oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Zusatzleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Handel und Angebot von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Munition für Kleinwaffen herstellen, die für den Einzelhandelsverkauf an Zivilisten bestimmt sind
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition für zivile Zwecke erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten
- Ausschluss von Emittenten, die ein MSCI-ESG-Rating von CCC haben.
- Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben
- Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.
- Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

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

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

| Nachhaltigkeitsindikator | Messgröße | Performance | | |
|--|-------------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| | | 2024 | 2023 | 2022 |
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # Anzahl der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |

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

Die obige Tabelle gibt Aufschluss über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren in den vorangegangenen Bezugszeiträumen (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte beachten Sie den folgenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem beschrieben wird, wie der Fonds die PAI auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

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

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

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

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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen („E&S-Kriterien“), die oben dargelegt sind (siehe „Inwiefern wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“). Der Investmentmanager hat festgestellt, dass diese PAIs als Teil der Anlageauswahlkriterien berücksichtigt wurden. Der spezifische Nachhaltigkeitsindikator des Fonds stimmt unter Umständen nicht in vollem Umfang mit der regulatorischen Definition des entsprechenden PAI überein, der in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards (Regulatory Technical Standards, „RTS“) aufgeführt ist.



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

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

| Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen | Nachhaltigkeitsindikatoren |
|--|---|
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten |
| Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Emissionen in Wasser | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten |
| Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, angereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen |



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|----------------|-------------------------|------------------------|
| Toronto-Dominion Bank (London Bran 2024-11-01) | Banken | 1,51 % | Vereinigtes Königreich |
| Royal Bank of Canada (London Branc MTN Regs 2024-07-08) | Banken | 1,15 % | Vereinigtes Königreich |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd (Lo 2024-07-01) | Banken | 1,01 % | Vereinigtes Königreich |
| Banque Federative du Credit Mutuel Regs 2024-04-02 | Banken | 0,99 % | Frankreich |
| New York Life Global Funding Regs 2024-08-30 | Banken | 0,95 % | Vereinigtes Königreich |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd (Lo 2024-01-02) | Versicherungen | 0,95 % | Vereinigte Staaten |
| Nationwide Building Society 2024-07-03 | Banken | 0,88 % | Vereinigtes Königreich |
| Nationwide Building Society 2024-04-03 | Banken | 0,85 % | Vereinigtes Königreich |
| Nationwide Building Society 2024-10-02 | Banken | 0,84 % | Vereinigtes Königreich |
| Nationwide Building Society 2024-01-03 | Banken | 0,76 % | Vereinigtes Königreich |
| National Australia Bank Ltd (Londo Regs 2025-01-13) | Banken | 0,73 % | Vereinigtes Königreich |
| BNP Paribas (London Branch) 2024-04-03 | Banken | 0,73 % | Vereinigtes Königreich |
| Toronto-Dominion Bank (London Bran 2025-03-24) | Banken | 0,73 % | Vereinigtes Königreich |
| Rep Gilt Abnat 2024-04-02 | Banken | 0,72 % | Vereinigtes Königreich |

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2023 bis zum 30. September 2024.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

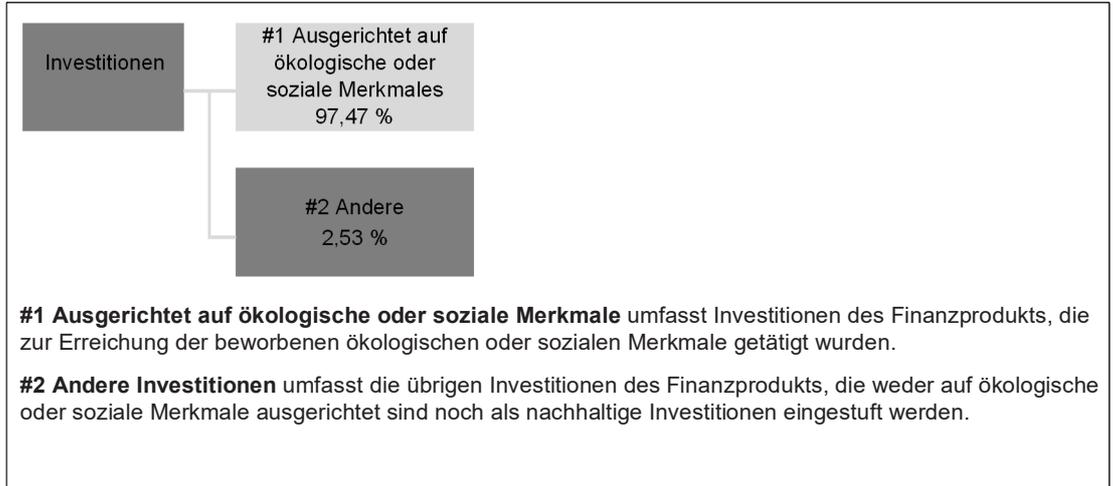
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensallokation des Fonds für den laufenden und vorangegangene Bezugszeiträume.

| Vermögensallokation | % der Investitionen | | |
|---|---------------------|---------|---------|
| | 2024 | 2023 | 2022 |
| #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale | 97,47 % | 96,67 % | 96,12 % |
| #2 Andere | 2,53 % | 3,33 % | 3,88 % |

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren mit einem Anteil von Mehr als 1 %, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|-----------------------|----------------------|---------------------|
| Banken | Banken | 84,68 % |
| Finanzunternehmen | Finanzunternehmen | 4,85 % |
| Staatsnahe Titel | Agency-Anleihen | 3,58 % |
| Zyklische Konsumgüter | Auto | 2,22 % |
| Sonstige Finanzwerte | Sonstige Finanzwerte | 2,04 % |
| US-Schatzwechsel | US-Schatzwechsel | 1,61 % |
| Versicherungen | Lebensversicherung | 1,46 % |

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilsektoren (wie im Branchenklassifikationssystem von Barclays definiert): Integriert, Unabhängig, Midstream, Ölfelddienstleistungen, Raffination oder Metall- und Bergbauunternehmen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



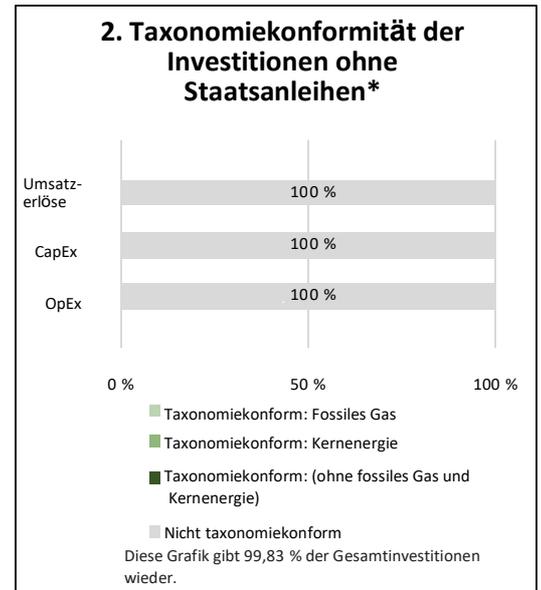
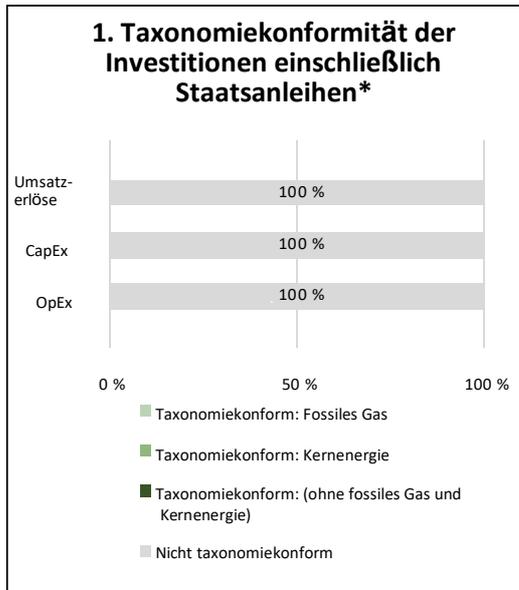
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



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

Für den Bezugszeitraum wurden 0,17 % der Investitionen des Fonds in Staatsanleihen gehalten. Aufgrund der begrenzten Verfügbarkeit von Daten konnte die Taxonomiekonformität dieser Engagements nicht ermittelt werden.

| Taxonomiekonformität (einschließlich Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|----------|----------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Nicht taxonomiekonform | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % |

| Taxonomiekonformität (ohne Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|----------|----------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Nicht taxonomiekonform | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

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

Die vom Fonds während des Bezugszeitraums gehaltenen Investitionen trugen zu den folgenden ökologischen Zielen der EU-Taxonomie bei:

| Ökologische Ziele | % der Investitionen |
|------------------------------|---------------------|
| Klimaschutz | 0,00 % |
| Anpassung an den Klimawandel | 0,00 % |

Die in der obigen Tabelle dargestellten Daten sind ungeprüft und wurden weder vom Abschlussprüfer des Fonds noch von einer dritten Partei geprüft. Die Bewertung der Konformität mit der EU-Taxonomie basiert auf den Daten eines externen Anbieters. Die Quelle dieser Daten ist eine Kombination aus gleichwertigen und gemeldeten Daten. Gleichwertige Daten, die den technischen Kriterien der EU-Taxonomie entsprechen, führen zu einem Ergebnis in Bezug auf die Eignung oder die Taxonomiekonformität der Unternehmen, für die uns keine gemeldeten Daten vorliegen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum beliefen sich die Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten wie folgt:

| | % der Investitionen |
|---------------------------|---------------------|
| Übergangstätigkeiten | 0,00 % |
| Ermöglichende Tätigkeiten | 0,00 % |

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

Für vorherige Bezugszeiträume waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.



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



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Investitionen umfassten Zahlungsmitteläquivalente. Diese Bestände machen allerdings nicht mehr als 20 % aus. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Investmentmanager hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Investmentmanager überprüft regelmäßig die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Investmentmanager davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Investmentmanager mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Investmentmanager kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

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

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



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

Name des Produkts:
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493003GYZKMWFM4I31

Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? | |
|--|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____ % | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von _ % an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____ % | <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt |

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die mit dem Fonds während des Bezugszeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den nachfolgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“. Er gibt Auskunft darüber, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

- Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologischchemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen
- Ausschluss von Emittenten, die Einkünfte aus der direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Komponenten von Atomwaffen oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Zusatzleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Handel und Angebot von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Munition für Kleinwaffen herstellen, die für den Einzelhandelsverkauf an Zivilisten bestimmt sind
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition für zivile Zwecke erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten
- Ausschluss von Emittenten, die ein MSCI-ESG-Rating von CCC haben.
- Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben
- Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.
- Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

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

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

| Nachhaltigkeitsindikator | Messgröße | Performance | | |
|--|-------------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| | | 2024 | 2023 | 2022 |
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # Anzahl der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |

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

Die obige Tabelle gibt Aufschluss über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren in den vorangegangenen Bezugszeiträumen (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte beachten Sie den folgenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem beschrieben wird, wie der Fonds die PAI auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

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

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

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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen („E&S-Kriterien“), die oben dargelegt sind (siehe „Inwiefern wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“). Der Investmentmanager hat festgestellt, dass diese PAIs als Teil der Anlageauswahlkriterien berücksichtigt wurden. Der spezifische Nachhaltigkeitsindikator des Fonds stimmt unter Umständen nicht in vollem Umfang mit der regulatorischen Definition des entsprechenden PAI überein, der in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards (Regulatory Technical Standards, „RTS“) aufgeführt ist.



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

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

| Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen | Nachhaltigkeitsindikatoren |
|--|---|
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten |
| Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Emissionen in Wasser | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten |
| Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen |



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|--------|-------------------------|------------------------|
| Macquarie Bank Ltd Regs 2024-11-01 | Banken | 2,67 % | Australien |
| Banque Federative du Credit Mutuel Regs 2025-01-17 | Banken | 2,63 % | Frankreich |
| BPCE SA Regs 2024-11-04 | Banken | 2,52 % | Frankreich |
| National Westminster Bank Plc 2024-11-04 | Banken | 2,49 % | Vereinigtes Königreich |
| BPCE SA 2024-08-16 | Banken | 2,28 % | Frankreich |
| Barclays Bank Uk Plc 2025-03-10 | Banken | 2,24 % | Vereinigtes Königreich |
| Toronto-Dominion Bank (London Branch) 2025-04-02 | Banken | 2,24 % | Vereinigtes Königreich |
| Banco Santander SA (London Branch) 2024-05-21 | Banken | 2,04 % | Vereinigtes Königreich |
| Toronto-Dominion Bank (London Branch) 2024-09-19 | Banken | 1,85 % | Vereinigtes Königreich |
| Bank of Nova Scotia GB 2024-10-01 | Banken | 1,74 % | Kanada |
| Societe Generale SA Regs 2025-05-13 | Banken | 1,74 % | Frankreich |
| Bank of Nova Scotia GB 2024-07-01 | Banken | 1,73 % | Kanada |
| Bank of Montreal (London Branch) 2025-06-13 | Banken | 1,66 % | Vereinigtes Königreich |
| Credit Agricole Corporate And Inve 2024-06-24 | Banken | 1,64 % | Frankreich |
| BNP Paribas (London Branch) 2024-05-28 | Banken | 1,57 % | Vereinigtes Königreich |

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2023 bis zum 30. September 2024.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

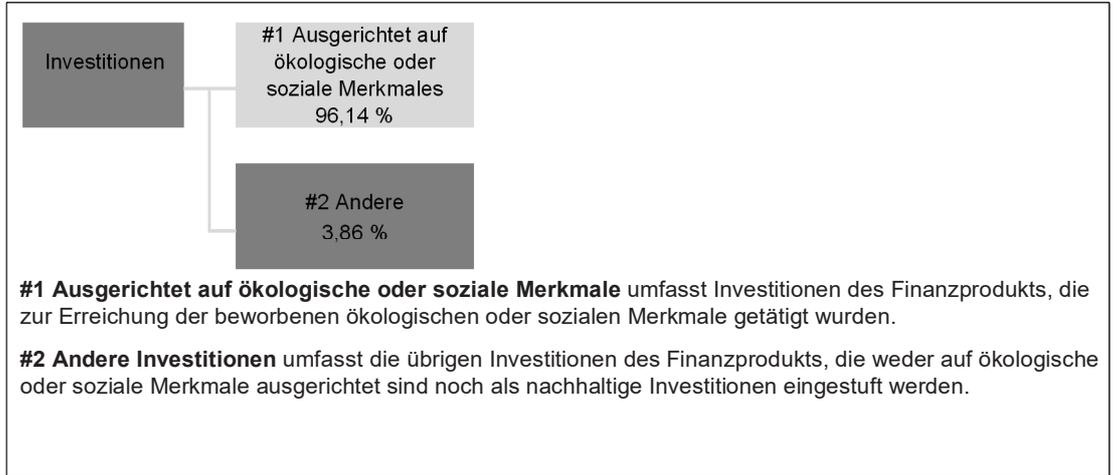
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensallokation des Fonds für den laufenden und vorangegangene Bezugszeiträume.

| Vermögensallokation | % der Investitionen | | |
|---|---------------------|---------|---------|
| | 2024 | 2023 | 2022 |
| #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale | 96,14 % | 93,14 % | 96,77 % |
| #2 Andere | 3,86 % | 6,86 % | 3,23 % |

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren mit einem Anteil von Mehr als 1 %, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------|
| Banken | Banken | 85,29 % |
| Sonstige Finanzwerte | Sonstige Finanzwerte | 8,63 % |
| Staatsnahe Titel | Agency-Anleihen | 2,31 % |
| Finanzunternehmen | Finanzunternehmen | 1,09 % |
| Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | 1,09 % |

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilsektoren (wie im Branchenklassifikationssystem von Barclays definiert): Integriert, Unabhängig, Midstream, Ölfelddienstleistungen, Raffination oder Metall- und Bergbauunternehmen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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

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

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



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

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.

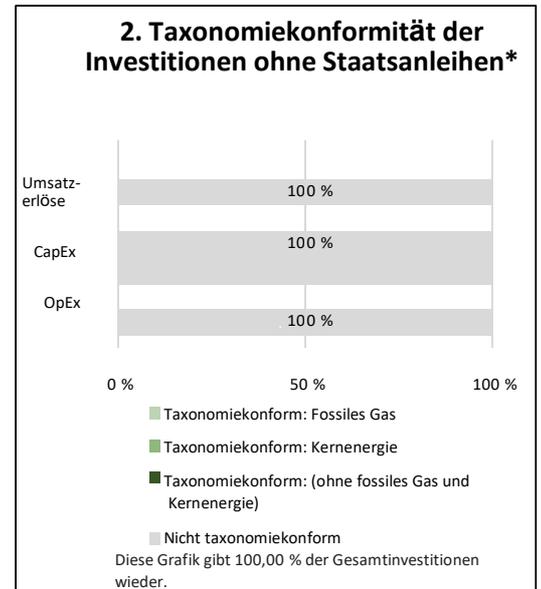
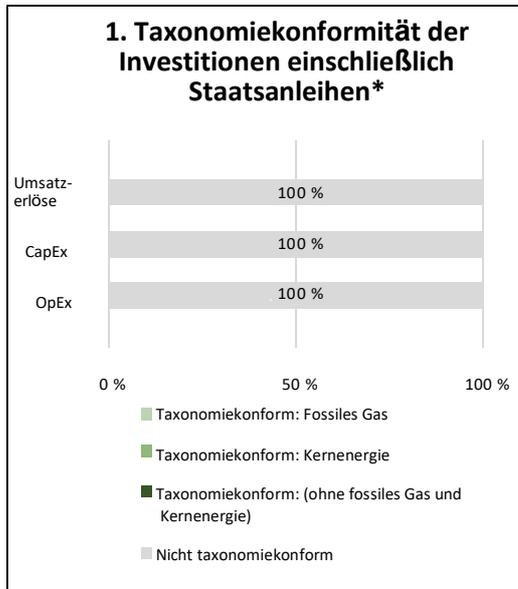
- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

Ja

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



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

Für den Bezugszeitraum wurden 0,00 % der Investitionen des Fonds in Staatsanleihen gehalten.

| Taxonomiekonformität (einschließlich Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|----------|----------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Nicht taxonomiekonform | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % |

| Taxonomiekonformität (ohne Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|----------|----------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Nicht taxonomiekonform | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

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

Die vom Fonds während des Bezugszeitraums gehaltenen Investitionen trugen zu den folgenden ökologischen Zielen der EU-Taxonomie bei:

| Ökologische Ziele | % der Investitionen |
|------------------------------|---------------------|
| Klimaschutz | 0,00 % |
| Anpassung an den Klimawandel | 0,00 % |

Die in der obigen Tabelle dargestellten Daten sind ungeprüft und wurden weder vom Abschlussprüfer des Fonds noch von einer dritten Partei geprüft. Die Bewertung der Konformität mit der EU-Taxonomie basiert auf den Daten eines externen Anbieters. Die Quelle dieser Daten ist eine Kombination aus gleichwertigen und gemeldeten Daten. Gleichwertige Daten, die den technischen Kriterien der EU-Taxonomie entsprechen, führen zu einem Ergebnis in Bezug auf die Eignung oder die Taxonomiekonformität der Unternehmen, für die uns keine gemeldeten Daten vorliegen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum beliefen sich die Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten wie folgt:

| | % der Investitionen |
|---------------------------|---------------------|
| Übergangstätigkeiten | 0,00 % |
| Ermöglichende Tätigkeiten | 0,00 % |

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

Für vorherige Bezugszeiträume waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.



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



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Investitionen umfassten Zahlungsmitteläquivalente. Diese Bestände machen allerdings nicht mehr als 20 % aus. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Investmentmanager hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Investmentmanager überprüft regelmäßig die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Investmentmanager davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Investmentmanager mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Investmentmanager kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



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

Name des Produkts:

BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300OKSM0SGPTHJ605

Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? | |
|---|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____% | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von _ % an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt |

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die mit dem Fonds während des Bezugszeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den nachfolgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“. Er gibt Auskunft darüber, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Sicherstellung, dass mindestens 80 % der Vermögenswerte des Fonds (solche, die nicht in staatlichen und öffentlichen Wertpapieren und Instrumenten angelegt sind) überdurchschnittliche Umweltpraktiken aufweisen, wie sie von MSCI oder einem anderen externen Anbieter von ESG-Research, den der Investmentmanager von Zeit zu Zeit nutzt, ermittelt wurden

Der Fonds soll weiterhin 20% weniger Treibhausgasemissionen (gemessen anhand von Daten von MSCI) haben als sein Anlageuniversum der Liquiditätsfonds.

Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologischchemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen

Ausschluss von Emittenten, die Einkünfte aus der direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Komponenten von Atomwaffen oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Zusatzleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen.

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Handel und Angebot von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen.

Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Munition für Kleinwaffen herstellen, die für den Einzelhandelsverkauf an Zivilisten bestimmt sind

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition für zivile Zwecke erzielen.

Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten

Ausschluss von Emittenten, die ein MSCI-ESG-Rating von CCC haben.

Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben

Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Mit dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen
Gewährleistung, dass über 90 % der Emittenten der Wertpapiere, in die der Fonds investiert ein ESG-Rating aufweisen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden

• Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

| Nachhaltigkeitsindikator | Messgröße | Performance | | |
|---|---|--------------------------|------------------------|------------------------|
| | | 2024 | 2023 | 2022 |
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # Anzahl der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |
| Sicherstellung, dass mindestens 80 % der Vermögenswerte des Fonds (solche, die nicht in staatlichen und öffentlichen Wertpapieren und Instrumenten angelegt sind) überdurchschnittliche Umweltpraktiken aufweisen, wie sie von MSCI oder einem anderen externen Anbieter von ESG-Research, den der Investmentmanager von Zeit zu Zeit nutzt, ermittelt wurden | % der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel), die eine überdurchschnittliche Umweltbewertung gemäß den MSCI-Ratingkriterien aufweisen | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % |
| Der Fonds soll weiterhin 20% weniger Treibhausgasemissionen (gemessen anhand von Daten von MSCI) haben als sein Anlageuniversum der Liquiditätsfonds. | Reduzierung der CO2-Emissionsintensität des Portfolios um % im Vergleich zum Universum, in das investiert wird | 92,75 % | 93,21 % | k.A. ¹ |
| Gewährleistung, dass über 90 % der Emittenten der Wertpapiere, in die der Fonds investiert (unter Ausschluss von Geldmarktfonds) ein ESG-Rating aufweisen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden | % der Emittenten mit ESG-Rating | Über 90 % der Emittenten | k.A. ² | k.A. ² |

¹Der Indikator wurde im Dezember 2022 in die Anlagestrategie aufgenommen, weshalb er in den vorherigen Bezugszeiträumen nicht berichtet wurde.

²Der Indikator wurde im November 2023 in die Anlagestrategie aufgenommen, weshalb er in den vorherigen Bezugszeiträumen nicht berichtet wurde.

• ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die obige Tabelle gibt Aufschluss über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren in den vorangegangenen Bezugszeiträumen (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

• Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

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

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

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte beachten Sie den folgenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem beschrieben wird, wie der Fonds die PAI auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

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

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

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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen („E&S-Kriterien“), die oben dargelegt sind (siehe „Inwiefern wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“). Der Investmentmanager hat festgestellt, dass diese PAIs als Teil der Anlageauswahlkriterien berücksichtigt wurden. Der spezifische Nachhaltigkeitsindikator des Fonds stimmt unter Umständen nicht in vollem Umfang mit der regulatorischen Definition des entsprechenden PAI überein, der in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards (Regulatory Technical Standards, „RTS“) aufgeführt ist.

| Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen | Nachhaltigkeitsindikatoren |
|--|--|
| Treibhausgasemissionen (THG) (Scope 1/2) | Reduzierung der CO ₂ -Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds |
| THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | Reduzierung der CO ₂ -Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung auf der Grundlage von Kernenergie oder dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen |
| Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

| Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen | Nachhaltigkeitsindikatoren |
|--|---|
| Emissionen in Wasser | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt |
| Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen |



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2023 bis zum 30. September 2024.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|-------------------------------------|-------------------------|--------------------|
| Tri-Party Bofa Securities Inc. 2024-01-02 | Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | 2,79 % | Vereinigte Staaten |
| Tri-Party Citigroup Global Markets 2024-04-01 | Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | 2,59 % | Vereinigte Staaten |
| Tri-Party J.P. Morgan Securities L 2024-04-01 | Banken | 2,11 % | Vereinigte Staaten |
| Tri-Party Citigroup Global Markets 2024-01-02 | Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | 1,84 % | Vereinigte Staaten |
| Tri-Party Bofa Securities Inc. 2024-04-01 | Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | 1,36 % | Vereinigte Staaten |
| Tri-Party Citigroup Global Markets 2024-10-01 | Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | 1,36 % | Vereinigte Staaten |
| Royal Bank of Canada (Toronto Bran 2024-07-01) | Banken | 1,33 % | Kanada |
| Tri-Party Citigroup Global Markets 2024-07-01 | Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | 1,27 % | Vereinigte Staaten |
| Tri-Party Bofa Securities Inc. 2024-10-01 | Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | 1,24 % | Vereinigte Staaten |
| Tri-Party BNP Paribas 2024-01-02 | Banken | 1,02 % | Vereinigte Staaten |
| Tri-Party J.P. Morgan Securities L 2024-10-01 | Banken | 1,02 % | Vereinigte Staaten |
| Tri-Party Bofa Securities Inc. 2024-07-01 | Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | 1,00 % | Vereinigte Staaten |
| Royal Bank of Canada (Toronto Bran 2024-04-01) | Banken | 0,90 % | Kanada |
| Svenska Handelsbanken Ab (New York 2024-04-01) | Banken | 0,90 % | Vereinigte Staaten |
| Canadian Imperial Bank of Commerce 2024-04-01 | Banken | 0,78 % | Kanada |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

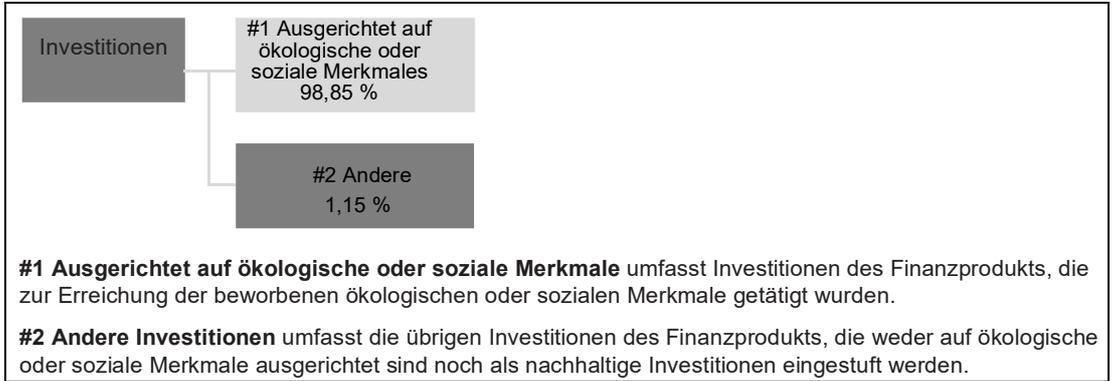
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensallokation des Fonds für den laufenden und vorangegangene Bezugszeiträume.

| Vermögensallokation | % der Investitionen | | |
|---|---------------------|---------|---------|
| | 2024 | 2023 | 2022 |
| #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale | 98,85 % | 96,84 % | 96,89 % |
| #2 Andere | 1,15 % | 3,16 % | 3,11 % |

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren mit einem Anteil von Mehr als 1 %, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------|
| Banken | Banken | 61,68 % |
| Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | 13,82 % |
| Staatsnahe Titel | Agency-Anleihen | 9,24 % |
| Staatsnahe Titel | Kommunalanleihen | 4,18 % |
| Finanzunternehmen | Finanzunternehmen | 3,41 % |
| Sonstige Finanzwerte | Sonstige Finanzwerte | 3,36 % |
| Staatsnahe Titel | Staatsanleihen | 2,90 % |
| US-Schatzwechsel | US-Schatzwechsel | 1,43 % |
| Staatsnahe Titel | Supranational | 1,06 % |

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilsektoren (wie im Branchenklassifikationssystem von Barclays definiert): Integriert, Unabhängig, Midstream, Ölfelddienstleistungen, Raffination oder Metall- und Bergbauunternehmen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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

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

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



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

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.

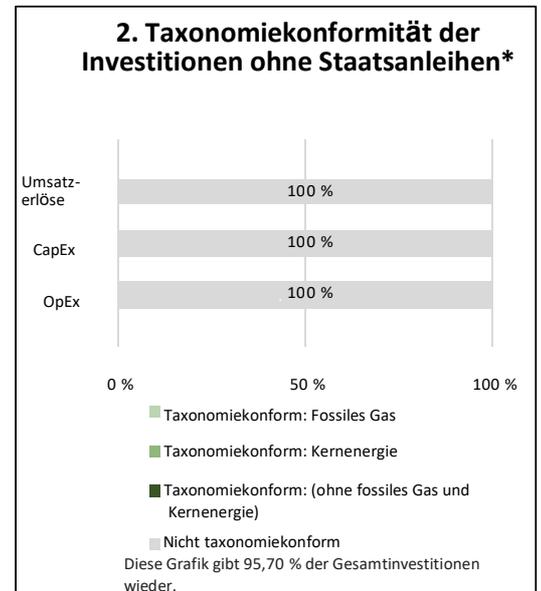
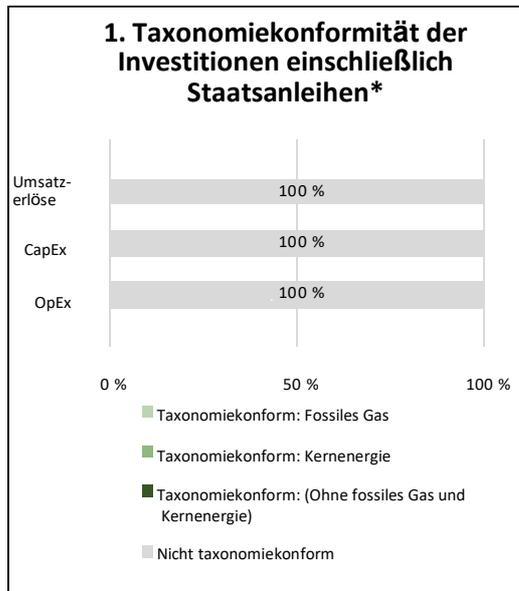
- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

Ja

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



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

Für den Bezugszeitraum wurden 4,30 % der Investitionen des Fonds in Staatsanleihen gehalten. Aufgrund der begrenzten Verfügbarkeit von Daten konnte die Taxonomiekonformität dieser Engagements nicht ermittelt werden.

| Taxonomiekonformität (einschließlich Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|---------|----------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00 % | 0,01 % | 0,00 % |
| Nicht taxonomiekonform | 100,00 % | 99,99 % | 100,00 % |

| Taxonomiekonformität (ohne Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|---------|----------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00 % | 0,01 % | 0,00 % |
| Nicht taxonomiekonform | 100,00 % | 99,99 % | 100,00 % |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Die vom Fonds während des Bezugszeitraums gehaltenen Investitionen trugen zu den folgenden ökologischen Zielen der EU-Taxonomie bei:

| Ökologische Ziele | % der Investitionen |
|------------------------------|---------------------|
| Klimaschutz | 0,00 % |
| Anpassung an den Klimawandel | 0,00 % |

Die in der obigen Tabelle dargestellten Daten sind ungeprüft und wurden weder vom Abschlussprüfer des Fonds noch von einer dritten Partei geprüft. Die Bewertung der Konformität mit der EU-Taxonomie basiert auf den Daten eines externen Anbieters. Die Quelle dieser Daten ist eine Kombination aus gleichwertigen und gemeldeten Daten. Gleichwertige Daten, die den technischen Kriterien der EU-Taxonomie entsprechen, führen zu einem Ergebnis in Bezug auf die Eignung oder die Taxonomiekonformität der Unternehmen, für die uns keine gemeldeten Daten vorliegen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum beliefen sich die Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten wie folgt:

| | % der Investitionen |
|---------------------------|---------------------|
| Übergangstätigkeiten | 0,00 % |
| Ermöglichende Tätigkeiten | 0,00 % |

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

Für vorherige Bezugszeiträume waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.



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



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Investitionen umfassten Zahlungsmitteläquivalente. Diese Bestände machen allerdings nicht mehr als 20 % aus. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Investmentmanager hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Investmentmanager überprüft regelmäßig die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Investmentmanager davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Investmentmanager mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Investmentmanager kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

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

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



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

Name des Produkts:
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493003UB3VZ7MRZU371

Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? | |
|--|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: __% | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von _ % an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: __% | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt |
| | <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die mit dem Fonds während des Bezugszeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den nachfolgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“. Er gibt Auskunft darüber, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

- Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologischchemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen
- Ausschluss von Emittenten, die Einkünfte aus der direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Komponenten von Atomwaffen oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Zusatzleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Handel und Angebot von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Munition für Kleinwaffen herstellen, die für den Einzelhandelsverkauf an Zivilisten bestimmt sind
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition für zivile Zwecke erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten
- Ausschluss von Emittenten, die ein MSCI-ESG-Rating von CCC haben.
- Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben
- Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.
- Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

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

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

| Nachhaltigkeitsindikator | Messgröße | Performance | | |
|--|-------------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| | | 2024 | 2023 | 2022 |
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # Anzahl der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |

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

Die obige Tabelle gibt Aufschluss über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren in den vorangegangenen Bezugszeiträumen (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte beachten Sie den folgenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem beschrieben wird, wie der Fonds die PAI auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

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

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

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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen („E&S-Kriterien“), die oben dargelegt sind (siehe „Inwiefern wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“). Der Investmentmanager hat festgestellt, dass diese PAIs als Teil der Anlageauswahlkriterien berücksichtigt wurden. Der spezifische Nachhaltigkeitsindikator des Fonds stimmt unter Umständen nicht in vollem Umfang mit der regulatorischen Definition des entsprechenden PAI überein, der in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards (Regulatory Technical Standards, „RTS“) aufgeführt ist.



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

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

| Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen | Nachhaltigkeitsindikatoren |
|--|---|
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten |
| Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Emissionen in Wasser | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten |
| Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen |



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|----------------------|-------------------------|--------------------|
| Tri-Party Wells Fargo Securities L 2024-07-01 | Sonstige Finanzwerte | 0,96 % | Vereinigte Staaten |
| Royal Bank of Canada (Toronto Bran 2024-07-01 | Banken | 0,90 % | Kanada |
| Tri-Party Wells Fargo Securities L 2024-04-01 | Sonstige Finanzwerte | 0,82 % | Vereinigte Staaten |
| Skandinaviska Enskilda Banken Ab (2024-10-01 | Banken | 0,79 % | Vereinigte Staaten |
| Skandinaviska Enskilda Banken Ab (2024-04-01 | Banken | 0,79 % | Vereinigte Staaten |
| Royal Bank of Canada (Toronto Bran 2024-01-02 | Banken | 0,69 % | Kanada |
| First Abu Dhabi Bank USA NV 2024-10-01 | Sonstige Finanzwerte | 0,69 % | Curaçao |
| Tri-Party J.P. Morgan Securities L 2024-04-01 | Banken | 0,62 % | Vereinigte Staaten |
| KBC Bank NV (New York Branch) 2024-04-01 | Banken | 0,59 % | Vereinigte Staaten |
| Niederlandse Waterschapsbank NV 144A 2024-10-11 | Staatsnahe Titel | 0,57 % | Niederlande |
| Tri-Party Wells Fargo Securities L 2024-10-01 | Sonstige Finanzwerte | 0,52 % | Vereinigte Staaten |
| Netherlands (Kingdom Of) 2024-01-22 | Staatsnahe Titel | 0,48 % | Niederlande |
| Royal Bank of Canada (Toronto Branch 2024-10-01) | Banken | 0,48 % | Kanada |
| Tri-Party BNP Paribas 2024-01-02 | Banken | 0,48 % | Vereinigte Staaten |
| Royal Bank of Canada (Toronto Bran 2024-04-01 | Banken | 0,45 % | Kanada |

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2023 bis zum 30. September 2024.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

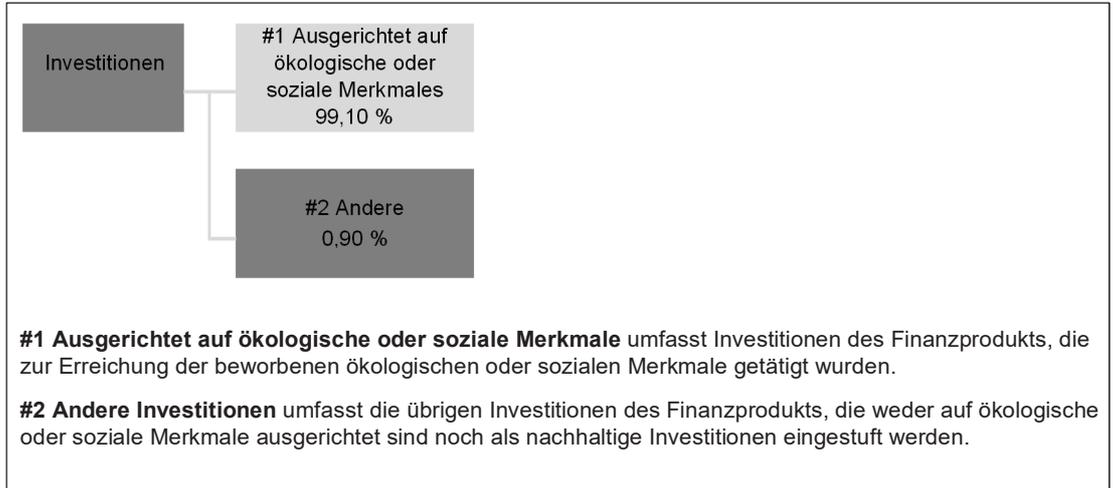
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensallokation des Fonds für den laufenden und vorangegangene Bezugszeiträume.

| Vermögensallokation | % der Investitionen | | |
|---|---------------------|---------|---------|
| | 2024 | 2023 | 2022 |
| #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale | 99,10 % | 96,96 % | 97,00 % |
| #2 Andere | 0,90 % | 3,04 % | 3,00 % |

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren mit einem Anteil von Mehr als 1 %, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------|
| Banken | Banken | 64,03 % |
| Staatsnahe Titel | Agency-Anleihen | 10,69 % |
| Sonstige Finanzwerte | Sonstige Finanzwerte | 6,63 % |
| Staatsnahe Titel | Kommunalanleihen | 4,45 % |
| Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | 3,84 % |
| Finanzunternehmen | Finanzunternehmen | 3,57 % |
| Staatsnahe Titel | Staatsanleihen | 2,79 % |
| US-Schatzwechsel | US-Schatzwechsel | 2,27 % |
| Staatsnahe Titel | Supranational | 1,04 % |

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilsektoren (wie im Branchenklassifikationssystem von Barclays definiert): Integriert, Unabhängig, Midstream, Ölfelddienstleistungen, Raffination oder Metall- und Bergbauunternehmen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



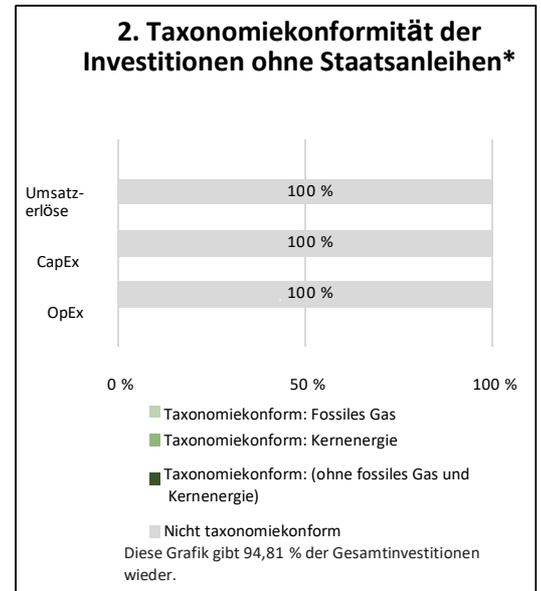
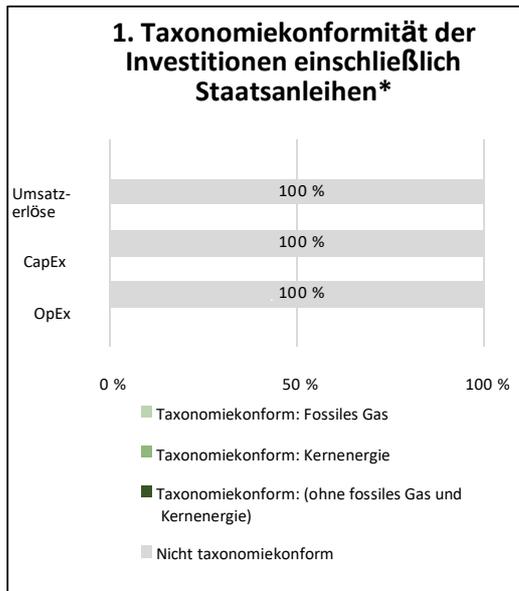
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

- Ja**
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein**

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



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

Für den Bezugszeitraum wurden 5,19 % der Investitionen des Fonds in Staatsanleihen gehalten. Aufgrund der begrenzten Verfügbarkeit von Daten konnte die Taxonomiekonformität dieser Engagements nicht ermittelt werden.

| Taxonomiekonformität (einschließlich Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|----------|----------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Nicht taxonomiekonform | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % |

| Taxonomiekonformität (ohne Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|----------|----------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Nicht taxonomiekonform | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

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

Die vom Fonds während des Bezugszeitraums gehaltenen Investitionen trugen zu den folgenden ökologischen Zielen der EU-Taxonomie bei:

| Ökologische Ziele | % der Investitionen |
|------------------------------|---------------------|
| Klimaschutz | 0,00 % |
| Anpassung an den Klimawandel | 0,00 % |

Die in der obigen Tabelle dargestellten Daten sind ungeprüft und wurden weder vom Abschlussprüfer des Fonds noch von einer dritten Partei geprüft. Die Bewertung der Konformität mit der EU-Taxonomie basiert auf den Daten eines externen Anbieters. Die Quelle dieser Daten ist eine Kombination aus gleichwertigen und gemeldeten Daten. Gleichwertige Daten, die den technischen Kriterien der EU-Taxonomie entsprechen, führen zu einem Ergebnis in Bezug auf die Eignung oder die Taxonomiekonformität der Unternehmen, für die uns keine gemeldeten Daten vorliegen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum beliefen sich die Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten wie folgt:

| | % der Investitionen |
|---------------------------|---------------------|
| Übergangstätigkeiten | 0,00 % |
| Ermöglichende Tätigkeiten | 0,00 % |

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

Für vorherige Bezugszeiträume waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.



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



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Investitionen umfassten Zahlungsmitteläquivalente. Diese Bestände machen allerdings nicht mehr als 20 % aus. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Investmentmanager hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Investmentmanager überprüft regelmäßig die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Investmentmanager davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Investmentmanager mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Investmentmanager kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

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

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



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

Name des Produkts:

BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300S5H1NIVFSPNC81

Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? | |
|--|---|
| <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> Ja | <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____% | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von _ % an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____% | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt |
| | <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die mit dem Fonds während des Bezugszeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den nachfolgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“. Er gibt Auskunft darüber, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

- Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologischchemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen
- Ausschluss von Emittenten, die Einkünfte aus der direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Komponenten von Atomwaffen oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Zusatzleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Handel und Angebot von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Munition für Kleinwaffen herstellen, die für den Einzelhandelsverkauf an Zivilisten bestimmt sind
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition für zivile Zwecke erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten
- Ausschluss von Emittenten, die ein MSCI-ESG-Rating von CCC haben.
- Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben
- Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.
- Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

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

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

| Nachhaltigkeitsindikator | Messgröße | Performance | | |
|--|-------------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| | | 2024 | 2023 | 2022 |
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # Anzahl der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |

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

Die obige Tabelle gibt Aufschluss über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren in den vorangegangenen Bezugszeiträumen (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte beachten Sie den folgenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem beschrieben wird, wie der Fonds die PAI auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

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

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

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

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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Bewerbung von ökologischen und sozialen Merkmalen („E&S-Kriterien“), die oben dargelegt sind (siehe „Inwiefern wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“). Der Investmentmanager hat festgestellt, dass diese PAIs als Teil der Anlageauswahlkriterien berücksichtigt wurden. Der spezifische Nachhaltigkeitsindikator des Fonds stimmt unter Umständen nicht in vollem Umfang mit der regulatorischen Definition des entsprechenden PAI überein, der in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards (Regulatory Technical Standards, „RTS“) aufgeführt ist.



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

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

| Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen | Nachhaltigkeitsindikatoren |
|--|---|
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten |
| Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Emissionen in Wasser | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben |
| Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten |
| Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht entdeckbare Splitter und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen |



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2023 bis zum 30. September 2024.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|-----------------------|-------------------------|------------------------|
| BLK Ics USD Liq Agency Dis | Geldmarktpapiere | 4,47 % | Irland |
| Royal Bank of Canada (Toronto Bran 2024-10-01) | Banken | 0,85 % | Kanada |
| JPMmorgan Chase & Co 2026-04-22 | Banken | 0,80 % | Vereinigte Staaten |
| Societe Generale SA 144A 2024-10-02 | Banken | 0,62 % | Frankreich |
| Credit Agricole SA (London Branch) 2025-01-06 | Banken | 0,62 % | Vereinigtes Königreich |
| HSBC Bank USA NA 2024-11-25 | Banken | 0,60 % | Vereinigte Staaten |
| Mercedes-Benz Finance NA (Frn) 144A 2025-08-01 | Zyklische Konsumgüter | 0,59 % | Vereinigte Staaten |
| Morgan Stanley MTN 2024-10-23 | Banken | 0,59 % | Vereinigte Staaten |
| Barclays Bank Plc 2024-10-10 | Banken | 0,59 % | Vereinigtes Königreich |
| Ing Bank NV (Amsterdam Branch) Regs 2024-11-26 | Banken | 0,57 % | Niederlande |
| National Bank of Canada 2024-11-06 | Banken | 0,57 % | Kanada |
| Macquarie Bank Ltd 144A 2024-11-27 | Banken | 0,56 % | Australien |
| Banque Federative du Credit Mutuel Regs 2025-02-05 | Banken | 0,56 % | Frankreich |
| Commonwealth Bank of Australia 2024-07-26 | Banken | 0,54 % | Australien |
| Australia & New Zealand Banking Gr 2024-07-01 | Banken | 0,53 % | Australien |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

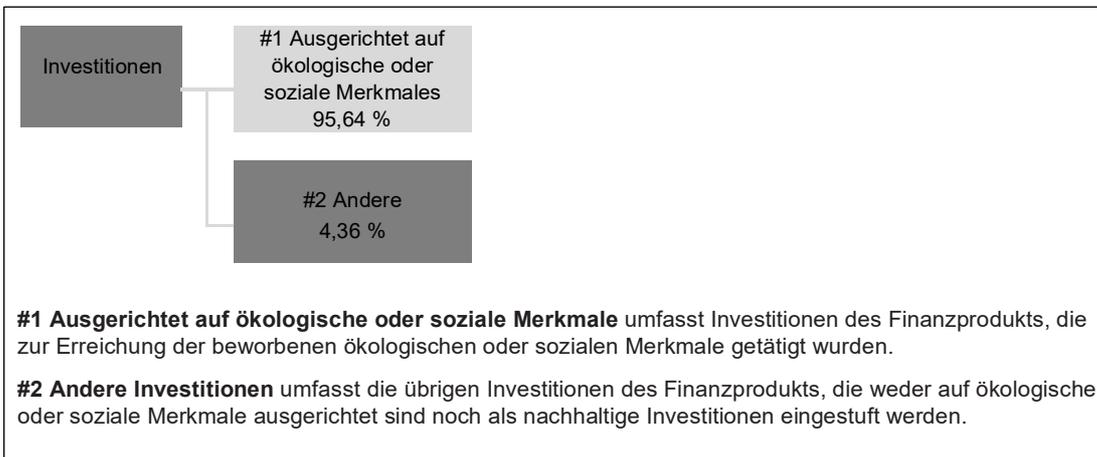
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensallokation des Fonds für den laufenden und vorangegangene Bezugszeiträume.

| Vermögensallokation | % der Investitionen | | |
|---|---------------------|---------|---------|
| | 2024 | 2023 | 2022 |
| #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale | 95,64 % | 95,54 % | 99,40 % |
| #2 Andere | 4,36 % | 4,46 % | 0,60 % |

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren mit einem Anteil von Mehr als 1 %, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilssektor | % der Investitionen |
|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------|
| Banken | Banken | 51,44 % |
| Zyklische Konsumgüter | Auto | 5,28 % |
| Geldmarktpapiere | STIF Funds | 4,47 % |
| Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen | 4,10 % |
| Finanzunternehmen | Finanzunternehmen | 4,01 % |
| Technologie | Technologie | 3,98 % |
| Staatsnahe Titel | Agency-Anleihen | 3,93 % |
| Sonstige Finanzwerte | Sonstige Finanzwerte | 3,83 % |
| Staatsnahe Titel | Kommunalanleihen | 2,66 % |
| Transport | Verkehrsdienstleistungen | 1,53 % |
| Strom | Strom | 1,48 % |
| Zyklische Konsumgüter | Einzelhändler | 1,22 % |
| Basiskonsumgüter | Nahrungsmittel und Getränke | 1,20 % |
| Investitionsgüter | Baustoffe | 1,15 % |
| Energie | Midstream | 1,10 % |
| Sonstige Industrewerte | Sonstige Industrewerte | 1,04 % |

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilssektoren (wie im Branchenklassifikationssystem von Barclays definiert): Integriert, Unabhängig, Midstream, Ölfelddienstleistungen, Raffination oder Metall- und Bergbauunternehmen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



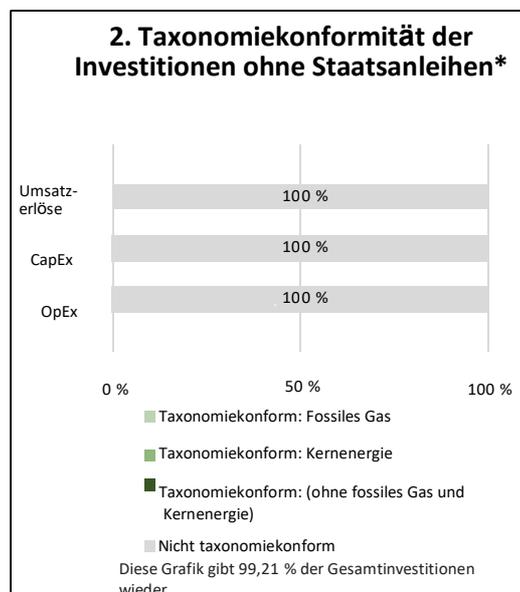
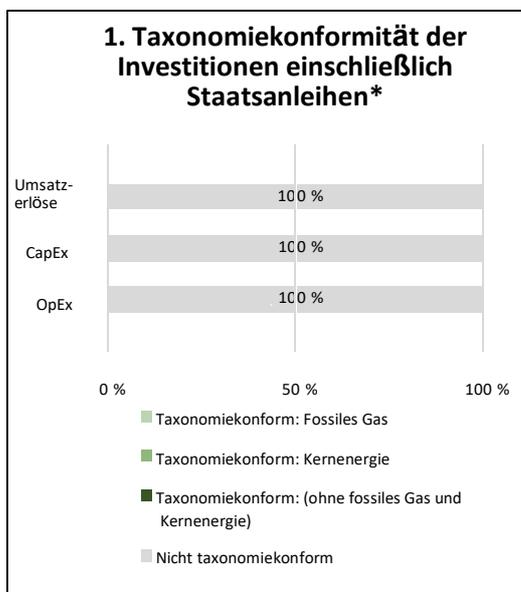
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

- Ja**
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein**

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



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

Für den Bezugszeitraum wurden 0,79 % der Investitionen des Fonds in Staatsanleihen gehalten. Aufgrund der begrenzten Verfügbarkeit von Daten konnte die Taxonomiekonformität dieser Engagements nicht ermittelt werden.

| Taxonomiekonformität (einschließlich Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|---------|---------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,11 % | 0,20 % | 0,27 % |
| Nicht taxonomiekonform | 99,89 % | 99,80 % | 99,73 % |

| Taxonomiekonformität (ohne Staatsanleihen) | Umsatzerlöse | CapEx | OpEx |
|---|--------------|---------|---------|
| Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 % |
| Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,11 % | 0,20 % | 0,28 % |
| Nicht taxonomiekonform | 99,89 % | 99,80 % | 99,72 % |

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

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

Die vom Fonds während des Bezugszeitraums gehaltenen Investitionen trugen zu den folgenden ökologischen Zielen der EU-Taxonomie bei:

| Ökologische Ziele | % der Investitionen |
|------------------------------|---------------------|
| Klimaschutz | 0,11 % |
| Anpassung an den Klimawandel | 0,00 % |

Die in der obigen Tabelle dargestellten Daten sind ungeprüft und wurden weder vom Abschlussprüfer des Fonds noch von einer dritten Partei geprüft. Die Bewertung der Konformität mit der EU-Taxonomie basiert auf den Daten eines externen Anbieters. Die Quelle dieser Daten ist eine Kombination aus gleichwertigen und gemeldeten Daten. Gleichwertige Daten, die den technischen Kriterien der EU-Taxonomie entsprechen, führen zu einem Ergebnis in Bezug auf die Eignung oder die Taxonomiekonformität der Unternehmen, für die uns keine gemeldeten Daten vorliegen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum beliefen sich die Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten wie folgt:

| | % der Investitionen |
|---------------------------|---------------------|
| Übergangstätigkeiten | 0,00 % |
| Ermöglichende Tätigkeiten | 0,10 % |

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

Für vorherige Bezugszeiträume waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.



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



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Investitionen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Investitionen umfassten Zahlungsmitteläquivalente. Diese Bestände machen allerdings nicht mehr als 20 % aus. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Investmentmanager hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Investmentmanager überprüft regelmäßig die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Investmentmanager davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Investmentmanager mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Investmentmanager kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Sie wünschen weitere Auskünfte?

[blackrockinternational.com](https://www.blackrockinternational.com) | +44 (0)20 7743 3300

© 2024 BlackRock, Inc. Alle Rechte vorbehalten. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS und iSHARES sind Marken von BlackRock, Inc. oder ihren Tochtergesellschaften in den Vereinigten Staaten und andernorts. Sämtliche sonstigen Markenzeichen sind diejenigen ihrer jeweiligen Eigentümer.

BlackRock[®]

Go paperless. . .
It's Easy, Economical and Green!
Go to www.blackrock.com/edelivery

