

BlackRock[®]

Relazione semestrale e bilancio non certificato

BlackRock UCITS Funds

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

BLACKROCK UCITS FUNDS

INDICE	Pagina
Panoramica	
Informazioni di carattere generale	1
Informazioni sulla Società	3
Performance	
Relazione del Gestore degli investimenti	4
Bilancio	
Conto economico sintetico	16
Prospetto sintetico delle variazioni del patrimonio netto	20
Prospetto sintetico delle variazioni del patrimonio netto attribuibili ai sottoscrittori di quote di partecipazione rimborsabili	21
Stato patrimoniale sintetico	24
Note al Bilancio	28
Prospetti degli investimenti	46
Ulteriori informazioni e informativa ai sensi della legge	
Prospetti degli acquisti e delle vendite principali	170
Informazioni per gli investitori in Svizzera	187
Transazioni con persone connesse	188
Accordi di soft commission	188
Gestione efficiente del portafoglio e operazioni di finanziamento tramite titoli	189
Declinazione di responsabilità	198

La presente relazione semestrale e il bilancio non certificato ("Relazione e Bilancio") possono essere tradotti in altre lingue. Tale eventuale traduzione conterrà esclusivamente le medesime informazioni e avrà il medesimo significato di cui nella Relazione e nel Bilancio in lingua inglese. Ove si presentino discrepanze fra Relazione e Bilancio in lingua inglese e la traduzione in un'altra lingua, prevarrà la versione in lingua inglese, eccetto nel caso in cui (e solo nella misura in cui) le leggi di una giurisdizione in cui le quote sono vendute prevedano che, in un'azione giudiziale avente ad oggetto una Relazione e un Bilancio in lingua non inglese, prevalga la lingua di Relazione e Bilancio su cui si basa tale azione. Tutte le controversie inerenti ai termini di Relazione e Bilancio, indipendentemente dalla lingua ivi utilizzata, saranno disciplinate e interpretate ai sensi del diritto irlandese.

BLACKROCK UCITS FUNDS

INFORMAZIONI DI CARATTERE GENERALE

Amministratori della Società

Rosemary Quinlan (Presidente) (irlandese)¹
Graham Bamping (britannico)¹
Patrick Boylan (irlandese)^{2/3}
Maria Ging (irlandese)^{2/3}
Michael Hodson (irlandese)¹
Enda McMahon (irlandese)^{2/3}
Justin Mealy (irlandese)^{2/3}
Adele Spillane (irlandese)¹
Catherine Woods (irlandese)

¹Amministratore non esecutivo

²Amministratore esecutivo

³Dipendenti del Gruppo BlackRock

Gestore

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

Gestore della copertura valutaria⁴

JPMorgan Chase Bank N.A.
25 Bank Street Canary Wharf
London, E14 5JP
Regno Unito

Agente Amministrativo, Conservatore del registro e Agente per i trasferimenti

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

Fiduciario

J.P. Morgan SE - Filiale di Dublino
200 Capital Dock
79 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2, D02 RK57
Irlanda

Segretario del Gestore

Apex Group Corporate Administration Services Ireland Limited
Fourth Floor
76 Baggot Street Lower
Dublin 2, D02 EK81
Irlanda

Promotore, Gestore degli Investimenti, Distributore e Agente per il prestito titoli

BlackRock Advisors (UK) Limited
12 Throgmorton Avenue
London, EC2N 2DL
Regno Unito

Subgestori degli investimenti⁵

BlackRock Financial Management, Inc.
55 East 52nd Street
New York
NY 10055
Stati Uniti d'America

BlackRock Institutional Trust Company, N.A.
400 Howard Street
San Francisco
California 94105
Stati Uniti d'America

BlackRock Investment Management (UK) Limited
12 Throgmorton Avenue
London, EC2N 2DL
Regno Unito

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

Società di Revisione indipendente

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

Consulente legale per il diritto irlandese:

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

Agente incaricato dei pagamenti in Italia

Allfunds Bank, S.A.
con sede legale in Estafeta, 6 (La Moraleja)
Complejo Plaza de la Fuente, Ed. 3
28109 Alcobendas, Madrid (Spagna)
e sede secondaria in Via Bocchetto, 6
20123 Milano
Italia

Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.
Sede legale
Piazza Salimbeni 3
53100 Siena
Italia

Iccrea Banca S.p.A.
Via Lucrezia Romana, 41/47
00178 Roma
Italia

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

Agente incaricato dei pagamenti in Svezia

BlackRock (Netherlands) B.V., Filiale di Stoccolma
Malmskillnadsgatan 32
111 51 Stockholm
Svezia

BLACKROCK UCITS FUNDS

INFORMAZIONI DI CARATTERE GENERALE (continua)

Agente incaricato dei pagamenti in Svizzera

State Street Bank International GmbH
Munich, filiale di Zurigo
Beethovenstrasse 19
CH-8027 Zürich
Svizzera

Rappresentante in Danimarca

BlackRock (Netherlands) B.V., Filiale di Copenhagen
Harbour House, Sundkrogsgade 21 Copenhagen
DK- 2100
Danimarca

Rappresentante in Svizzera

BlackRock Asset Management Schweiz AG
Bahnhofstrasse 39
8001 Zürich
Svizzera

⁴Limitatamente alle classi di quote con copertura valutaria di alcuni Fondi.

⁵Limitatamente ad alcuni Fondi.

Per gli investitori svizzeri: Il prospetto dell'Entità, l'Atto costitutivo, i Documenti contenenti le informazioni chiave per gli investitori ("KIID"), i Documenti contenenti le informazioni chiave per i prodotti d'investimento al dettaglio e assicurativi preassemblati (KID dei PRIIP), il bilancio certificato e la relazione annuale più recenti e il bilancio non certificato e la relazione semestrale più recenti, a seconda dei casi, nonché l'elenco dettagliato degli investimenti acquistati e venduti per ogni Fondo nel corso del periodo finanziario possono essere ottenuti gratuitamente su richiesta dal rappresentante in Svizzera.

Si noti che, ai sensi dell'articolo 310 del codice tedesco sugli investimenti (Kapitalanlagegesetzbuch), non è stata inviata alcuna notifica per la distribuzione delle quote dei Fondi seguenti: BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund, BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1, BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1, BlackRock UK Credit Screened Fund, BlackRock Global Equity Selection Fund, BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund, BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund e FR Multi Asset Fund. Pertanto, le quote di tali Fondi non possono essere distribuite nella Repubblica federale tedesca.

L'Entità è regolarmente registrata presso la Comisión Nacional de Mercado de Valores in Spagna con il numero 1646.

BLACKROCK UCITS FUNDS

INFORMAZIONI SULLA SOCIETÀ

BlackRock UCITS Funds (l'“Entità”) è un unit trust (fondo comune d'investimento) di tipo aperto, costituito il 29 giugno 2007 come fondo multicomparto di diritto irlandese. L'Entità è stata istituita con un Atto costitutivo datato 28 giugno 2007 tra BlackRock Asset Management Ireland Limited (il “Gestore”) e J.P. Morgan SE - Filiale di Dublino (il “Fiduciario”) ed è disciplinata da un Atto costitutivo modificato e riformulato datato 4 dicembre 2009 ed eventuali atti integrativi. L'Entità è autorizzata come unit trust (fondo comune d'investimento) con separazione patrimoniale fra i comparti ai sensi dello Unit Trusts Act del 1990 (la “Legge”). L'Entità è autorizzata e disciplinata dalla Banca Centrale d'Irlanda (“CBI”) ai sensi delle disposizioni dei Regolamenti delle Comunità Europee (Organismi di Investimento Collettivo in Valori Mobiliari) del 2011 (e successive modifiche) (i “Regolamenti OICVM”).

L'Entità è costituita come un fondo multicomparto e comprende fondi separati (“Fondi”) dell'Entità. Le quote di ciascun Fondo possono essere raggruppate in diverse classi di quote (ciascuna una “classe di quote”). Ciascun Fondo rappresenterà un portafoglio separato di attività e può essere composto da una o più classi di quote. Ogni classe di quote può applicare differenti spese di sottoscrizione e rimborso, oneri, commissioni di sottoscrizione o accordi di intermediazione. La creazione di una classe aggiuntiva di quote sarà preventivamente comunicata alla CBI. Il portafoglio di attività gestite da ciascun Fondo sarà investito nel rispetto degli obiettivi e delle politiche di investimento applicabili a ciascun Fondo come stabilito nel Prospetto informativo. Le attività di ciascun Fondo saranno di pertinenza esclusiva del Fondo in oggetto e saranno tenute separate dalle attività di altri Fondi, non saranno utilizzate per liquidare, direttamente o indirettamente, le passività o i crediti vantati nei confronti di altri Fondi e non saranno destinate ad alcuna di dette finalità.

Quando un'attività o una passività dell'Entità non può ritenersi attribuibile a uno o più Fondi specifici, il Gestore potrà discrezionalmente determinare la base sulla quale tale attività o passività sarà ripartita fra i Fondi e avrà facoltà, in qualsiasi momento e di volta in volta, di variare tale base, compresa la ripartizione di tale attività o passività fra tutti i Fondi o alcuni dei Fondi proporzionalmente al loro Valore Patrimoniale Netto (“NAV”) o altra base stabilita dal Gestore.

Il termine “Fondo” o “Prodotto finanziario” si riferisce a uno o più Fondi dell'Entità ovvero, qualora il contesto lo richieda, al Gestore o al suo delegato agente per conto del Fondo pertinente. I termini “BlackRock” e “Gestore degli Investimenti” sono utilizzati per indicare BlackRock Advisors (UK) Limited ove appropriato. Tutti i riferimenti alle “quote rimborsabili” si riferiscono a quote di partecipazione rimborsabili quando le quote del Fondo sono considerate passività finanziarie. Il termine “Amministratori” indica gli amministratori del Gestore.

Ulteriori dettagli, inclusi gli obiettivi di investimento e i requisiti minimi di sottoscrizione, sono riportati nel prospetto dell'Entità.

Informazioni sul fondo

Al 30 settembre 2023 l'Entità deteneva 13 Fondi operativi.

Variazioni all'Entità durante il periodo finanziario

Il 4 maggio 2023, Adele Spillane ha cambiato il suo ruolo da Amministratore esecutivo ad Amministratore non esecutivo del Gestore.

Il 9 maggio 2023, BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ha iniziato le attività con il lancio delle seguenti classi di quote: Classe C CHF coperta ad accumulazione, Classe C CHF coperta a distribuzione, Classe C EUR ad accumulazione, Classe C EUR a distribuzione, Classe C GBP coperta ad accumulazione, Classe C GBP coperta a distribuzione, Classe C USD coperta ad accumulazione, Classe C USD coperta a distribuzione, Classe D CHF coperta ad accumulazione, Classe D CHF coperta a distribuzione, Classe D EUR ad accumulazione, Classe D EUR a distribuzione, Classe D GBP coperta ad accumulazione, Classe D GBP coperta a distribuzione, Classe D USD coperta ad accumulazione, Classe D USD coperta a distribuzione, Classe E EUR ad accumulazione e Classe E EUR a distribuzione.

Il 12 giugno 2023 è stato pubblicato un prospetto aggiornato per l'Entità per agevolare le modifiche seguenti:

- Inclusione di BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026.
- Aggiornamenti delle informazioni relative agli Amministratori.
- Aggiornamenti delle informazioni relative al Segretario del Gestore.
- Inclusione di BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1 come conforme ai criteri dell'Articolo 8 del SFDR.

Il 27 giugno 2023 BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund è stato interamente rimborsato.

Il 12 luglio 2023 sono state completamente rimborsate le seguenti classi di quote di BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026: Classe C GBP coperta ad accumulazione, Classe C GBP coperta a distribuzione, Classe D CHF coperta ad accumulazione, Classe D CHF coperta a distribuzione, Classe D GBP coperta ad accumulazione, Classe D GBP coperta a distribuzione, Classe D USD coperta ad accumulazione e Classe D USD coperta a distribuzione.

Il 18 settembre 2023, Maria Gin è stato nominato Amministratore esecutivo del Gestore.

BLACKROCK UCITS FUNDS

RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI

Obiettivo d'investimento

BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund

L'obiettivo d'investimento del Fondo consiste nell'offrire un rendimento totale (sotto forma di crescita del capitale e reddito) che riflette il rendimento dell'Indice MSCI All Country World TR (EUR).

BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1

L'obiettivo d'investimento del Fondo consiste nel fornire un rendimento totale, tenendo conto dei rendimenti in termini sia di capitale sia di reddito, che rifletta il rendimento prodotto dall'Indice Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate.

BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1

L'obiettivo d'investimento del Fondo consiste nel fornire un rendimento totale, tenendo conto dei rendimenti in termini sia di capitale sia di reddito, che rifletta il rendimento prodotto dall'Indice Barclays Euro Aggregate Treasury Bond.

BlackRock UK Credit Screened Fund

L'obiettivo di investimento del Fondo consiste nel fornire agli investitori un'esposizione diversificata agli emittenti di credito aziendali, principalmente attraverso l'emissione di titoli a reddito fisso denominati in sterline.

BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund

L'obiettivo d'investimento del Fondo consiste nel fornire un reddito e al contempo nel salvaguardare il capitale, investendo prevalentemente in titoli a reddito fisso.

BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund

L'obiettivo di investimento del Fondo consiste nel cercare di fornire agli investitori un'esposizione diversificata principalmente ai titoli di Stato dei mercati sviluppati di tutto il mondo.

BlackRock Diversifying Fixed Income Fund

L'obiettivo d'investimento del Fondo consiste nel fornire agli investitori un reddito semestrale oltre che nel conservare il capitale a lungo termine, attraverso l'investimento in un portafoglio diversificato di organismi d'investimento collettivo e/o un portafoglio diversificato di titoli a reddito fisso.

BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund

BlackRock Global Equity Selection Fund

L'obiettivo di investimento di ciascun Fondo consiste nel fornire agli investitori una crescita del capitale a lungo termine.

BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund

L'obiettivo di investimento del Fondo consiste nel fornire agli investitori una crescita del capitale a lungo termine, cercando al contempo di mantenere un livello di rischio moderato.

BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund

L'obiettivo di investimento del Fondo consiste nel cercare di massimizzare il rendimento totale a lungo termine, cercando al contempo di mantenere un livello di rischio difensivo.

BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund

L'obiettivo di investimento del Fondo consisteva nel fornire agli investitori una crescita del capitale a lungo termine in modo compatibile con i principi degli investimenti incentrati sui fattori ambientali, sociali e di governance ("ESG").

FR Multi-Asset Fund

L'obiettivo di investimento del Fondo è cercare di fornire un rendimento totale (in forma di crescita del capitale e di reddito).

BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026

L'obiettivo di investimento del Fondo consiste nel generare reddito, puntando al contempo anche a preservare l'importo del capitale inizialmente investito e a investire in linea con i principi dell'investimento incentrato sui fattori ESG.

BLACKROCK UCITS FUNDS

RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Metodo di gestione degli investimenti

La tabella seguente riporta il metodo di gestione degli investimenti adottato per ciascun Fondo.

Nome del Fondo	Indice benchmark/Parametro della performance/Benchmark della performance	Metodo di gestione degli investimenti
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	MSCI All Country World NET TR Index (EUR)	Replica dell'Indice - non replicante
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Index	Replica dell'Indice - non replicante
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	Bloomberg Barclays Euro Aggregate Treasury Bond Index	Replica dell'Indice - non replicante
BlackRock UK Credit Screened Fund ¹	iBoxx Sterling Corporate ex Tier 1 e Upper Tier 2 with a 2% issuer cap	Attivo
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund ¹	Indice EURIBOR a 3 mesi	Attivo
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund ¹	Indice Bloomberg Barclays Global Treasury (personalizzato)	Attivo
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund ¹	Indice EURIBOR a 3 mesi	Attivo
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund ¹	Indice MSCI Emerging Markets (Net)	Attivo
BlackRock Global Equity Selection Fund ¹	50% MSCI Europe Index e 50% MSCI All Country World ex Europe Index	Attivo
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund ²	N.d.	Attivo
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund ²	N.d.	Attivo
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ^{1/3}	MSCI EM ex Fossil Fuels Index	Attivo
FR Multi-Asset Fund	25% Indice MSCI All Country World with Developed Markets 100% Hedged to EUR, 25% Indice MSCI All Country World e 50% Indice Bloomberg Global Aggregate	Attivo
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 20264	N.d.	Attivo

¹ Il parametro della performance/benchmark della performance incluso nella tabella precedente è riportato esclusivamente a scopo di riferimento. Per ulteriori dettagli si rimanda al prospetto.

² Per questo Fondo non sono calcolati i parametri della performance.

³ Il Fondo è stato chiuso il 27 giugno 2023.

⁴ Il Fondo è stato lanciato il 9 maggio 2023.

Maggiori informazioni sulle strategie d'investimento dell'indice utilizzate sono riportate in dettaglio di seguito:

Per fondi non replicanti, il metodo di gestione degli investimenti punta a rispecchiare le principali caratteristiche di rischio dell'indice di riferimento investendo in un portafoglio che sia composto principalmente da titoli che rappresentino l'indice di riferimento. L'obiettivo consiste nel generare un rendimento che sia il più possibile vicino al rendimento totale dell'indice di riferimento al netto dei costi di transazione e al lordo delle commissioni e di altri costi.

BLACKROCK UCITS FUNDS

RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Sintesi della performance, tracking difference e tracking error

La tabella seguente confronta la performance realizzata del Fondo rispetto alla performance dell'indice di riferimento/parametro della performance pertinente nel periodo finanziario chiuso al 30 settembre 2023. Specifica inoltre il tracking error previsto dei Fondi che replicano l'indice (comunicato nel prospetto su base ex ante) con il tracking error effettivamente realizzato del Fondo al 30 settembre 2023.

Ulteriori informazioni su questi parametri della performance e queste metodologie di calcolo della performance in uso sono dettagliate di seguito:

- I rendimenti del Fondo specificati sono i rendimenti della performance per la classe di quote primaria di ogni Fondo, al netto delle commissioni, che è stata selezionata come classe di quote rappresentativa. La classe di quote primarie rappresenta la classe di quote di investimento della maggior parte degli investitori del Fondo e tiene conto anche di altri fattori rilevanti come la valuta base del Fondo. I rendimenti indicati a fini comparativi sono espressi nella stessa valuta della classe di quote primarie, salvo diversa indicazione. Le performance di tutte le altre classi di azioni sono disponibili su richiesta.
- Per i Fondi che hanno iniziato le attività e/o sono stati interamente rimborsati durante il periodo finanziario, i rendimenti sono indicati dalla data di inizio delle attività del Fondo e/o alla data di rimborso integrale del Fondo, e il coefficiente di spesa totale ("TER") è il TER effettivo dalla data di inizio delle attività del Fondo e/o alla data di rimborso integrale del Fondo.
- I rendimenti del Fondo si basano sul NAV calcolato ai sensi del prospetto per il periodo finanziario in esame con reinvestimento degli eventuali dividendi. A causa dei requisiti del Financial Reporting Standard 104 (l'"FRS 104") per la rendicontazione finanziaria infrannuale, potrebbero sussistere talune differenze fra il NAV per quota risultante in bilancio e il NAV per quota calcolato in conformità con il prospetto.
- Il TER di ogni Fondo matura giornalmente nel corso del periodo finanziario e può influire positivamente o negativamente sulla misurazione di un tracking error in base alla performance del mercato e al coefficiente TER applicato. L'estensione e l'ampiezza di questo effetto sul parametro della performance dipendono dai tempi della performance del mercato rispetto al periodo della performance del Fondo e, rispetto al TER nominale, possono essere maggiori in un mercato positivo e minori in un mercato negativo. Il TER esprime la somma di tutte le commissioni e di tutti i costi e gli oneri operativi, con l'eccezione dei costi diretti di intermediazione e delle commissioni di performance, addebitati alle attività di ciascun Fondo come percentuale delle attività medie del Fondo in base a un periodo di dodici mesi terminato il 30 settembre 2023.
- Il tracking error previsto si basa sulla volatilità attesa delle differenze tra i rendimenti di un fondo e i rendimenti del suo indice di riferimento.
- Il tracking error realizzato è la deviazione standard annualizzata della differenza tra i rendimenti mensili di un fondo e del suo indice di riferimento. Il tracking error mostra la coerenza dei rendimenti rispetto all'indice di riferimento su un periodo di tempo definito. Il tracking error realizzato è annualizzato e calcolato utilizzando dati del precedente periodo di osservazione di 36 mesi. Laddove un Fondo non sia stato scambiato per 36 mesi, il tracking error annualizzato è stato presentato dal lancio.

Nome del Fondo	Rendimento del Fondo %	Indice di riferimento %	TER %	Tracking error previsto %	Realised tracking realizzato %
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund - Classe di quote istituzionali a distribuzione	5,52	5,25	0,22	Fino allo 0,60	1,74
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1 - EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	0,73	0,77	0,05	Fino allo 0,30	0,06
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 - EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	(2,56)	(2,46)	0,14	Fino allo 0,20	0,03

BLACKROCK UCITS FUNDS

RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Sintesi della performance, tracking difference e tracking error (continua)

Nome del Fondo	Rendimento del Fondo %	Parametro della performance %
BlackRock UK Credit Screened Fund - Classe di quote ad accumulazione flessibile	(0,88)	(0,89)
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund - Classe D ad accumulazione	1,79	1,58
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund - EUR - Classe di quote ad accumulazione flessibile	(2,90)	(2,50)
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund - Classe di quote istituzionali 1 a distribuzione	(0,36)	1,58
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund - Classe D ad accumulazione	(2,52)	(2,05)
BlackRock Global Equity Selection Fund - Classe D ad accumulazione	3,29	3,25
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund - Classe D ad accumulazione	(0,32)	n.d.
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund - Classe D ad accumulazione	(0,44)	n.d.
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹ - Classe di quote ad accumulazione flessibile	(2,46)	n.d.
FR Multi-Asset Fund - Istituzionali in EUR ad accumulazione	1,81	(1,86)
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ² - Classe D EUR ad accumulazione	1,41	n.d.

¹ Il Fondo è stato interamente rimborsato nel corso del periodo finanziario. I rendimenti vengono mostrati dall'inizio del periodo finanziario fino alla data del completo rimborso del Fondo.

² Il Fondo ha iniziato le attività nel corso del periodo finanziario. I rendimenti vengono mostrati dalla data di lancio fino alla fine del periodo finanziario.

Le performance passate non sono indicative dei rendimenti futuri e non dovrebbero costituire l'unico fattore da tenere presente nella selezione di un prodotto. Tutti gli investimenti finanziari comportano un elemento di rischio. Pertanto, il valore dell'investimento e il reddito generato varieranno e non può essere garantita la restituzione dell'importo dell'investimento iniziale. I dati sulle performance non tengono in considerazione le spese e le commissioni che possono essere imposte al momento della sottoscrizione o del rimborso di quote. I livelli e le basi imponibili possono variare di volta in volta. Le sottoscrizioni possono essere effettuate solo sulla base del prospetto attuale, di cui costituiscono parte integrante le versioni più recenti della relazione annuale con bilancio certificato, della relazione semestrale con bilancio non certificato e dei KID dei PRIIP. Loro copie sono disponibili presso i Servizi agli investitori, l'Agente per i trasferimenti, la Società di Gestione o qualsiasi Rappresentante o Distributore.

Panoramica economica globale

Le azioni globali, rappresentate dall'indice MSCI All Country World ("ACWI"), hanno reso il 2,56% (in USD) nel semestre chiuso al 30 settembre 2023. Le azioni si sono risollevate dal clima di pessimismo indotto dall'elevata inflazione (il tasso di incremento dei prezzi di beni e servizi) e dal rialzo dei tassi di interesse; in molte aree del mondo l'inflazione ha mostrato evidenti segnali di rallentamento. Segnali di stabile resilienza, come una solida spesa al consumo e l'occupazione a pieno regime, hanno attenuato le preoccupazioni degli investitori in merito alla crescita economica globale.

Nel secondo trimestre del 2023 l'economia statunitense ha registrato una robusta crescita caratterizzata dall'aumento sia della spesa pubblica che di quella al consumo; nel terzo trimestre i consumatori hanno mostrato segnali di un incremento costante della spesa. Nonostante gli effetti sui mercati del fallimento di alcune importanti banche regionali, il rapido intervento dei governi ne ha limitato l'impatto sull'economia nel suo complesso. In Giappone l'economia ha accelerato nel secondo trimestre del 2023 e il governo ha revocato i rigidi controlli alle frontiere, sebbene le esportazioni siano diminuite verso la fine del periodo in esame. Nel secondo trimestre del 2023 l'economia del Regno Unito è rimasta quasi invariata, per poi contrarsi nel luglio 2023 prima di registrare un lieve rimbalzo nell'agosto 2023, in un contesto di recupero del settore dei servizi. Anche nell'Eurozona la crescita è stata modesta nel secondo trimestre del 2023, ma gli alti tassi di interesse hanno continuato a pesare sull'economia della regione e a luglio e agosto 2023 le vendite al dettaglio hanno evidenziato un calo. L'acquisizione della fallita Credit Suisse da parte di UBS su richiesta delle autorità di regolamentazione ha stabilizzato i mercati.

La maggior parte delle economie dei mercati emergenti ha continuato a espandersi, sebbene le fluttuazioni dei prezzi delle materie prime e il contesto di rialzo dei tassi di interesse abbiano rappresentato notevoli sfide economiche. L'economia cinese è cresciuta a un ritmo lento rispetto al tasso storico del paese, mentre il calo dei prezzi al consumo ha sollevato preoccupazioni per la deflazione (calo dei prezzi di beni e servizi).

Le più grandi banche centrali del mondo hanno continuato ad attuare misure volte a rafforzare la politica monetaria, anche se in alcune regioni la stretta si è allentata. La Federal Reserve statunitense ("la Fed") ha innalzato i tassi di interesse per due volte, escludendo tuttavia revisioni verso l'alto in due delle sue riunioni. Di conseguenza, gli aumenti dei tassi di interesse sono proseguiti a un ritmo nettamente più lento rispetto ai tempi della brusca stretta operata dalla Fed nella seconda metà del 2022. La Fed ha inoltre continuato a ridurre alcune partecipazioni obbligazionarie accumulate nel suo bilancio.

La Banca d'Inghilterra ("BoE") ha innalzato i tassi di interesse per tre volte, per poi tuttavia mantenerli invariati in occasione della sua ultima riunione del periodo. La Banca centrale europea ("BCE") ha operato rialzi dei tassi di interesse in ciascuna delle sue quattro riunioni nel tentativo di tenere sotto controllo l'aumento dei prezzi nell'Eurozona. Ha inoltre continuato a tagliare il suo bilancio lasciando scadere alcune delle sue obbligazioni in circolazione senza effettuare reinvestimenti."

BLACKROCK UCITS FUNDS

RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Panoramica economica globale (continua)

Le azioni globali hanno generato una performance complessivamente positiva grazie all'attenuazione delle pressioni inflazionistiche e alla tenuta della crescita economica globale, nonostante la decelerazione registrata in alcune regioni. I titoli azionari statunitensi si sono apprezzati in un contesto di allentamento della stretta da parte della Fed e in particolare grazie alle innovazioni nel settore tecnologico. I titoli azionari europei hanno evidenziato perdite a causa della pressione derivante dall'aumento dei costi di finanziamento. Al contempo i titoli azionari asiatici hanno registrato un calo dovuto alla decelerazione economica della Cina che ha pesato sulla regione. In flessione anche le azioni dei mercati emergenti, che hanno in parte risentito dell'apprezzamento del dollaro statunitense durante il periodo in esame.

I prezzi delle obbligazioni globali (che si muovono in direzione contraria rispetto ai rendimenti) sono complessivamente diminuiti a causa dei tassi d'interesse che potrebbero rimanere elevati ancora per qualche tempo. I prezzi dei Treasury statunitensi si sono considerevolmente ridotti, in quanto la tenuta dell'economia degli Stati Uniti ha indotto gli investitori a rivedere le proprie aspettative sull'evoluzione della politica monetaria della Fed. Sono scesi anche i prezzi dei Gilt britannici: l'elevato fabbisogno di finanziamenti e la persistente inflazione hanno infatti acuito i timori degli investitori. I titoli di Stato europei hanno registrato un calo più modesto, mentre i prezzi dei titoli di Stato giapponesi sono stati caratterizzati da volatilità dovuta ai cospicui acquisti periodici da parte della Bank of Japan mirati a mantenere i rendimenti entro un tetto massimo. Le obbligazioni societarie globali si sono difese meglio dei titoli di Stato grazie alla riconfermata tenuta dell'economia globale che ha allentato i timori per il credito. Le obbligazioni high yield hanno segnato un progresso, a differenza di quelle investment grade in lieve calo.

Nei mercati delle materie prime, è salito il prezzo del greggio Brent a causa dei tagli ai livelli di produzione operati da alcuni grandi paesi produttori ed esportatori di petrolio. I prezzi del gas naturale europeo sono scesi leggermente, dopo il considerevole calo dai livelli massimi registrati successivamente all'invasione russa dell'Ucraina. Arretra di poco il metallo giallo, che ha risentito delle prospettive di tassi d'interesse elevati per più tempo e dell'apprezzamento del dollaro statunitense.

Nei mercati valutari, il dollaro statunitense si è apprezzato nei confronti di quasi tutte le altre valute globali. La solidità dell'economia statunitense e le indicazioni della Fed secondo cui i tassi d'interesse sarebbero rimasti elevati ancora per qualche tempo hanno fatto risalire il valore relativo del biglietto verde. Yen giapponese, yuan cinese, euro e sterlina si sono tutti deprezzati rispetto al dollaro statunitense.

Valutazione della performance e attività del Fondo

BlackRock UK Credit Screened Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2023, il Fondo ha reso lo 0,88% con un rendimento attivo dello 0,01%, superando il suo parametro della performance che ha generato un risultato dello 0,89% (il rendimento attivo è la differenza tra il rendimento del Fondo e il parametro della performance).

A marzo il mercato obbligazionario è stato caratterizzato dalla crisi del sistema bancario negli Stati Uniti e in Europa. Nell'aprile 2023 la volatilità del mercato obbligazionario si è ridotta rispetto ai livelli osservati a marzo a fronte dell'attenuazione dei timori per la crisi bancaria. A maggio il clima di fiducia negativo verso il mercato obbligazionario è stato determinato dall'incertezza inerente le trattative in corso sul tetto del debito negli Stati Uniti e da una serie di solidi dati sull'inflazione nei mercati sviluppati. Dopo la performance contrastata di giugno, a luglio la pubblicazione di dati economici complessivamente deboli ha generato risultati positivi per il mercato obbligazionario. Nonostante i continui segnali di attenuazione dell'inflazione, ad agosto il clima di fiducia globale verso il mercato obbligazionario globale si è deteriorato, in quanto gli operatori di mercato hanno rivisto la loro valutazione su inflazione e tassi di interesse a più lungo termine. Il clima di fiducia verso il mercato obbligazionario globale è rimasto negativo anche a settembre per effetto del generale incremento dei rendimenti dei titoli di Stato dei mercati sviluppati, dovuto principalmente alla prevista stretta da parte del Federal Reserve Open Market Committee.

Il Fondo è stato posizionato in modo difensivo, con sottoesposizione (filtri) ad alcune società tecnologiche oltreché ad alcune società farmaceutiche appartenenti al settore dei beni di consumo non ciclici. Il Fondo ha inoltre escluso alcuni emittenti ferroviari nel settore dei trasporti, al pari di alcuni titoli appartenenti all'ambito delle comunicazioni wireless.

Per quanto riguarda il settore finanziario, il Fondo è stato posizionato in modo difensivo in emittenti selezionati nel settore bancario, finanziario-immobiliare e nei REIT.

Nel semestre, i maggiori contributi positivi e negativi al risultato del Fondo rispetto al parametro della performance sono giunti dalle posizioni seguenti:

Principali contributi positivi		Principali contributi negativi	
Settore	Effetto sul rendimento del Fondo	Settore	Effetto sul rendimento del Fondo
Assicurazioni*	0,08%	Technologie*	(0,02%)
Gas naturale*	0,02%	Energia elettrica	(0,01%)
Comunicazioni*	0,01%	Altre utility	(0,01%)
Intermediari/gestori patrimoniali/valute*	0,01%	Beni di consumo ciclici*	(0,01%)
Energia*	0,01%	Beni strumentali*	(0,01%)

* Posizione di sovrappeso - esposizione superiore a quella del parametro della performance.

° Posizione di sottopeso - esposizione inferiore a quella del parametro della performance.

Il Fondo non detiene posizioni sovrappesate. Il Fondo utilizza un approccio di screening del credito che cerca di eliminare solo gli emittenti a più alto rischio di deterioramento creditizio. Una volta rimossi questi emittenti, il Fondo cercherà di replicare il beta dell'universo d'investimento sottostante, mirando pertanto ad evitare qualsiasi sovrapponderazione attiva.

BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2023, il Fondo ha reso l'1,79%.

A marzo il mercato obbligazionario è stato caratterizzato dalla crisi del sistema bancario negli Stati Uniti e in Europa. Nell'aprile 2023 la volatilità del mercato obbligazionario si è ridotta rispetto ai livelli osservati a marzo a fronte dell'attenuazione dei timori per la crisi bancaria. A maggio il clima di fiducia negativo verso il mercato obbligazionario è stato determinato dall'incertezza inerente le trattative in corso sul tetto del debito negli Stati Uniti e da una serie di solidi dati sull'inflazione nei mercati sviluppati. Dopo la performance contrastata di giugno, a luglio la pubblicazione di dati economici complessivamente deboli ha generato risultati positivi per il mercato obbligazionario. Nonostante i continui segnali di attenuazione dell'inflazione, ad agosto il clima di fiducia globale verso il mercato obbligazionario globale si è deteriorato, in quanto gli operatori di mercato hanno rivisto la loro valutazione su inflazione e tassi di interesse a più lungo termine. Il clima di fiducia verso il mercato obbligazionario globale è rimasto negativo anche a settembre per effetto del generale incremento dei rendimenti dei titoli di Stato dei mercati sviluppati, dovuto principalmente alla prevista stretta da parte del Federal Reserve Open Market Committee.

BLACKROCK UCITS FUNDS

RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Valutazione della performance e attività del Fondo (continua)

Blackrock Defensive Yield ESG Screened Fund (continua)

Il Fondo è rimasto posizionato in modo difensivo e ha ridotto la sua allocazione al credito high yield nel periodo in esame. Al 30 settembre 2023, il Fondo deteneva un portafoglio composto il cui valore di mercato è composto al 66,2% da credito investment grade, rispetto al 64,6% di inizio periodo, e al 34,0% da credito high yield, rispetto al 36,1% di inizio periodo.

Nel semestre, i maggiori contributi positivi e negativi al risultato del Fondo sono giunti dalle posizioni seguenti:

Principali contributi positivi		Principali contributi negativi	
Settore	Effetto sul rendimento del Fondo	Settore	Effetto sul rendimento del Fondo
Banche	0,35%		
Beni di consumo non ciclici	0,22%		
Beni di consumo ciclici	0,21%		
Comunicazioni	0,15%		
Beni strumentali	0,09%		

La tabella seguente riporta le principali ponderazioni del portafoglio al 30 settembre 2023 e al 31 marzo 2023:

30 settembre 2023		31 marzo 2023	
Classe di attivi	Esposizione lorda	Classe di attivi	Esposizione lorda
Banche	27,83%	Banche	21,62%
Beni di consumo non ciclici	12,10%	Beni di consumo non ciclici	16,57%
Beni di consumo ciclici	12,08%	Beni di consumo ciclici	11,66%
Beni strumentali	8,32%	Comunicazioni	9,32%
Comunicazioni	8,05%	Beni strumentali	7,31%

BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2023, il Fondo ha reso il (2,90%) con un rendimento attivo dello (0,40%), sottoperformando il suo parametro della performance che ha reso il (2,50%) (il rendimento attivo è la differenza tra il rendimento del Fondo e il parametro della performance).

A marzo il mercato obbligazionario è stato caratterizzato dalla crisi del sistema bancario negli Stati Uniti e in Europa. Nell'aprile 2023 la volatilità del mercato obbligazionario si è ridotta rispetto ai livelli osservati a marzo a fronte dell'attenuazione dei timori per la crisi bancaria. A maggio il clima di fiducia negativo verso il mercato obbligazionario è stato determinato dall'incertezza inerente le trattative in corso sul tetto del debito negli Stati Uniti e da una serie di solidi dati sull'inflazione nei mercati sviluppati. Dopo la performance contrastata di giugno, a luglio la pubblicazione di dati economici complessivamente deboli ha generato risultati positivi per il mercato obbligazionario. Nonostante i continui segnali di attenuazione dell'inflazione, ad agosto il clima di fiducia globale verso il mercato obbligazionario globale si è deteriorato, in quanto gli operatori di mercato hanno rivisto la loro valutazione su inflazione e tassi di interesse a più lungo termine. Il clima di fiducia verso il mercato obbligazionario globale è rimasto negativo anche a settembre per effetto del generale incremento dei rendimenti dei titoli di Stato dei mercati sviluppati, dovuto principalmente alla prevista stretta da parte della Fed.

Nel periodo in esame il Fondo ha mantenuto allocazioni sovrappesate principalmente in Germania, Corea del Sud, Paesi Bassi e Australia, nonché allocazioni sottopesate nel Regno Unito e in Francia, Spagna e Italia. La sottoponderazione di Regno Unito, Francia Spagna e Italia ha generato alfa, mentre il posizionamento su altri paesi ha penalizzato la performance.

Nel semestre, i maggiori contributi positivi e negativi al risultato del Fondo rispetto al parametro della performance sono giunti dalle posizioni seguenti:

Principali contributi positivi		Principali contributi negativi	
Settore	Effetto sul rendimento del Fondo	Settore	Effetto sul rendimento del Fondo
Regno Unito ^o	0,13%	Australia [*]	(0,13%)
Francia ^o	0,10%	Germania [*]	(0,09%)
Spagna ^o	0,07%	Corea del Sud [*]	(0,09%)
Italia ^o	0,07%	Paesi Bassi [*]	(0,06%)
Belgio ^o	0,05%	Stati Uniti [*]	(0,05%)

^{*} Posizione di sovrappeso - esposizione superiore a quella del parametro della performance.

^o Posizione di sottopeso - esposizione superiore a quella del parametro della performance.

La seguente tabella illustra in dettaglio le posizioni attive significative nelle quali il Fondo è sovrappesato (detiene un'esposizione maggiore rispetto al parametro della performance) e sottopesato (detiene un'esposizione minore rispetto al parametro della performance), al 30 settembre 2023 e al 31 marzo 2023:

Maggiore posizione in sovrappeso:			
30 settembre 2023		31 marzo 2023	
Paese	Ponderazione	Paese	Ponderazione
Paesi Bassi	1,95%	Germania	3,57%
Germania	1,94%	Paesi Bassi	1,98%
Austria	1,17%	Austria	1,55%

BLACKROCK UCITS FUNDS

RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Valutazione della performance e attività del Fondo (continua)

BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund (continua)

Maggiore posizione in sottopeso:			
30 settembre 2023		31 marzo 2023	
Paese	Ponderazione	Paese	Ponderazione
Italia	(3,50%)	Italia	(3,45%)
Francia	(3,02%)	Spagna	(1,07%)
Spagna	(2,05%)	Portogallo	(0,62%)

BlackRock Diversifying Fixed Income Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2023 il Fondo ha reso il (0,36%), sottoperformando il suo parametro della performance che ha registrato un rendimento dell'1,58%.

Nel 2023 l'aumento della volatilità macro e di mercato ha accentuato la divergenza tra la performance dei titoli e quella del mercato più ampio. In particolare, gli indicatori di inflazione nei mercati sviluppati hanno mostrato segnali di decelerazione, mentre l'attività economica è rimasta stagnante.

La traiettoria della politica monetaria dei mercati emergenti e di quelli sviluppati ha iniziato a divergere: gran parte delle banche centrali dei mercati sviluppati ha proseguito il ciclo di rialzi avviato nel 2022 a fronte dell'elevata inflazione core. La maggior parte delle banche centrali dei mercati emergenti, come Messico e India, ha invece tenuto i tassi fermi, mentre altre, come quelle di Brasile e Cile, hanno recentemente iniziato a tagliarli. In particolare, la BCE ha innalzato i tassi di 125 punti base durante le ultime quattro riunioni. Il tasso dei Fed Funds si aggira attualmente intorno al 5,25%-5,50%. In un quadro caratterizzato da queste dinamiche, permane la sfida geopolitica del conflitto tra Russia e Ucraina. Le relazioni tra gli Stati Uniti e la Cina, in particolare per quanto riguarda la localizzazione della catena di approvvigionamento, continuano a creare incertezze. In particolare, i maggiori contributi sono stati apportati dalle obbligazioni high yield, che hanno mitigato le perdite dovute ai principali detrattori.

Nel semestre, i maggiori contributi positivi e negativi al risultato del Fondo sono giunti dalle posizioni seguenti:

Principali contributi positivi		Principali contributi negativi	
Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo	Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo
BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund	0,35%	iShares ESG Screened Global Corporate Bond Index Fund	(0,41%)
iShares € High Yield Corp Bond ETF	0,27%	iShares € Inflation Linked Govt Bond UCITS	(0,27%)
iShares ESG Screened Euro Corporate Bond Index Fund	0,13%	Shares \$ TIPS UCITS ETF EUR Hedged (Acc)	(0,24%)

Nell'ultimo semestre la volatilità di mercato è rimasta elevata, determinando una maggiore dispersione nella performance dei titoli. Dopo la crisi del sistema bancario nei primi mesi del 2023, le tensioni esistenti nelle banche regionali si sono attenuate. La reazione degli investitori alla buona tenuta degli utili societari e alla eterogeneità dei dati economici ha inoltre sostenuto la performance nel segmento delle obbligazioni high yield, determinando una contrazione degli spread che a settembre 2023 hanno segnato il livello minimo da aprile 2022. Le obbligazioni indicizzate all'inflazione hanno invece sofferto, con tassi di pareggio in calo e una decelerazione dell'inflazione indotta dalle buone dinamiche dei prezzi in un quadro di normalizzazione della domanda. Il calo dell'inflazione durante tutto il 2023 è avvenuto a spese della crescita economica, in quanto gli effetti della stretta monetaria hanno iniziato a concretizzarsi.

La tabella seguente riporta le principali ponderazioni del portafoglio al 30 settembre 2023 e al 31 marzo 2023:

30 settembre 2023		31 marzo 2023	
Classe di attivi	Esposizione lorda	Classe di attivi	Esposizione lorda
Obbligazioni corporate high yield	31,88%	Obbligazioni corporate high yield	31,77%
Obbligazioni corporate investment grade	30,72%	Obbligazioni corporate investment grade	30,88%
Debito dei mercati emergenti in valuta forte	21,97%	Debito dei mercati emergenti in valuta forte	21,83%
Titoli di Stato	14,59%	Titoli di Stato	15,23%
Liquidità e altro	0,83%	Liquidità e altro	0,29%

A fine settembre 2023, l'asset allocation era sostanzialmente invariata rispetto alla fine di marzo 2023.

BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2023, il Fondo ha reso il (2,52)% con un rendimento attivo dello (0,47)%, sottoperformando il suo benchmark obiettivo che ha reso il (2,05)% (il rendimento attivo è la differenza tra il rendimento del Fondo e quello del benchmark obiettivo).

La strategia d'investimento del Fondo utilizza modelli quantitativi (matematici o statistici) per adottare un approccio sistematico (basato su regole) alla selezione dei titoli.

A pesare sulla performance del fondo sono state in particolare le analisi macrotematiche e, più specificamente, la selezione geografica. La maggior parte delle perdite è attribuibile ai sottopesi relativi in India e nella Cina continentale. A incidere negativamente è stata anche la selezione settoriale, soprattutto la deludente performance del posizionamento sui settori informatica e materiali. Altrettanto negative sono state le analisi basate sul clima di fiducia e, in particolare, quelle che si basano sulle previsioni effettive degli analisti sell side, come pure l'analisi testuale delle relazioni degli intermediari, anche se in misura minore. Le analisi fondamentali più tradizionali hanno invece contribuito al risultato. Tra di esse figurano non solo analisi dei titoli Value, miranti a identificare società con valutazioni interessanti, ma anche quelle concentrate sull'individuazione di società redditizie e di alta qualità.

BLACKROCK UCITS FUNDS

RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Valutazione della performance e attività del Fondo (continua)

BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund (continua)

Nel semestre, i maggiori contributi positivi e negativi al rendimento relativo del Fondo rispetto al benchmark obiettivo sono giunti dalle posizioni seguenti:

Principali contributi positivi		Principali contributi negativi	
Settore	Effetto sul rendimento del Fondo	Settore	Effetto sul rendimento del Fondo
Informatica ^a	0,76%	Finanziari ^o	0,64%
Prodotti industriali ^o	0,33%	Beni voluttuari ^a	0,43%
Servizi pubblici ^o	0,23%	Beni di prima necessità ^o	0,31%
Servizi di comunicazione ^a	0,21%	Materiali ^o	0,19%
Energia ^a	0,19%		

^aPosizione di sovrappeso - esposizione superiore a quella del benchmark.

^oPosizione di sottopeso - esposizione inferiore a quella del benchmark.

Una posizione sottopesata relativa sui finanziari ha rappresentato il maggiore apporto negativo alla performance. A favorire particolarmente i risultati è stato invece il sovrappeso relativo sul settore informatico.

La seguente tabella riporta in dettaglio le principali posizioni attive, alle quali il Fondo è stato sovraesposto (ha detenuto un'esposizione superiore a quella del benchmark) e sottoesposto (ha detenuto un'esposizione minore rispetto al benchmark), al 31 marzo 2023 e al 30 settembre 2023:

Maggiore posizione in sovrappeso:			
31 marzo 2023		30 settembre 2023	
Paese	Ponderazione	Paese	Ponderazione
Taiwan	1,96%	Taiwan	2,28%
Sudafrica	1,53%	Brasile	1,45%
Cina	1,24%	Cina	1,33%

Maggiore posizione in sottopeso:			
31 marzo 2023		31 marzo 2023	
Paese	Ponderazione	Paese	Ponderazione
Corea del Sud	1,90%	Corea del Sud	2,14%
India	1,56%	Messico	1,71%
Malesia	0,62%	India	1,25%

Nel caso in cui il Fondo sia sottoesposto a un paese, l'apporto di tale paese avrà un effetto negativo sul rendimento attivo del Fondo. Di conseguenza, un paese potrebbe essere citato nell'elenco dei contributi positivi/negativi ma non comparire nel Prospetto di portafoglio del Fondo.

Taiwan rimane la posizione maggiormente sovrappesata, seguita da Brasile e Cina. La Corea è la posizione maggiormente sottopesata, mentre l'India è passata dalla seconda alla terza posizione per maggior sovrappeso.

BlackRock Global Equity Selection Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2023, il Fondo ha reso il 3,29% con un rendimento attivo dello 0,04%, sottoperformando il suo indice di riferimento che ha ottenuto lo 3,25% (il rendimento attivo è la differenza tra il rendimento del Fondo e quello del benchmark della performance).

La prima metà del 2023 è stata caratterizzata dalla politica dei tassi "più alti per più tempo". Il calo dell'inflazione durante tutto il 2023 è avvenuto a spese della crescita economica, in particolar modo nei mercati sviluppati. I rendimenti obbligazionari hanno evidenziato un'impennata e si trovano attualmente al livello più alto da un decennio a questa parte. Nel 2023 le azioni hanno registrato una ripresa, trainata principalmente dal settore tecnologico.

Nel semestre, i maggiori contributi positivi e negativi al risultato del Fondo rispetto all'indice di riferimento sono giunti dalle posizioni seguenti:

Principali contributi positivi		Principali contributi negativi	
Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo	Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo
BlackRock Global Funds – World Financials Fund [#]	0,92%	BlackRock Global Funds – Systematic China A-Share Opportunities Fund [#]	(0,22%)
iShares MSCI USA ESG Enhanced Fund [#]	0,79%	BlackRock Global Funds – European Special Situations Fund [#]	(0,19%)
BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund [#]	0,61%	BlackRock Global Funds – Continental European Flexible Fund [#]	(0,11%)
BlackRock Global Funds – World Technology Fund [#]	0,41%	BlackRock Global Funds – Sustainable Energy Fund [#]	(0,08%)
BlackRock Global Funds – United Kingdom Fund [#]	0,24%	iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF [#]	(0,06%)

[#] Posizione di sovrappeso - esposizione superiore a quella dell'indice di riferimento.

^o Posizione di sottopeso - esposizione superiore a quella dell'indice di riferimento.

BLACKROCK UCITS FUNDS

RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Valutazione della performance e attività del Fondo (continua)

BlackRock Global Equity Selection Fund (continua)"

L'allocazione del Fondo ai finanziari ha apportato il maggior contributo alla performance durante il semestre. Il secondo maggior contributo ai risultati è giunto dall'esposizione del Fondo alle azioni statunitensi. A pesare maggiormente sulla performance del Fondo è stata invece la sua esposizione alle azioni A cinesi.

La seguente tabella riporta in dettaglio le principali posizioni attive, alle quali il Fondo è stato sovraesposto (ha detenuto un'esposizione superiore a quella dell'indice di riferimento) e sottoesposto (ha detenuto un'esposizione minore rispetto all'indice di riferimento), al 30 settembre 2023 e al 31 marzo 2023:

Maggiore posizione in sovrappeso:			
30 settembre 2023		31 marzo 2023	
Settore	Ponderazione	Settore	Ponderazione
Tecnologia	3,73%	Salute	2,93%
Salute	2,38%	Finanziari	1,84%
Industria	0,43%	Tecnologia	1,13%

Maggiore posizione in sottopeso:			
30 settembre 2023		31 marzo 2023	
Settore	Ponderazione	Settore	Ponderazione
Beni di prima necessità	(3,36%)	Beni di prima necessità	(2,99%)
Energia	(2,04%)	Servizi pubblici	(1,45%)
Servizi pubblici	(1,23%)	Energia	(1,25%)

BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2023, il Fondo ha reso il (0,32%).

La prima metà del 2023 è stata caratterizzata dalla politica dei tassi "più alti per più tempo". Il calo dell'inflazione durante tutto il 2023 è avvenuto a spese della crescita economica, in particolar modo nei mercati sviluppati. I rendimenti obbligazionari hanno evidenziato un'impennata e si trovano attualmente al livello più alto da un decennio a questa parte. Nel 2023 le azioni hanno registrato una ripresa, trainata principalmente dal settore tecnologico.

Nel semestre, i maggiori contributi positivi e negativi al risultato del Fondo sono giunti dalle posizioni seguenti:

Principali contributi positivi		Principali contributi negativi	
Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo	Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo
BlackRock Global Funds – World Financials Fund	0,36%	Derivati (copertura del rischio di cambio) e strumenti liquidi equivalenti	(0,64%)
BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund	0,22%	iShares \$ Corp Bond UCITS ETF	(0,27%)
BlackRock Global Funds – World Technology Fund	0,17%	iShares \$ TIPS UCITS ETF	(0,22%)
BlackRock Global Funds – United Kingdom Fund	0,17%	BlackRock Global Funds – Systematic China A-Share Opportunities Fund	(0,22%)
BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund	0,13%	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF	(0,13%)

Le azioni dei mercati sviluppati hanno apportato il maggior contributo alla performance durante il semestre, seguite dall'allocazione del Fondo negli hedge fund. A pesare maggiormente sui risultati sono state invece le obbligazioni non governative, principalmente a causa dell'allocazione nelle obbligazioni societarie, nelle obbligazioni indicizzate all'inflazione e nei titoli di Stato americani.

La tabella seguente riporta le principali ponderazioni del portafoglio al 30 settembre 2023 e al 31 marzo 2023:

30 settembre 2023		31 marzo 2023	
Strategia	Esposizione lorda	Strategia	Esposizione lorda
iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF	6,90%	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF	6,89%
BlackRock Strategic Funds – Sustainable Euro Bond Fund	6,71%	iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF	6,85%
BlackRock Global Funds – Continental European Flexible Fund	6,58%	BlackRock Global Funds – Continental European Flexible Fund	6,77%
BlackRock Advantage Europe Equity Fund	6,47%	BlackRock Strategic Funds – Sustainable Euro Bond Fund	6,62%
BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund	6,04%	BlackRock Advantage Europe Equity Fund	6,32%

BLACKROCK UCITS FUNDS

RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Valutazione della performance e attività del Fondo (continua)

BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2023, il Fondo ha reso lo (0,44%).

La prima metà del 2023 è stata caratterizzata dalla politica dei tassi "più alti per più tempo". Il calo dell'inflazione durante tutto il 2023 è avvenuto a spese della crescita economica, in particolar modo nei mercati sviluppati. I rendimenti obbligazionari hanno evidenziato un'impennata e si trovano attualmente al livello più alto da un decennio a questa parte. Nel 2023 le azioni hanno registrato una ripresa, trainata principalmente dal settore tecnologico.

Nel semestre, i maggiori contributi positivi e negativi al risultato del Fondo sono giunti dalle posizioni seguenti:

Principali contributi positivi		Principali contributi negativi	
Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo	Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	0,34%	iShares \$ Corporate Bond ESG UCITS ETF	(0,23%)
BlackRock Global Funds – World Financials Fund	0,32%	iShares \$ TIPS UCITS ETF	(0,22%)
BlackRock Tactical Opportunities Fund	0,26%	BlackRock Global Funds – Systematic China A-Share Opportunities Fund	(0,21%)
BlackRock Global Funds – World Technology Fund	0,20%	BlackRock Global Funds – Global Inflation Linked Bond Fund	(0,16%)
BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund	0,17%	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF	(0,14%)

Le azioni dei mercati sviluppati hanno apportato il maggior contributo alla performance, seguite dall'allocazione del Fondo negli hedge fund. Le azioni, le materie prime e i titoli di Stato dei mercati emergenti sono rimasti generalmente invariati durante il semestre. A incidere negativamente sui risultati sono state invece in particolare le obbligazioni non governative e gli strumenti liquidi equivalenti.

La tabella seguente riporta le principali ponderazioni del portafoglio al 30 settembre 2023 e al 31 marzo 2023:

30 settembre 2023		31 marzo 2023	
Strategia	Esposizione lorda	Strategia	Esposizione lorda
BlackRock Strategic Funds – Sustainable Euro Bond Fund	6,86%	BlackRock Strategic Funds – Sustainable Euro Bond Fund	6,84%
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	6,13%	iShares € Ultrashort Bond UCITS ETF	6,43%
iShares \$ Corporate Bond ESG UCITS ETF	5,82%	BlackRock Strategic Funds – BlackRock European Absolute Return Fund	5,97%
BlackRock Global Funds – Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	5,07%	BlackRock Global Funds – Global Inflation Linked Bond Fund	4,93%
BlackRock Global Funds – Global Inflation Linked Bond Fund	4,48%	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF	4,58%

BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund

Nel periodo chiuso al 27 giugno 2023 (data di chiusura del Fondo), il Fondo ha generato un rendimento del (2,46)% sottoperformando purtroppo il benchmark obiettivo (il rendimento attivo è la differenza tra il rendimento del Fondo e quello del benchmark obiettivo).

La strategia d'investimento del Fondo utilizza modelli quantitativi (matematici o statistici) per adottare un approccio sistematico (basato su regole) alla selezione dei titoli.

I nostri segnali ESG proprietari hanno evidenziato risultati modesti durante il periodo, su cui ha pesato la debolezza del mercato generale rispetto a parametri ESG generici. Tuttavia, i parametri sociali e del capitale umano sono andati meglio. Queste misure offrono una prospettiva alternativa per valutare la qualità degli utili e la redditività delle società e possono offrire una visione approfondita tempestiva della performance, in particolare in condizioni economiche incerte. Per quanto concerne altre aree, le analisi che seguono la view della comunità di analisti sell side hanno apportato un contributo robusto alla performance. Altrettanto favorevoli le analisi fondamentali più tradizionali. Tra di esse figurano non solo analisi dei titoli Value, miranti a identificare società con valutazioni interessanti, ma anche quelle concentrate sull'individuazione di società redditizie e di alta qualità. Tuttavia, ciò non è bastato a compensare le performance deludenti del gruppo di segnali ESG sopra citati.

In conformità alle norme della Banca Centrale d'Irlanda ("CBI"), è stato deciso di liquidare il Fondo, in quanto non più commercialmente sostenibile; questa decisione è stata presa nel migliore interesse dei sottoscrittori. Il 27 giugno 2023 tutte le quote del Fondo sono state annullate.

FR Multi-Asset Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2023 il Fondo ha reso l'1,81%, sovraperformando il suo indice della performance che ha registrato un rendimento del (1,86%).

Il secondo trimestre del 2023 è stato caratterizzato da una significativa divergenza della performance delle attività finanziarie. Nonostante le notizie di inflazione persistente, decelerazione della crescita e tassi di interesse più alti ancora a lungo abbiano determinato la sottoperformance di beni rifugio come i titoli di Stato, l'entusiasmo per l'Intelligenza artificiale ha favorito alcuni colossi tecnologici che hanno sovraperformato durante il trimestre. Nel terzo trimestre del 2023 sia le azioni che le obbligazioni hanno messo a segno risultati negativi a causa dei persistenti timori degli investitori circa il percorso dell'inflazione e della crescita economica. A complicare il quadro è stato l'aumento dei costi dell'energia, dovuto in primo luogo alla decisione dell'OPEC+ di estendere di tagli alla produzione, una minaccia sia per la spesa al consumo che per l'inflazione complessiva. Poiché il calo dell'inflazione è più lento delle attese, gli investitori hanno iniziato a scontare un contesto di tassi "più alti per più tempo", con conseguenti livelli record dei tassi d'interesse.

BLACKROCK UCITS FUNDS

RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Valutazione della performance e attività del Fondo (continua)

FR Multi-Asset Fund (continua)

In un simile quadro, il Fondo ha generato risultati relativamente buoni rispetto al suo benchmark grazie principalmente al suo posizionamento sulla duration breve in un periodo di rialzi dei tassi.

Nel semestre, i maggiori contributi positivi e negativi al risultato del Fondo sono giunti dalle posizioni seguenti:

Principali contributi positivi		Principali contributi negativi	
Titolo	Effetto sul rendimento del Fondo	Titolo	Effetto sul rendimento del Fondo
Blk Sus Adv Us Eq	0,81%	Ishares \$ Sy Bond 20+Yr Eur Hd	(0,78%)
Ishares Msci Usa Esg Enhance	0,65%	Ishares Global Agg Bond Esg Eur Hd	(0,18%)
Blk Sus Eq Factor Plus	0,40%	Ishares Eur Gvt Bond 15-30	(0,15%)
Gbl Unconstrained Eq	0,16%	Ishares Us Mbs Ucits Eur Hd	(0,12%)
Ishares Msci World Value Fac Esg	0,13%	Ishares \$ Tsy Bd 7-10y Eur Hd	(0,10%)

Le azioni dei mercati sviluppati hanno apportato il maggior contributo alla performance durante il semestre. Nell'arco di questo orizzonte temporale, l'allocazione alle obbligazioni ha pesato maggiormente sui risultati, mentre l'allocazione del portafoglio alle materie prime e agli hedge fund ha creato diversificazione e favorito la performance.

La tabella seguente riporta le principali ponderazioni del portafoglio al 30 settembre 2023 e al 31 marzo 2023:

30 settembre 2023		31 marzo 2023	
Titolo	Esposizione lorda	Titolo	Esposizione lorda
Blk Sus Adv Us Eq	9,97%	Blk Sus Adv Us Eq	9,74%
Ishares Msci Usa Esg Enhance	7,80%	Ishares Msci Usa Esg Enhance	7,92%
Blk Sus Eq Factor Plus	7,10%	Blk Sus Eq Factor Plus	6,81%
Ishares Global Agg Bond Esg Eur Hd	5,46%	Ishares Global Agg Bond Esg Eur Hd	5,57%
Bgf Emerging Markets	5,10%	Bgf Emerging Markets	5,06%

BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2023, il Fondo ha reso l'1,41%. Il Fondo adotta una

strategia di acquisto e mantenimento ("buy and maintain") e non segue un benchmark.

Durante il suo periodo di sottoscrizione, il Fondo ha investito in liquidità e strumenti pressoché liquidi. Tra le posizioni figuravano titoli sovranazionali europei e titoli di Stato europei a breve scadenza. Dopo l'inizio del periodo di investimento, il Fondo era interamente investito in obbligazioni societarie denominate in euro. Da allora non si sono verificati eventi di credito rilevanti. Tuttavia il Fondo ha liquidato la posizione su un titolo industriale italiano sulla scia di notizie che la società potesse essere l'obiettivo di un'acquisizione. Il Gestore degli investimenti è riuscito a vendere a livelli pressoché invariati e investire in alcuni nuovi emittenti del settore della salute in vista di un miglioramento del rating e di una crescita dei rendimenti. I movimenti di mercato hanno cambiato anche le esposizioni a vari emittenti; ad esempio alcune obbligazioni hanno generato buoni risultati e di conseguenza il loro peso è salito al di sopra delle percentuali di investimento iniziale; il Gestore degli investimenti ha pertanto utilizzato i lievi deflussi in uscita per ridurre questo tipo di casi e mantenere la diversificazione iniziale.

Nel semestre, i maggiori contributi positivi e negativi al risultato del Fondo sono giunti dalle posizioni seguenti:

Principali contributi positivi		Principali contributi negativi	
Settore	Effetto sul rendimento del Fondo	Settore	Effetto sul rendimento del Fondo
Finanziari	0,62%		-
Liquidità e titoli monetari	0,43%		-
Industria	0,22%		-
Servizi pubblici	0,11%		-
Government Related	0,03%		-

Il Gestore degli investimenti scommette sulla detenzione di rischio di credito di alta qualità. I rendimenti restano molto appetibili, con la classe di attivi ben posizionata a livello di fondamentali (grazie alla bassa leva finanziaria e agli elevati saldi di cassa) per affrontare il deterioramento della prospettiva di crescita. Il Gestore degli investimenti prevede una crescita della domanda degli investitori non appena il Fondo acquisirà una maggiore certezza circa la data finale del ciclo di rialzi da parte delle banche centrali.

BLACKROCK UCITS FUNDS

RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Valutazione della performance e attività del Fondo (continua)

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

La tabella seguente riporta le principali ponderazioni del portafoglio al 30 settembre 2023:

30 settembre 2023	
Settore	Ponderazione
Finanziari	55,42%
Industria	32,43%
Servizi pubblici	12,00%
Liquidità e titoli monetari	0,15%

Al 30 settembre 2023 il Fondo non aveva posizioni sottopesate.

BlackRock Advisors (UK) Limited
Ottobre 2023

BLACKROCK UCITS FUNDS

CONTO ECONOMICO SINTETICO

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

	BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund		BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1		BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1		BlackRock UK Credit Screened Fund	
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022
Note	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP
Reddito di esercizio	67	48	4.674	2.432	519	385	2.423	3.136
Utili/(perdite) netti su strumenti finanziari	8.276	(13.488)	(1.351)	(53.742)	(943)	(18.336)	(3.729)	(45.340)
Totale reddito/(perdita) da investimenti	8.343	(13.440)	3.323	(51.310)	(424)	(17.951)	(1.306)	(42.204)
Spese di esercizio	(226)	(167)	(133)	(133)	(48)	(65)	(65)	(57)
Reddito/(spese) netto/(e) di esercizio	8.117	(13.607)	3.190	(51.443)	(472)	(18.016)	(1.371)	(42.261)
Costi finanziari:								
Interessi passivi o oneri simili	–	–	(1)	(1)	–	–	(2)	–
Totale costi finanziari	–	–	(1)	(1)	–	–	(2)	–
Profitto/(perdita) netto/(a) al lordo di imposte	8.117	(13.607)	3.189	(51.444)	(472)	(18.016)	(1.373)	(42.261)
Tassazione	6	–	–	(1)	–	(2)	–	–
Profitto/(perdita) netto/(a) al netto di imposte	–	(13.607)	–	(51.445)	–	(18.018)	–	(42.261)
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	8.117	(13.607)	3.189	(51.445)	(472)	(18.018)	(1.373)	(42.261)

Non vi sono utili o perdite riconosciuti originati nel periodo finanziario all'infuori di quelli esposti nel conto economico sintetico.

La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

BLACKROCK UCITS FUNDS

CONTO ECONOMICO SINTETICO (continua)

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

	BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund		BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund		BlackRock Diversifying Fixed Income Fund		BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022
	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di USD	Migliaia di USD
Note								
Reddito di esercizio	1.093	732	1.061	692	396	718	5.035	8.381
Utili/(perdite) netti su strumenti finanziari	671	(5.408)	(3.761)	(9.328)	(513)	(10.073)	(9.487)	(91.781)
Totale reddito/(perdita) da investimenti	1.764	(4.676)	(2.700)	(8.636)	(117)	(9.355)	(4.452)	(83.400)
Spese di esercizio	(81)	(89)	(128)	(123)	(122)	(143)	(657)	(1.126)
Reddito/(spese) netto/(e) di esercizio	1.683	(4.765)	(2.828)	(8.759)	(239)	(9.498)	(5.109)	(84.526)
Costi finanziari:								
Interessi passivi o oneri simili	(1)	(1)	(36)	(1)	–	–	(149)	(15)
Distribuzioni ai sottoscrittori di quote rimborsabili	5	–	–	–	–	(125)	–	–
Totale costi finanziari	(1)	(1)	(36)	(1)	–	(125)	(149)	(15)
Profitto/(perdita) netto/(a) al lordo di imposte	1.682	(4.766)	(2.864)	(8.760)	(239)	(9.623)	(5.258)	(84.541)
Tassazione	6	–	(9)	(37)	–	–	(776)	(772)
Profitto/(perdita) netto/(a) al netto di imposte	1.682	(4.766)	(2.873)	(8.797)	(239)	(9.623)	(6.034)	(85.313)
Correzioni per l'allineamento alla metodologia di valutazione specificata nel prospetto	–	–	–	–	(3)	(3)	–	–
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	1.682	(4.766)	(2.873)	(8.797)	(242)	(9.626)	(6.034)	(85.313)

Non vi sono utili o perdite riconosciuti originati nel periodo finanziario all'infuori di quelli esposti nel conto economico sintetico.

La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

BLACKROCK UCITS FUNDS

CONTO ECONOMICO SINTETICO (continua)

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

	BlackRock Global Equity Selection Fund		BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund		BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹	
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022
Note	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di USD	Migliaia di USD
Reddito di esercizio	21	18	87	57	198	129	130	3.050
Utili/(perdite) netti su strumenti finanziari	1.080	(4.130)	(47)	(4.579)	(329)	(8.413)	(101)	(29.753)
Totale reddito/(perdita) da investimenti	1.101	(4.112)	40	(4.522)	(131)	(8.284)	29	(26.703)
Spese di esercizio	(231)	(249)	(273)	(307)	(426)	(445)	(301)	(148)
Reddito/(spese) netto/(e) di esercizio	870	(4.361)	(233)	(4.829)	(557)	(8.729)	(272)	(26.851)
Costi finanziari:								
Interessi passivi o oneri simili	–	–	–	(1)	–	(2)	(9)	(9)
Totale costi finanziari	–	–	–	(1)	–	(2)	(9)	(9)
Profitto/(perdita) netto/(a) al lordo di imposte	870	(4.361)	(233)	(4.830)	(557)	(8.731)	(281)	(26.860)
Tassazione	6	–	–	–	–	–	1	(316)
Profitto/(perdita) netto/(a) al netto di imposte	870	(4.361)	(233)	(4.830)	(557)	(8.731)	(280)	(27.176)
Correzioni per l'allineamento alla metodologia di valutazione specificata nel prospetto	–	–	–	–	–	–	–	(5)
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	870	(4.361)	(233)	(4.830)	(557)	(8.731)	(280)	(27.181)

¹ Il Fondo è stato chiuso durante l'esercizio finanziario.

Non vi sono utili o perdite riconosciuti originati nel periodo finanziario all'infuori di quelli esposti nel conto economico sintetico.

La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

BLACKROCK UCITS FUNDS

CONTO ECONOMICO SINTETICO (continua)

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

	FR Multi-Asset Fund		BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ¹
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023 Migliaia di EUR	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022 Migliaia di EUR	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023 Migliaia di EUR
Note			
Reddito di esercizio	551	4	1.097
Utili/(perdite) netti su strumenti finanziari	939	73	1.941
Totale reddito/(perdita) da investimenti	1.490	77	3.038
Spese di esercizio	(667)	(55)	(559)
Reddito/(spese) netto/(e) di esercizio	823	22	2.479
Costi finanziari:			
Interessi passivi o oneri simili	(1)	(1)	–
Distribuzioni ai sottoscrittori di quote rimborsabili	5	–	(232)
Totale costi finanziari	(1)	(1)	(232)
Profitto/(perdita) netto/(a)	822	21	2.247
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	822	21	2.247

¹ Poiché il Fondo è stato lanciato durante il periodo finanziario, non sono disponibili dati comparativi. Non vi sono utili o perdite riconosciuti originati nel periodo finanziario all'infuori di quelli esposti nel conto economico sintetico. La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

BLACKROCK UCITS FUNDS

PROSPETTO SINTETICO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

	BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	BlackRock UK Credit Screened Fund				
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023 Migliaia di EUR	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022 Migliaia di EUR	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023 Migliaia di EUR	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022 Migliaia di GBP				
Patrimonio netto all'inizio del periodo finanziario	147.003	107.521	500.760	491.376	80.280	151.866	124.726	258.941
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	8.117	(13.607)	3.189	(51.445)	(472)	(18.018)	(1.373)	(42.261)
Operazioni su quote:								
Emissione di quote rimborsabili	–	24.000	59.326	39.127	113	733	–	111
Rimborso di quote rimborsabili	–	–	(69.963)	(7.316)	(69.605)	(4.215)	(23.544)	(38.836)
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto derivante da operazioni su quote	–	24.000	(10.637)	31.811	(69.492)	(3.482)	(23.544)	(38.725)
Patrimonio netto alla fine del periodo finanziario	155.120	117.914	493.312	471.742	10.316	130.366	99.809	177.955

La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

BLACKROCK UCITS FUNDS

PROSPETTO SINTETICO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO ATTRIBUIBILI AI SOTTOSCRITTORI DI QUOTE RIMBORSABILI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

	BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund				
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023 Migliaia di EUR	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022 Migliaia di EUR	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023 Migliaia di EUR	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022 Migliaia di EUR	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023 Migliaia di USD	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022 Migliaia di USD		
Patrimonio netto all'inizio del periodo finanziario	84.045	92.491	96.813	103.950	66.646	90.067	245.584	384.733
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	1.682	(4.766)	(2.873)	(8.797)	(242)	(9.626)	(6.034)	(85.313)
Operazioni su quote:								
Emissione di quote rimborsabili	895	398	–	–	–	–	1.412	771
Rimborso di quote rimborsabili	(11.177)	(4.708)	–	–	–	(8.823)	(8.206)	(21)
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto derivante da operazioni su quote	(10.282)	(4.310)	–	–	–	(8.823)	(6.794)	750
Patrimonio netto alla fine del periodo finanziario	75.445	83.415	93.940	95.153	66.404	71.618	232.756	300.170

La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

BLACKROCK UCITS FUNDS

PROSPETTO SINTETICO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO ATTRIBUIBILI AI SOTTOSCRITTORI DI QUOTE RIMBORSABILI (continua)

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

	BlackRock Global Equity Selection Fund	BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹				
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023 Migliaia di EUR	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022 Migliaia di EUR	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023 Migliaia di EUR	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022 Migliaia di USD				
Patrimonio netto all'inizio del periodo finanziario	29.680	33.555	35.681	42.318	90.456	87.605	11.594	270.128
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	870	(4.361)	(233)	(4.830)	(557)	(8.731)	(280)	(27.181)
Operazioni su quote:								
Emissione di quote rimborsabili	618	1.161	861	1.471	1.475	16.906	–	10.005
Rimborso di quote rimborsabili	(2.976)	(2.020)	(3.676)	(3.701)	(3.987)	(3.814)	(11.314)	(242.946)
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto derivante da operazioni su quote	(2.358)	(859)	(2.815)	(2.230)	(2.512)	13.092	(11.314)	(232.941)
Patrimonio netto alla fine del periodo finanziario	28.192	28.335	32.633	35.258	87.387	91.966	–	10.006

¹Il Fondo è stato chiuso durante l'esercizio finanziario.

La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

BLACKROCK UCITS FUNDS

PROSPETTO SINTETICO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO ATTRIBUIBILI AI SOTTOSCRITTORI DI QUOTE RIMBORSABILI (continua)

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

	FR Multi-Asset Fund		BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ¹
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023
	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Patrimonio netto all'inizio del periodo finanziario	298.050	–	–
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	822	21	2.247
Operazioni su quote:			
Emissione di quote rimborsabili	10.777	54.764	223.149
Rimborso di quote rimborsabili	(20.331)	–	(2.346)
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto derivante da operazioni su quote	(9.554)	54.764	220.803
Patrimonio netto alla fine del periodo finanziario	289.318	54.785	223.050

¹Poiché il Fondo è stato lanciato durante il periodo finanziario, non sono disponibili dati comparativi. La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

BLACKROCK UCITS FUNDS

STATO PATRIMONIALE SINTETICO

Al 30 settembre 2023

	Note	BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund		BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1		BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1		BlackRock UK Credit Screened Fund	
		AI	AI	AI	AI	AI	AI	AI	AI
		30 settembre 2023	31 marzo 2023	30 settembre 2023	31 marzo 2023	30 settembre 2023	31 marzo 2023	30 settembre 2023	31 marzo 2023
		Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP
ATTIVITÀ CORRENTI									
Liquidità		37	20	–	–	15	13	5	–
Strumenti liquidi equivalenti		–	–	2.189	2.240	1	162	604	720
Liquidità a margine		–	–	151	272	–	–	–	–
Crediti		23	10	7.730	6.173	333	3.400	2.008	2.130
Attività finanziarie al valore equo in conto economico	4	155.319	147.147	486.057	495.908	10.279	79.517	98.000	122.365
Totale attività correnti		155.379	147.177	496.127	504.593	10.628	83.092	100.617	125.215
PATRIMONIO NETTO									
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	7	155.120	147.003	493.312	500.760	10.316	80.280	99.809	124.726
Totale patrimonio netto		155.120	147.003	493.312	500.760	10.316	80.280	99.809	124.726
PASSIVITÀ CORRENTI									
Scoperto bancario		–	–	75	6	–	–	–	2
Debiti		259	174	2.740	3.705	312	2.812	808	487
Passività finanziarie al valore equo in conto economico	4	–	–	–	122	–	–	–	–
Totale passività correnti		259	174	2.815	3.833	312	2.812	808	489
Totale patrimonio netto e passività		155.379	147.177	496.127	504.593	10.628	83.092	100.617	125.215

La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

BLACKROCK UCITS FUNDS

STATO PATRIMONIALE SINTETICO (continua)
Al 30 settembre 2023

	Note	BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund		BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund		BlackRock Diversifying Fixed Income Fund		BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	
		AI 30 settembre 2023 Migliaia di EUR	AI 31 marzo 2023 Migliaia di EUR	AI 30 settembre 2023 Migliaia di EUR	AI 31 marzo 2023 Migliaia di EUR	AI 30 settembre 2023 Migliaia di EUR	AI 31 marzo 2023 Migliaia di EUR	AI 30 settembre 2023 Migliaia di USD	AI 31 marzo 2023 Migliaia di USD
ATTIVITÀ CORRENTI									
Liquidità		55	173	2.090	1.613	10	11	4.126	3.855
Strumenti liquidi equivalenti		1.016	2.615	–	–	544	133	–	–
Liquidità a margine		66	–	–	–	–	–	270	181
Garanzia liquida		–	–	–	–	–	–	381	429
Crediti		1.053	813	1.542	805	26	250	5.059	6.956
Attività finanziarie al valore equo in conto economico	4	74.006	81.346	93.310	96.269	65.916	66.499	228.487	242.949
Totale attività correnti		76.196	84.947	96.942	98.687	66.496	66.893	238.323	254.370
PASSIVITÀ CORRENTI									
Scoperto bancario		157	–	18	–	–	–	–	–
Liquidità a margine esigibile		–	–	–	–	–	–	7	147
Debiti		452	777	136	1.195	99	257	4.513	8.074
Accantonamento per imposte differite su plusvalenze		–	–	–	–	–	–	327	90
Passività finanziarie al valore equo in conto economico	4	142	125	2.848	679	–	–	720	475
Totale passività correnti		751	902	3.002	1.874	99	257	5.567	8.786
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili		75.445	84.045	93.940	96.813	66.397	66.636	232.756	245.584
Correzioni per l'allineamento alla metodologia di valutazione specificata nel prospetto	7	–	–	–	–	7	10	–	–
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	7	75.445	84.045	93.940	96.813	66.404	66.646	232.756	245.584

La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

BLACKROCK UCITS FUNDS

STATO PATRIMONIALE SINTETICO (continua)
Al 30 settembre 2023

	Note	BlackRock Global Equity Selection Fund		BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund		BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹	
		AI 30 settembre 2023 Migliaia di EUR	AI 31 marzo 2023 Migliaia di EUR	AI 30 settembre 2023 Migliaia di EUR	AI 31 marzo 2023 Migliaia di EUR	AI 30 settembre 2023 Migliaia di EUR	AI 31 marzo 2023 Migliaia di EUR	AI 30 settembre 2023 Migliaia di USD	AI 31 marzo 2023 Migliaia di USD
ATTIVITÀ CORRENTI									
Liquidità		24	5	83	604	799	1.142	266	149
Liquidità a margine		–	–	–	–	–	–	–	95
Crediti		11	53	133	34	30	96	–	722
Attività finanziarie al valore equo in conto economico	4	28.313	29.754	32.880	35.194	87.640	89.487	88	11.349
Totale attività correnti		28.348	29.812	33.096	35.832	88.469	90.725	354	12.315
PASSIVITÀ CORRENTI									
Scoperto bancario		–	18	–	–	–	–	–	–
Liquidità a margine esigibile		–	–	–	–	–	–	–	8
Garanzia liquida esigibile		–	–	–	–	–	–	14	34
Debiti		156	114	238	151	318	269	340	658
Accantonamento per imposte differite su plusvalenze		–	–	–	–	–	–	–	3
Passività finanziarie al valore equo in conto economico	4	–	–	225	–	764	–	–	18
Totale passività correnti		156	132	463	151	1.082	269	354	721
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	7	28.192	29.680	32.633	35.681	87.387	90.456	–	11.594

¹ Il Fondo è stato chiuso durante l'esercizio finanziario.
La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

BLACKROCK UCITS FUNDS

STATO PATRIMONIALE SINTETICO (continua)

Al 30 settembre 2023

		FR Multi-Asset Fund		BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ¹
		Al	Al	Al
		30 settembre	31 marzo	30 settembre
		2023	2023	2023
	Note	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
ATTIVITÀ CORRENTI				
Liquidità		9.194	5.170	7
Strumenti liquidi equivalenti		102	101	564
Liquidità a margine		1.107	1.755	–
Crediti		38	822	2.235
Attività finanziarie al valore equo in conto economico	4	283.552	296.279	220.821
Totale attività correnti		293.993	304.127	223.627
PASSIVITÀ CORRENTI				
Liquidità a margine esigibile		703	203	–
Debiti		295	3.000	568
Passività finanziarie al valore equo in conto economico	4	3.677	2.874	9
Totale passività correnti		4.675	6.077	577
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	7	289.318	298.050	223.050

¹Poiché il Fondo è stato lanciato durante il periodo finanziario, non sono disponibili dati comparativi. La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO

1. Informazioni di carattere generale

L'Entità è un unit trust (fondo comune d'investimento) di tipo aperto, domiciliato e costituito secondo il diritto irlandese come unit trust. L'Entità è autorizzata dalla CBI e disciplinata dalle disposizioni dei Regolamenti OICVM.

2. Politiche contabili significative

2.1 Basi di redazione

Il bilancio dell'Entità è redatto in conformità al Financial Reporting Standard 104 ("FRS 104") per la rendicontazione finanziaria infrannuale applicabile nel Regno Unito e nella Repubblica d'Irlanda. I criteri contabili e le tecniche di valutazione principali sono coerenti con quelli applicati nel precedente bilancio annuale.

I bilanci di BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund sono stati redatti senza il presupposto della continuità aziendale in quanto tale Fondo è stato chiuso durante il periodo. Il 21 marzo 2023, gli Amministratori hanno deciso di chiudere BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund con effetto dal 27 giugno 2023. Nei bilanci dei Fondi redatti senza il presupposto della continuità aziendale, le attività sono iscritte al valore recuperabile e le passività sono iscritte al valore di liquidazione contrattuale, inoltre sono inclusi i costi di liquidazione, se significativi.

Salvo diversamente indicato, tutti gli importi sono stati arrotondati alle migliaia più vicine.

3. Rischi finanziari

Le attività d'investimento espongono il Fondo a diversi tipi di rischi, associati agli strumenti finanziari e ai mercati in cui esso investe. I rischi sono sostanzialmente coerenti con quelli esposti nel precedente bilancio annuale, ad eccezione di quelli descritti di seguito.

3.1 Rischio di mercato derivante dal rischio di prezzo

Il rischio di prezzo è il rischio di fluttuazione del valore equo dei flussi di cassa futuri di uno strumento finanziario a causa di cambiamenti dei prezzi di mercato (all'infuori di quelli derivanti dal rischio del tasso d'interesse e dal rischio valutario), indipendentemente dal fatto che tali cambiamenti siano causati da fattori specifici di singoli strumenti finanziari o del suo emittente, o da altri fattori che influenzano strumenti finanziari analoghi negoziati sul mercato. Eventi locali, regionali o globali come guerre, atti di terrorismo, diffusione di malattie infettive o altri problemi di salute pubblica, recessioni o altri eventi potrebbero avere un impatto significativo su ciascun Fondo e sul prezzo di mercato dei suoi investimenti.

4. Gerarchia del valore equo

Ogni Fondo classifica gli strumenti finanziari misurati al valore equo utilizzando una gerarchia del valore equo. La gerarchia del valore equo comprende le seguenti categorie:

Livello 1: Il prezzo quotato non rettificato in un mercato attivo per attività o passività identiche alle quali l'entità può accedere alla data di misurazione.

Livello 2: Input diversi dai prezzi quotati inclusi nel livello 1 che sono osservabili (ossia sviluppati utilizzando dati di mercato) per l'attività o passività, direttamente o indirettamente. Questa categoria comprende strumenti valutati utilizzando: prezzi quotati in mercati attivi per strumenti simili; prezzi quotati per strumenti identici o simili in mercati che sono considerati meno che attivi; oppure altre tecniche di valutazione in cui tutti i dati significativi sono osservabili, direttamente o indirettamente, a partire da dati di mercato.

Livello 3: Gli input non sono osservabili (ossia non dispongono di dati di mercato) per l'attività o passività. Questa categoria comprende tutti gli strumenti in cui le tecniche di valutazione utilizzate includono dati non basati sui dati di mercato, i quali potrebbero avere un impatto significativo sulla valutazione dello strumento. Questa categoria comprende inoltre strumenti che sono stimati in base ai prezzi quotati per strumenti simili dove sono necessarie correzioni o ipotesi significative determinate dall'entità per rispecchiare le differenze tra gli strumenti e gli strumenti per i quali non esiste alcun mercato attivo.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

4. Gerarchia del valore equo (continua)

Le tecniche di valutazione specifiche utilizzate per valutare gli strumenti finanziari classificati come livello 2 e/o livello 3 includono:

- (i) per gli strumenti di debito e di capitale, l'uso di prezzi quotati di mercato o di quotazioni di operatori per strumenti simili;
- (ii) gli investimenti che rappresentano una quota di partecipazione in un organismo di investimento collettivo ("OIC") partecipato e gli investimenti in fondi negoziati in borsa ("ETF"), laddove il Fondo tipicamente negozia le quote detenute all'ultimo NAV per quell'ETF, sono stimati al NAV non certificato e, se disponibile, al NAV certificato da un'entità indipendente, alla data di valutazione di tale quota di partecipazione calcolata dall'agente amministrativo dell'OIC partecipato e dell'ETF e in conformità ai requisiti dell'organismo di cui l'investimento pertinente costituisce una quota di partecipazione. Il NAV non certificato dell'OIC e dell'ETF partecipati sottostanti viene riportato al lordo di ogni costo di rimborso potenzialmente imputabile al momento del rimborso da tali OIC ed ETF sottostanti. Il NAV non certificato dell'OIC e dell'ETF partecipati sottostanti può essere soggetto a rettifiche al momento dell'emissione dei rispettivi bilanci certificati in modo indipendente e tali rettifiche possono essere rilevanti per il bilancio del Fondo;
- (iii) per le azioni estere, utilizzando fattori di aggiustamento del valore equo indipendenti per riflettere la differenza tra l'ultima chiusura di mercato e il momento di valutazione del Fondo;
- (iv) per gli strumenti di debito insoluti, l'uso di transazioni recenti e strumenti azionari in default per i quali non sono disponibili dati di mercato;
- (v) per gli swap su tassi d'interesse, il valore attuale dei flussi di cassa futuri stimati sulla base di curve di rendimento osservabili;
- (vi) per i total return swap, il valore dei flussi di cassa stimati sulla base del valore di mercato dell'attività o dell'indice di riferimento sottostante alla data del bilancio;
- (vii) per gli swap sull'inflazione, il valore attuale dei flussi di cassa futuri stimati sulla base di curve di rendimento osservabili. Alcuni swap sull'inflazione con cedola zero possono essere valutati utilizzando una sola quotazione fornita dalla controparte swap, laddove il modello e gli input non siano osservabili dal mercato;
- (viii) per i contratti a termine in valuta estera, il valore attuale dei flussi di cassa futuri sulla base dei tassi di cambio a termine alla data del bilancio;
- (ix) per impegni SPAC PIPE, l'utilizzo di prezzi di mercato quotati sottostanti e l'applicazione di sconti per assenza di commerciabilità, volatilità e probabilità di negoziazione;
- (x) per le opzioni in valuta estera, i modelli di prezzo delle opzioni; e
- (xi) per altri strumenti finanziari, analisi dei flussi di cassa scontati.

Tutte le stime del valore equo risultanti sono incluse nel livello 2, ad eccezione dei titoli azionari non quotati, di un corrispettivo potenziale da ricevere e di alcuni contratti derivati, dove i valori equi sono stati determinati sulla base di valori attuali e i tassi di sconto utilizzati non erano osservabili dal mercato ovvero sono stati corretti per il rischio di credito proprio o della controparte, mentre alcuni OIC che impongono barriere o restrizioni di rimborso o che non possono essere riscattati entro 90 giorni sono inclusi nel livello 3.

Il livello nella gerarchia del valore equo a cui è riconducibile la misurazione del valore equo nella sua interezza deve essere determinato in base ai dati del livello più basso che sono rilevanti per determinare il valore equo nella sua interezza. A tale scopo, il significato di un dato viene valutato in rapporto alla misurazione del valore di equilibrio nella sua interezza. Se una misurazione del valore equo utilizza dati osservabili che richiedono una rettifica rilevante secondo dati non osservabili, tale misurazione è ricompresa nel Livello 3. La stima dell'importanza di un dato specifico relativamente alla misurazione del valore equo nella sua totalità richiede un giudizio che tenga conto di fattori specifici dell'attività o della passività.

La determinazione di ciò che rende un dato "osservabile" richiede un giudizio di notevole difficoltà. Gli Amministratori considerano input osservabili i dati di mercato che sono prontamente disponibili, regolarmente distribuiti o aggiornati e verificabili, non proprietari, e forniti da fonti indipendenti che sono attivamente impegnate nel mercato di riferimento.

Le tabelle seguenti forniscono un'analisi delle attività e passività finanziarie di ogni Fondo, misurate al valore equo al 30 settembre 2023 e al 31 marzo 2023:

30 settembre 2023	Livello 1	Livello 2	Livello 3	Totale
BlackRock Cangiante Global Index Equity Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	48.321	–	48.321
ETF	–	106.998	–	106.998
Totale	–	155.319	–	155.319
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	486.043	–	486.043
Utili non realizzati su contratti future	14	–	–	14
Totale	14	486.043	–	486.057
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	10.279	–	10.279
Totale	–	10.279	–	10.279
BlackRock UK Credit Screened Fund	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	98.000	–	98.000
Totale	–	98.000	–	98.000

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

4. Gerarchia del valore equo (continua)

30 settembre 2023 (continua)	Livello 1	Livello 2	Livello 3	Totale
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	74.005	–	74.005
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	1	–	1
Totale	–	74.006	–	74.006
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(115)	–	(115)
Perdite non realizzate su contratti future	(27)	–	–	(27)
Totale	(27)	(115)	–	(142)
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	91.848	–	91.848
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	1.462	–	1.462
Totale	–	93.310	–	93.310
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(2.848)	–	(2.848)
Totale	–	(2.848)	–	(2.848)
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	37.266	–	37.266
ETF	28.650	–	–	28.650
Totale	28.650	37.266	–	65.916
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Azioni	218.141	–	–	218.141
Obbligazioni	–	10.260	–	10.260
Utili non realizzati su contratti per differenze	–	85	–	85
Totale	218.141	10.345	–	228.486
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti per differenze	–	(577)	–	(577)
Perdite non realizzate su contratti future	(143)	–	–	(143)
Totale	(143)	(577)	–	(720)
BlackRock Global Equity Selection Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	19.334	–	19.334
ETF	8.979	–	–	8.979
Totale	8.979	19.334	–	28.313
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	22.031	–	22.031
ETF	10.793	–	–	10.793
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	56	–	56
Totale	10.793	22.087	–	32.880
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(225)	–	(225)
Totale	–	(225)	–	(225)
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	48.506	–	48.506
ETF	38.084	–	–	38.084
Materie prime negoziate in borsa	861	–	–	861
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	189	–	189
Totale	38.945	48.695	–	87.640
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(764)	–	(764)
Totale	–	(764)	–	(764)
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund1	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Azioni	88	–	–	88
Totale	88	–	–	88

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

4. Gerarchia del valore equo (continua)

30 settembre 2023 (continua)	Livello 1	Livello 2	Livello 3	Totale
FR Multi-Asset Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	157.857	–	157.857
ETF	117.055	–	–	117.055
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	7.834	–	7.834
Utili non realizzati su contratti future	806	–	–	806
Totale	117.861	165.691	–	283.552
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(3.303)	–	(3.303)
Perdite non realizzate su contratti future	(374)	–	–	(374)
Totale	(374)	(3.303)	–	(3.677)
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026²	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	220.764	–	220.764
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	57	–	57
Totale	–	220.821	–	220.821
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(9)	–	(9)
Totale	–	(9)	–	(9)
¹ Il Fondo è stato chiuso durante l'esercizio finanziario.				
² Poiché il Fondo è stato lanciato durante il periodo finanziario, non sono disponibili dati comparativi.				
31 marzo 2023	Livello 1	Livello 2	Livello 3	Totale
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	46.687	–	46.687
ETF	–	100.460	–	100.460
Totale	–	147.147	–	147.147
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	495.908	–	495.908
Totale	–	495.908	–	495.908
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti future	(122)	–	–	(122)
Totale	(122)	–	–	(122)
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	79.517	–	79.517
Totale	–	79.517	–	79.517
BlackRock UK Credit Screened Fund	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	122.365	–	122.365
Totale	–	122.365	–	122.365
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	81.346	–	81.346
Totale	–	81.346	–	81.346
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(125)	–	(125)
Totale	–	(125)	–	(125)
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	94.880	–	94.880
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	1.389	–	1.389
Totale	–	96.269	–	96.268
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(679)	–	(679)
Totale	–	(679)	–	(679)
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	37.383	–	37.383
ETF	–	29.116	–	29.116
Totale	–	66.499	–	66.499

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

4. Gerarchia del valore equo (continua)

31 marzo 2023 (continua)	Livello 1	Livello 2	Livello 3	Totale
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Azioni	223.261	–	–	223.261
Obbligazioni	–	19.131	–	19.131
Utili non realizzati su contratti per differenze	–	349	–	349
Utili non realizzati su contratti future	208	–	–	208
Totale	223.469	19.480	–	242.949
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti per differenze	–	(475)	–	(475)
Totale	–	(475)	–	(475)
BlackRock Global Equity Selection Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	20.300	–	20.300
ETF	9.454	–	–	9.454
Totale	9.454	20.300	–	29.754
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	23.297	–	23.297
ETF	11.798	–	–	11.798
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	99	–	99
Totale	11.798	23.396	–	35.194
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	49.456	–	49.456
ETF	38.623	–	–	38.623
Materie prime negoziate in borsa	992	–	–	992
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	416	–	416
Totale	39.615	49.872	–	89.487
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Azioni	9.035	227	5	9.267
Obbligazioni	–	2.025	–	2.025
Utili non realizzati su contratti per differenze	–	35	–	35
Utili non realizzati su contratti future	22	–	–	22
Totale	9.057	2.287	5	11.349
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti per differenze	–	(18)	–	(18)
Totale	–	(18)	–	(18)
FR Multi-Asset Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	164.006	–	164.006
ETF	126.595	–	–	126.595
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	4.850	–	4.850
Utili non realizzati su contratti future	828	–	–	828
Totale	127.423	168.856	–	296.279
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(1.980)	–	(1.980)
Perdite non realizzate su contratti future	(894)	–	–	(894)
Totale	(894)	(1.980)	–	(2.874)

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

5. Distribuzioni ai sottoscrittori di quote rimborsabili

L'Entità può dichiarare e pagare dividendi su qualsiasi classe di quote di distribuzione nell'Entità. In conformità al prospetto, qualsiasi dividendo che non sia stato riscosso entro dodici anni dalla data della sua dichiarazione sarà incamerato e cesserà di essere dovuto dall'Entità agli investitori e diventerà proprietà del Fondo di riferimento.

Nel corso del periodo finanziario sono state dichiarate le seguenti distribuzioni:

	BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ¹		
	BlackRock Diversifying Fixed Income Fund		
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023
	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Maggio	–	(107)	–
Settembre	–	–	(232)
Distribuzioni dichiarate			
Reddito di perequazione	–	(18)	–
Totale	–	(125)	(232)

¹Poiché il Fondo è stato lanciato durante il periodo finanziario, non sono disponibili dati comparativi.

6. Tassazione

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

	BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022
	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di USD
Imposte correnti				
Ritenuta d'acconto sui redditi esteri non recuperabile	–	(1)	(2)	(9)
				(37)
				(539)
				(772)
Imposte differite				
Accantonamento per imposte differite su plusvalenze estere	–	–	–	–
				(237)
Totale imposte	–	(1)	(2)	(9)
				(37)
				(776)
				(772)

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

6. Tassazione (continua)

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund¹	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2023 Migliaia di USD	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022 Migliaia di USD
Imposte correnti		
Ritenute d'acconto sui redditi estere non recuperabili	(2)	(316)
Imposte differite		
Accantonamento per imposte differite su plusvalenze estere	3	-
Totale imposte	1	(316)

Il Fondo è stato chiuso durante l'esercizio finanziario.

¹ Imposta irlandese

Ai sensi della legislazione e della prassi vigente, l'Entità si qualifica come un organismo di investimento secondo la definizione della Sezione 739B del Taxes Consolidation Act del 1997 e successive modifiche. Su questa base, non è soggetta all'imposta irlandese sui redditi o sulle plusvalenze. Tuttavia, l'imposizione fiscale irlandese può insorgere al verificarsi di un "evento imponibile". Gli eventi imponibili includono ogni distribuzione a favore dei sottoscrittori di quote nonché ogni incasso, rimborso, cancellazione o trasferimento di quote e la detenzione di quote al termine di ciascun periodo di otto anni a partire dall'acquisizione di tali quote.

L'Entità non è soggetta a imposizione fiscale irlandese in relazione a eventi imponibili riguardanti:

- un sottoscrittore che non è residente in Irlanda o che non risiede di norma in Irlanda a fini fiscali, al momento dell'evento tassabile, a condizione che l'Entità detenga le relative dichiarazioni valide in conformità con il Taxes Consolidation Act del 1997, e successive modifiche; o un'Entità che sia stata autorizzata dalle autorità fiscali irlandesi ad effettuare pagamenti lordi in assenza di dichiarazioni appropriate; e
- taluni sottoscrittori esenti, residenti in Irlanda a fini fiscali, che abbiano fornito all'Entità le dichiarazioni annuali firmate, richieste ai sensi di legge.

Imposte estere

I dividendi, gli interessi e le plusvalenze (eventuali) ricevuti sugli investimenti operati dall'Entità possono essere soggetti a trattenute d'imposta nel paese in cui detto reddito da investimento o plusvalenze sono ricevuti e tali imposte possono non essere recuperabili dall'Entità o dai suoi sottoscrittori.

Ai fini dell'informativa finanziaria, e in conformità con l'FRS 104, l'Entità deve rilevare in bilancio un fondo imposte differite derivanti da differenze temporanee significative tra la tassazione delle plusvalenze non realizzate e i redditi imponibili effettivi realizzabili.

7. Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili

Al 30 settembre 2023

	AI 30 settembre 2023	AI 31 marzo 2023	AI 31 marzo 2022
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund			
- Classe di quote istituzionali a distribuzione			
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	155.120	147.003
Quote in circolazione		16.209.504	16.209.504
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	9,57	9,07
BlackRock UK Credit Screened Fund			
Classe di quote ad accumulazione flessibile			
Valore patrimoniale netto	Migliaia di GBP	99.809	124.726
Quote in circolazione		6.525.881	8.083.166
Valore patrimoniale netto per quota	GBP	15,29	15,43
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund			
Classe D ad accumulazione			
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	17.309	17.204
Quote in circolazione		1.712.451	1.732.573
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,11	9,93
Classe D coperta ad accumulazione in CHF			
Valore patrimoniale netto	Migliaia di CHF	1.428	1.757
Quote in circolazione		146.309	181.309
Valore patrimoniale netto per quota	CHF	9,76	9,69
Classe D a distribuzione			
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	2.988	2.641
Quote in circolazione		332.240	298.890
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	8,99	8,84

NMI P230-3256239-36/201

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

7. Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili (continua)

		AI 30 settembre 2023	AI 31 marzo 2023	AI 31 marzo 2022
Blackrock Defensive Yield ESG Screened Fund (continua)				
Classe Z ad accumulazione				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	47.482	53.099	58.435
Quote in circolazione		4.681.957	5.330.953	5.706.066
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,14	9,96	10,24
Classe Z coperta ad accumulazione in CHF				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di CHF	5.991	9.257	10.038
Quote in circolazione		612.267	953.267	997.099
Valore patrimoniale netto per quota	CHF	9,78	9,71	10,07
Classe di quote ad accumulazione flessibile				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	5	5	5
Quote in circolazione		482	482	482
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,24	10,05	10,32
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund				
EUR - Classe di quote ad accumulazione flessibile				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	2.291	2.360	2.530
Quote in circolazione		233.040	233.040	233.040
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	9,83	10,13	10,86
EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	91.649	94.453	101.420
Quote in circolazione		10.634.678	10.634.678	10.634.678
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	8,62	8,88	9,54
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund				
Classe D ad accumulazione				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di USD	1	1	1
Quote in circolazione		100	100	100
Valore patrimoniale netto per quota	USD	9,92	10,18	11,36
Classe Z ad accumulazione				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di USD	156.940	160.971	179.331
Quote in circolazione		16.007.366	16.007.366	16.007.366
Valore patrimoniale netto per quota	USD	9,80	10,06	11,20
Classe di quote ad accumulazione flessibile				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di USD	75.814	76.784	86.782
Quote in circolazione		7.470.746	7.398.968	7.551.375
Valore patrimoniale netto per quota	USD	10,15	10,38	11,49
Classe di quote istituzionali ad accumulazione				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di USD	1	7.828	118.619
Quote in circolazione		100	779.556	10.581.890
Valore patrimoniale netto per quota	USD	9,79	10,04	11,21
BlackRock Global Equity Selection Fund				
Classe A ad accumulazione				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	828	2.347	2.931
Quote in circolazione		54.960	159.977	191.556
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	15,07	14,67	15,30
Classe D ad accumulazione				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	10.472	10.141	11.613
Quote in circolazione		582.449	582.600	646.717
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	17,98	17,41	17,96
Classe E ad accumulazione				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	16.892	17.192	19.011
Quote in circolazione		1.045.699	1.092.429	1.156.349
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	16,15	15,74	16,44
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund				
Classe D ad accumulazione				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	8.164	8.964	11.052
Quote in circolazione		690.596	755.868	874.575
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	11,82	11,86	12,64
Classe E ad accumulazione				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	24.469	26.717	31.266
Quote in circolazione		2.277.565	2.464.626	2.675.831
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,74	10,84	11,68
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund				
Classe A ad accumulazione				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	697	877	1.210

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

7. Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili (continua)

		AI 30 settembre 2023	AI 31 marzo 2023	AI 31 marzo 2022
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund (continua)				
Classe A ad accumulazione (continua)				
Quote in circolazione		67.905	84.695	109.311
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,26	10,35	11,07
Classe D ad accumulazione				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	49.870	50.994	47.122
Quote in circolazione		4.489.454	4.570.717	3.987.951
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	11,11	11,16	11,82
Classe E ad accumulazione				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	36.815	38.580	39.273
Quote in circolazione		3.594.729	3.732.351	3.551.738
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,24	10,34	11,06
Classe di quote ad accumulazione flessibile¹				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	5	5	-
Quote in circolazione		475	475	-
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,21	10,24	-
FR Multi-Asset Fund				
Istituzionale ad accumulazione in EUR¹				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	34.805	34.578	-
Quote in circolazione		3.447.973	3.455.554	-
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,09	10,01	-
Istituzionale coperta ad accumulazione in SEK¹				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di SEK	2.176.598	2.264.352	-
Quote in circolazione		21.572.031	22.657.655	-
Valore patrimoniale netto per quota	SEK	100,90	99,94	-
Istituzionale coperta ad accumulazione in USD¹				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di USD	69.119	67.884	-
Quote in circolazione		6.501.463	6.501.463	-
Valore patrimoniale netto per quota	USD	10,63	10,44	-
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026²				
Classe C coperta ad accumulazione in CHF³				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di CHF	171	-	-
Quote in circolazione		17.049	-	-
Valore patrimoniale netto per quota	CHF	10,04	-	-
Classe C coperta a distribuzione in CHF³				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di CHF	421	-	-
Quote in circolazione		42.009	-	-
Valore patrimoniale netto per quota	CHF	10,01	-	-
Classe C ad accumulazione in EUR³				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	791	-	-
Quote in circolazione		78.149	-	-
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,13	-	-
Classe C a distribuzione in EUR³				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	7.218	-	-
Quote in circolazione		714.709	-	-
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,10	-	-
Classe C coperta ad accumulazione in USD³				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di USD	2.376	-	-
Quote in circolazione		233.093	-	-
Valore patrimoniale netto per quota	USD	10,19	-	-
Classe C coperta a distribuzione in USD³				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di USD	2.445	-	-
Quote in circolazione		240.581	-	-
Valore patrimoniale netto per quota	USD	10,16	-	-
Classe D ad accumulazione in EUR³				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	10.477	-	-
Quote in circolazione		1.033.190	-	-
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,14	-	-
Classe D a distribuzione in EUR³				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	4.214	-	-
Quote in circolazione		417.200	-	-
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,10	-	-

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

7. Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili (continua)

		AI 30 settembre 2023	AI 31 marzo 2023	AI 31 marzo 2022
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026²(continua)				
Classe E ad accumulazione in EUR³				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	111.222	-	-
Quote in circolazione		10.983.744	-	-
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,13	-	-
Classe E a distribuzione in EUR³				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	83.963	-	-
Quote in circolazione		8.310.543	-	-
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,10	-	-

¹ Poiché la classe di quote è stata lanciata durante il periodo finanziario precedente, non sono disponibili dati comparativi per l'esercizio finanziario chiuso al 31 marzo 2022.

² Poiché il Fondo è stato lanciato durante il periodo finanziario, non sono disponibili dati comparativi.

³ Poiché la classe di quote è stata lanciata durante il periodo finanziario, non sono disponibili dati comparativi.

	AI 30 settembre 2023	AI 31 marzo 2023	AI 31 marzo 2022
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1			
Migliaia di EUR			
Valore patrimoniale netto			
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104	493.312	500.760	491.376
Rettifiche effettuate per:			
- Costi di costituzione	4	4	4
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto	493.316	500.764	491.380

N. di quote in circolazione			
EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	49.789.793	50.909.999	46.169.540
Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104			
EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	EUR 9,91	EUR 9,84	EUR 10,64
Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto			
EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	EUR 9,91	EUR 9,84	EUR 10,64

	AI 30 settembre 2023	AI 31 marzo 2023	AI 31 marzo 2022
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1			
Migliaia di EUR			
Valore patrimoniale netto			
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104	10.316	80.280	151.866
Rettifiche effettuate per:			
- Costi di costituzione	4	4	4
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto	10.320	80.284	151.870

N. di quote in circolazione			
EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	1.119.860	8.489.005	14.152.817
Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104			
EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	EUR 9,21	EUR 9,46	EUR 10,73
Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto			
EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	EUR 9,22	EUR 9,46	EUR 10,73

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

7. Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili (continua)

BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	Al 30 settembre 2023	Al 31 marzo 2023	Al 31 marzo 2022
	Migliaia di EUR		
Valore patrimoniale netto			
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104	66.397	66.636	90.051
Rettifiche effettuate per:			
- Costi di costituzione	7	10	16
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto	66.404	66.646	90.067
N. di quote in circolazione			
Classe di quote istituzionali 1 a distribuzione	7.050.651	7.050.651	7.050.651
Classe di quote istituzionali 2 a distribuzione	504.460	504.460	2.498.501
Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104			
Classe di quote istituzionali 1 a distribuzione	EUR 8,78	EUR 8,82	EUR 9,41
Classe di quote istituzionali 2 a distribuzione	EUR 8,84	EUR 8,88	EUR 9,48
Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto			
Classe di quote istituzionali 1 a distribuzione	EUR 8,79	EUR 8,82	EUR 9,42
Classe di quote istituzionali 2 a distribuzione	EUR 8,84	EUR 8,88	EUR 9,48

BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund¹	Al 30 settembre 2023	Al 31 marzo 2023	Al 31 marzo 2022
	Migliaia di USD		
Valore patrimoniale netto			
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104	-	11.594	270.120
Rettifiche effettuate per:			
- Costi di costituzione	-	-	8
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto	-	11.594	270.128
N. di quote in circolazione			
Classe A ad accumulazione ²	-	100	100
Classe di quote ad accumulazione flessibile ²	-	1.225.941	25.184.855
Classe di quote ad accumulazione flessibile in NZD ²	-	810	-
Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104			
Classe A ad accumulazione ²	-	USD 9,18	USD 10,49
Classe di quote ad accumulazione flessibile ²	-	USD 9,45	USD 10,73
Classe di quote ad accumulazione flessibile in NZD ²	-	NZD 10,15	-
Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto			
Classe A ad accumulazione ²	-	USD 9,18	USD 10,49
Classe di quote ad accumulazione flessibile ²	-	USD 9,45	USD 10,73
Classe di quote ad accumulazione flessibile in NZD ²	-	NZD 10,15	-

¹ Il Fondo è stato chiuso durante l'esercizio finanziario.

² La classe di quote è stata chiusa durante il periodo finanziario.

8. Tassi di cambio

In data 30 settembre 2023 e 31 marzo 2023 i tassi di cambio in vigore erano i seguenti:

	30 settembre 2023	31 marzo 2023
EUR = 1		
AUD	1,6405	1,6222
CAD	1,4314	1,4703
CHF	0,9685	0,9925

NMI123U-3256239-40/201

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

8. Tassi di cambio (continua)

	30 settembre 2023	31 marzo 2023
EUR = 1 (continua)		
CLP	945,8343	858,9582
CNY	7,7138	7,4610
COP	4.283,6655	5.062,1073
CZK	24,3555	23,4770
DKK	7,4570	7,4493
GBP	0,8674	0,8787
HKD	8,2920	8,5286
HUF	388,3250	380,3501
IDR	16.362,9813	16.290,7743
ILS	4,0307	3,9119
JPY	157,9920	144,5956
KRW	1.428,6773	1.414,3949
MXN	18,3995	19,6169
MYR	4,9711	4,7940
NOK	11,2660	11,3785
NZD	1,7621	1,7365
PEN	4,0146	4,0862
PLN	4,6215	4,6805
RON	4,9740	4,9474
RUB	103,3340	84,4172
SEK	11,5025	11,2660
SGD	1,4451	1,4445
THB	38,5517	37,1512
USD	1,0588	1,0864
ZAR	19,9462	19,2763
GBP = 1		
EUR	1,1528	1,1381
USD = 1		
AED	3,6731	3,6725
BRL	5,0052	5,0703
CLP	893,3500	790,6100
CNH	7,2858	6,8673
CNY	7,2858	6,8673
CZK	23,0040	21,6089
EUR	0,9445	0,9204
GBP	0,8193	0,8088
HKD	7,8319	7,8500
HUF	366,7769	350,0852
IDR	15.455,0000	14.994,5000
INR	83,0413	82,1825
KRW	1.349,4000	1.301,8500
KWD	0,3091	0,3069
MXN	17,3785	18,0560
MYR	4,6953	4,4125
NZD	1,6643	1,5983
PHP	56,5760	54,3650
PLN	4,3651	4,3081
QAR	3,6460	3,6711
RUB	97,6000	77,7000
SAR	3,7505	3,7537
THB	36,4125	34,1950
TRY	27,4150	19,1950
TWD	32,2805	30,4475
ZAR	18,8394	17,7425

9. Operazioni con parti correlate

Le parti sono considerate correlate se, nell'assunzione di decisioni di natura finanziaria o operativa, una di esse è in grado di controllare la controparte o di esercitare su di essa un'influenza significativa.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

9. Operazioni con parti correlate (continua)

Le seguenti entità erano parti correlate dell'Entità durante il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023:

Gestore:	BlackRock Asset Management Ireland Limited
Gestore degli Investimenti, Promotore, Distributore e Agente per il prestito titoli:	BlackRock Advisors (UK) Limited
Subgestori degli investimenti:	BlackRock Financial Management, Inc. BlackRock Institutional Trust Company, N.A. BlackRock Investment Management (UK) Limited BlackRock (Singapore) Limited
Agente incaricato dei pagamenti in Svezia:	BlackRock Investment Management (UK) Limited
Rappresentante in Danimarca:	BlackRock Copenhagen Branch
Rappresentante in Svizzera:	BlackRock Asset Management Schweiz AG

La capogruppo del Gestore, Gestore degli Investimenti, Promotore, Distributore, Agente per il prestito titoli, Subgestore degli investimenti, Agente incaricato dei pagamenti in Svezia e Rappresentante in Danimarca e Svizzera è BlackRock Inc., una società costituita nel Delaware (Stati Uniti).

Il Gestore degli investimenti ha subdelegato alcune funzioni di gestione del portafoglio ai Subgestori degli investimenti indicati nella tabella seguente:

Nome del Fondo	Subgestori degli investimenti
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	BlackRock (Singapore) Limited
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	BlackRock Institutional Trust Company, N.A.
BlackRock Global Equity Selection Fund	BlackRock Institutional Trust Company, N.A.
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	BlackRock Institutional Trust Company, N.A.
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	BlackRock Institutional Trust Company, N.A.
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	BlackRock Financial Management, Inc.

Il Gestore degli investimenti farà in modo che le commissioni e le spese dei Subgestori degli investimenti siano pagate a valere sulle commissioni proprie del Gestore degli Investimenti.

Nella tabella seguente sono indicati gli Amministratori al 30 settembre 2023:

Amministratori	Dipendenti del Gruppo BlackRock	Amministratore delle consociate BlackRock e/o di altri fondi gestiti da BlackRock
Rosemary Quinlan	No	No
Graham Bamping	No	Sì
Patrick Boylan	Sì	Sì
Maria Ging	Sì	Sì
Michael Hodson	No	No
Enda McMahon	Sì	Sì
Justin Mealy	Sì	No
Adele Spillane	No	No
Catherine Woods	No	No

Gli Amministratori che sono anche dipendenti del Gruppo BlackRock non hanno diritto a percepire i

compensi per gli Amministratori. L'Entità rimborsa al Gestore la quota di compensi corrisposti agli

Amministratori per suo conto.

Partecipazioni in altri Fondi gestiti da BlackRock/affiliate di BlackRock

Gli investimenti in fondi gestiti da BlackRock, Inc. e gli investimenti che sono affiliati di BlackRock sono elencati di seguito e riportati nei prospetti degli investimenti dei Fondi pertinenti. Le commissioni di gestione o di performance degli investimenti, per i fondi sottostanti che le prevedono, sono state rimborsate al Fondo.

L'Entità è investita nei seguenti fondi che sono gestiti anche dal Gestore. Nella tabella di seguito vengono fornite ulteriori informazioni sulle commissioni addebitate a seguito dell'investimento in detti fondi sottostanti. Queste commissioni comunicate sono le commissioni massime ai sensi del prospetto dei Fondi sottostanti e le effettive commissioni addebitate possono essere inferiori:

Investimenti	Commissione pagata dal Fondo
ICAV - OICVM autorizzato in Irlanda da CBI	
BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Classe X EUR Accumulating	N.d. ¹
BlackRock Funds I ICAV - BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund - Classe X USD Accumulating	N.d. ¹
BlackRock Global High Yield ESG e Credit Screened Fund - Classe Z EUR Hedged Accumulating	Spesa annua massima pari allo 0,30% del NAV ¹
BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	N.d. ¹
BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating	N.d. ¹
BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating	N.d. ¹
BlackRock Sustainable Equity Factor Plus Fund - Classe X EUR Accumulating	N.d. ¹

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

9. Operazioni con parti correlate (continua)

Partecipazioni in altri Fondi gestiti da BlackRock/affiliate BlackRock (continua)

Investimenti	Commissione pagata dal Fondo
BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	N.d. ¹
Società d'investimento - OICVM autorizzato in Germania dall'Autorità federale di vigilanza finanziaria (BaFin)	
iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF (DE)	Spesa annua massima pari allo 0,46% del NAV ¹
Società d'investimento - OICVM autorizzato in Irlanda da CBI	
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc TO)	Spesa annua massima pari allo 0,03% del NAV ²
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Dis)	Spesa annua massima pari allo 0,03% del NAV ²
iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	Spesa annua massima pari allo 1,00% del NAV ¹
iShares \$ TIPS UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	Spesa annua massima pari allo 1,00% del NAV ¹
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	Spesa annua massima pari allo 1,00% del NAV ¹
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	Spesa annua massima pari allo 1,00% del NAV ¹
iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,07% del NAV ¹
iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	Spesa annua massima pari allo 1,00% del NAV ¹
iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,07% del NAV ¹
iShares € Govt Bond 15-30yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,15% del NAV ¹
iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,09% del NAV ¹
iShares € High Yield Corp Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,50% del NAV ¹
iShares € Inflation Linked Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,25% del NAV ¹
iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,09% del NAV ¹
iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	Spesa annua massima pari allo 1,00% del NAV ¹
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF - Classe di Azioni GBP (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,07% del NAV ¹
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,20% del NAV ¹
iShares Core S&P 500 UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,07% del NAV ¹
iShares Core UK Gilts UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	Spesa annua massima pari allo 1,00% del NAV ¹
iShares Developed World ESG Screened Index Fund (IE) - Classe di Azioni US Dollar Flexible Accumulating	Spesa annua massima pari allo 0,30% del NAV ³
iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,19% del NAV ¹
iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,25% del NAV ¹
iShares Edge MSCI USA Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,20% del NAV ¹
iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,30% del NAV ¹
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni Flexible Euro Hedged Accumulating	N.d. ⁴
iShares Emerging Markets Index Fund (IE) - Classe di Azioni Euro Flexible Accumulating	Spesa annua massima pari allo 0,30% del NAV ³
iShares ESG Screened Euro Corporate Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni Flexible Euro Accumulating	N.d. ⁴
iShares ESG Screened Global Corporate Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni D EUR Hedged Accumulating	Spesa annua massima pari allo 0,35% del NAV ⁴
iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	Spesa annua massima pari allo 1,00% del NAV ¹
iShares Green Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni Flexible EUR Hedged Accumulating	N.d. ⁵
iShares J.P. Morgan \$ EM Corp Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	Spesa annua massima pari allo 1,00% del NAV ¹
iShares MSCI Canada UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,48% del NAV ¹
iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,23% del NAV ¹
iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,15% del NAV ¹
iShares MSCI Europe ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,12% del NAV ¹
iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,20% del NAV ¹
iShares MSCI Japan ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,15% del NAV ¹
iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,60% del NAV ¹
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,10% del NAV ¹
iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,07% del NAV ¹
iShares MSCI USA Value Factor ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,20% del NAV ¹
iShares MSCI World ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,20% del NAV ¹
iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,25% del NAV ¹
iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,30% del NAV ¹
iShares Pacific Index Fund (IE) - Classe di Azioni US Dollar Flexible Accumulating	Spesa annua massima pari allo 0,30% del NAV ³
iShares Physical Gold ETC	Spesa annua massima pari allo 0,12% del NAV ¹
iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	Spesa annua massima pari allo 1,00% del NAV ¹
Società d'investimento - OICVM autorizzata in Lussemburgo dalla Commission de Surveillance du Secteur Financier	
BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD Hedged	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Classe X2 EUR	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 EUR	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - European Fund - Classe X2 EUR	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - European Special Situations Fund - Classe X2 EUR	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - Global Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - Global Inflation Linked Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe di Azioni X2 EUR Hedged	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe X2 USD	N.d. ⁶

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

9. Operazioni con parti correlate (continua)

Partecipazioni in altri Fondi gestiti da BlackRock/affiliate BlackRock (continua)

Investimenti	Commissione pagata dal Fondo
BlackRock Global Funds -Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund - Classe X2 USD	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 USD	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund - Classe X2 USD	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Opportunities Fund - Classe X2 USD	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Classe X2 EUR	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - US Basic Value Fund - Classe X2 USD	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - US Dollar Bond Fund - Classe X2 USD	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Classe X2 EUR	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Classe X2 USD	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Classe X2 USD	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Classe X2 USD	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 USD	N.d. ⁶
BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD	N.d. ⁶
BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Classe X2 EUR	N.d. ⁶
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Classe X2 USD	N.d. ⁶
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Real Asset Securities Fund - Classe X2 USD	N.d. ⁶
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 EUR	N.d. ⁶
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR	N.d. ⁶
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR	N.d. ⁶

¹ I fondi sottostanti adottano una struttura di commissioni "all in one". Ogni Fondo paga tutte le sue commissioni, costi e oneri operativi sotto forma di commissione fissa unica (TER).

² Il Gestore di questi investimenti avrà la responsabilità di liquidare, a valere sulla commissione, le spese annuali dei Fondi. Qualora le commissioni e i costi effettivi sostenuti superino l'importo pagato al Gestore, la parte in eccesso verrà pagata dal Gestore attingendo al suo patrimonio.

³ Il Gestore di tali investimenti è autorizzato ad addebitare una commissione dello 0,30% annuo. La Commissione di gestione dovuta al Gestore include esclusivamente la commissione del Gestore, dell'Agente Amministrativo e del Fiduciario.

⁴ Il Gestore di questi investimenti è autorizzato ad addebitare una commissione pari allo 0,03% annuo del NAV di ciascun fondo o classe di quota pertinente. Qualora le commissioni e i costi effettivi sostenuti superino l'importo pagato al Gestore, la parte in eccesso verrà pagata dal Gestore attingendo al suo patrimonio.

⁵ Il Gestore di questi investimenti è autorizzato ad addebitare una commissione pari allo 0,05% annuo del NAV di ciascun fondo o classe di quota pertinente. Qualora le commissioni e i costi effettivi sostenuti superino l'importo pagato al Gestore, la parte in eccesso verrà pagata dal Gestore attingendo al suo patrimonio.

⁶ Il Fondo non è soggetto a commissione di gestione per questo investimento. Tuttavia, i fondi sottostanti pagano una commissione di amministrazione alla società di gestione, BlackRock Luxembourg S.A. La commissione di amministrazione versata non supererà lo 0,25% e 0,30% annuo rispettivamente dovuti a BlackRock Global Funds e BlackRock Strategic Funds.

Tutte le transazioni con parti correlate sono state eseguite alle normali condizioni commerciali nella gestione ordinaria delle attività. Le condizioni e i rendimenti riconosciuti ai Fondi che hanno effettuato gli investimenti non sono stati più favorevoli rispetto a quelli riconosciuti ad altri investitori che hanno sottoscritto le medesime classi di quote.

La tabella precedente specifica le commissioni massime applicabili ai sensi del prospetto dei fondi sottostanti. La tabella seguente indica l'ammontare rimborsato della commissione di gestione, ricevuto nel periodo per i Fondi dell'Entità che hanno investito in fondi anch'essi gestiti dal Gestore o da una affiliata del Gestore:

Nome del Fondo	Valuta	Riduzione della commissione di gestione per il periodo chiuso il 30 settembre 2023 Migliaia	Riduzione della commissione di gestione per il periodo chiuso il 30 settembre 2022 Migliaia
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	EUR	66	48
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	EUR	77	90
BlackRock Global Equity Selection Fund	EUR	9	8
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	EUR	9	7
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	EUR	26	20
FR Multi-Asset Fund	EUR	93	4

Investitori Importanti

I seguenti investitori sono:

- fondi gestiti dal Gruppo BlackRock o sono affiliate di BlackRock Inc. ("Investitori Correlati a BlackRock") o
- investitori (diversi da quelli inclusi in (i) di cui sopra) che detengono almeno il 51% delle quote emesse per l'Entità e sono, di conseguenza, considerati parti correlate all'Entità ("Investitori Importanti").

NM1123U-3256239-44/201

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

9. Operazioni con parti correlate (continua)

Investitori Importanti (continua)

Al 30 settembre 2023

Nome del Fondo	% totale di quote detenute da Investitori Correlati a BlackRock	% totale di quote detenute da Investitori Importanti che non sono Investitori Correlati a BlackRock	Numero di Investitori Importanti che non sono Investitori Correlati a BlackRock
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	Zero	100,00	1
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	Zero	97,87	1
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	Zero	100,00	1
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	0,01	Zero	Zero
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	Zero	97,86	1
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	Zero	93,32	1
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	— ¹	68,18	1
BlackRock Global Equity Selection Fund	0,01	54,14	1
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Zero	58,59	1
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	0,01	Zero	Zero
FR Multi-Asset Fund	— ¹	Zero	Zero

Gli investimenti inferiori allo 0,005% sono stati arrotondati a zero.

¹

Al 31 marzo 2023

Nome del Fondo	% totale di quote detenute da Investitori Correlati a BlackRock	% totale di quote detenute da Investitori Importanti che non sono Investitori Correlati a BlackRock	Numero di Investitori Importanti che non sono Investitori Correlati a BlackRock
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	Zero	100,00	1
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	Zero	84,06	1
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	Zero	100,00	1
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	0,01	Zero	Zero
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	Zero	97,86	1
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	Zero	93,32	1
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	— ¹	66,18	1
BlackRock Global Equity Selection Fund	0,01	52,44	1
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Zero	58,79	1
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	0,01	Zero	Zero
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	100,00	Zero	Zero
FR Multi-Asset Fund	— ¹	Zero	Zero

¹Gli investimenti inferiori allo 0,005% sono stati arrotondati a zero.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

9. Operazioni con parti correlate (continua)

Prestito di titoli

La tabella seguente riporta il reddito da prestito titoli maturato nel periodo finanziario chiuso:

Nome del Fondo	Valuta	30 settembre 2023 Migliaia	30 settembre 2022 Migliaia
BlackRock UK Credit Screened Fund	GBP	11	11
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	EUR	16	18
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	EUR	4	3
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	EUR	36	79
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	6	12
BlackRock Global Equity Selection Fund	EUR	–	1
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	USD	–	6

Non è stato effettuato alcun accantonamento da parte dei Fondi a fronte degli importi dovuti dalle parti correlate alla data di fine periodo finanziario (31 marzo 2023: nessuno).

Nessun importo è stato svalutato durante il periodo finanziario relativamente agli importi dovuti alle o dalle parti correlate (31 marzo 2023: nessuno).

Non è stato preso alcun impegno garantito o non garantito, né è stata stipulata alcuna garanzia con le parti correlate durante il periodo finanziario (31 marzo 2023: nessuno).

10. Linea di credito

Il Fondo ha ottenuto una linea di credito presso JPMorgan in virtù della quale JPMorgan, insieme ad altri finanziatori sindacati, ha messo a sua disposizione una quota della linea di credito di USD 450.000.000. La quota della linea di credito di USD 450.000.000 sarà assegnata al Fondo in base al contratto di credito datato 21 aprile 2023. Tale linea di credito sarà utilizzata dai Fondi a scopo di finanziamento temporaneo, tra cui, a titolo esemplificativo e non esaustivo, il finanziamento dei rimborsi agli investitori. Eventuali interessi e commissioni di impegno sugli impieghi di tale linea di credito saranno pagati a valere sul patrimonio del Fondo. Qualsiasi nuovo Fondo non sarà automaticamente soggetto a una linea di credito e dovrà quindi essere aggiunto tramite un processo di adesione. Questo processo include, fra l'altro, la necessaria due diligence da parte dei finanziatori per approvare l'aggiunta dei nuovi Fondi. Durante questo periodo, tali Fondi non rientreranno in, né potranno attingere ad, alcuna linea di credito. Inoltre, non vi è alcuna garanzia che l'aggiunta di un nuovo Fondo sia approvata dai finanziatori o che il credito sia disponibile per un Fondo, poiché la linea di credito è soggetta alla disponibilità (su base equa) tra il Fondo e altri Fondi BlackRock che partecipano al contratto di credito. Pertanto, alcuni Fondi possono non rientrare nella linea di credito e non incorrere in alcuna commissione rispetto alla stessa.

In relazione a questa linea di credito viene addebitata su base giornaliera una commissione d'impegno di finanziamento, che è inclusa nel conto economico alla voce "Commissione di amministrazione del contratto di credito". La commissione di impegno di finanziamento addebitata è pari allo 0,10% del saldo giornaliero dovuto.

La linea di credito non è stata utilizzata nel corso del periodo finanziario.

11. Impegni e sopravvenienze passive

Non sussiste alcun impegno o sopravvenienza passiva al 30 settembre 2023 e al 31 marzo 2023.

12. Fondi chiusi

Al 30 settembre 2023, BlackRock Diversified Strategies Selection Fund, BlackRock Euro Cash Fund e BlackRock Fixed Income Selection Fund detenevano saldi in conti presso il Fiduciario per un importo rispettivamente pari a EUR 29.954 (31.03.2023: EUR 46.568), EUR 31.290 (31.03.2023: EUR 46.28) e EUR 510 (31.03.2023: EUR 38.384). Questi Fondi sono stati chiusi in anni precedenti e non sono stati inclusi nella presente relazione in quanto i bilanci certificati alla data di chiusura finale sono stati redatti in anni passati.

13. Eventi successivi

Il 30 ottobre 2023 è stato interamente rimborsato BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1.

All'infuori di quanto sopra esposto, non si sono verificati eventi successivi alla chiusura del periodo finanziario che, a giudizio degli Amministratori, potrebbero avere un impatto sul bilancio per il periodo finanziario chiuso al 30 settembre 2023.

14. Data di approvazione

Il bilancio è stato approvato dagli Amministratori in data 20 novembre 2023.

BLACKROCK CANGRANDE GLOBAL INDEX EQUITY FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO				
Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2023: 31,76%)				
Irlanda (31 marzo 2023: 31,76%)				
1.531.324	USD	iShares Developed World ESG Screened Index Fund (IE) - Classe di Azioni US Dollar Flexible Accumulating ¹	29.779	19,20
939.612	EUR	iShares Emerging Markets Index Fund (IE) - Classe di Azioni Euro Flexible Accumulating ¹	16.079	10,36
43.791	USD	iShares Pacific Index Fund (IE) - Classe di Azioni US Dollar Flexible Accumulating ¹	2.463	1,59
Irlanda - Totale			48.321	31,15
Totale investimenti in organismi di investimento collettivo			48.321	31,15
Totale investimenti in organismi di investimento collettivo			48.321	31,15
ETF (31 marzo 2023: 68,34%)				
Irlanda (31 marzo 2023: 68,34%)				
64.809	EUR	iShares Core S&P 500 UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	27.434	17,69
16.322	EUR	iShares MSCI Canada UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	2.550	1,64
2.015.982	EUR	iShares MSCI Europe ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc) ¹	14.350	9,25
914.656	EUR	iShares MSCI Japan ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	4.958	3,20
3.485.662	EUR	iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	27.920	18,00
4.183.315	EUR	iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	29.786	19,20
Irlanda - Totale			106.998	68,98
Totale investimenti in ETF			106.998	68,98
			Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico			155.319	100,13
Liquidità			37	0,02
Altre attività e passività			(236)	(0,15)
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili			155.120	100,00
Analisi del totale attività				% del totale attività
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale				68,86
Organismi di investimento collettivo				31,10
Altre attività				0,04
Totale attività				100,00

¹ Una parte correlata al Fondo.

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI				
Titoli del debito societario (31 marzo 2023: 99,03%)				
Australia (31 marzo 2023: 1,59%)				
200.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 2.00%, 22/03/2027	184	0,04
100.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 0.75%, 15/03/2029	81	0,02
250.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 2.00%, 15/07/2030	209	0,04
150.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 1.25%, 15/03/2033	109	0,02
100.000	EUR	Aurizon Network Pty. Ltd., 3.13%, 01/06/2026	97	0,02
250.000	EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 0.75%, 29/09/2026	228	0,05
250.000	EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 1.13%, 21/11/2029	237	0,05
150.000	EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 0.67%, 05/05/2031	133	0,03
200.000	EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 5.10%, 03/02/2033	197	0,04
200.000	EUR	Australia Pacific Airports Melbourne Pty. Ltd., 4.38%, 24/05/2033	195	0,04
100.000	EUR	CIMIC Finance Ltd., 1.50%, 28/05/2029	79	0,01
100.000	EUR	Commonwealth Bank of Australia, 1.13%, 18/01/2028	90	0,02
140.000	EUR	Commonwealth Bank of Australia, FRN, 1.94%, 03/10/2029	134	0,03
100.000	EUR	Macquarie Group Ltd., 0.63%, 03/02/2027	88	0,02
100.000	EUR	Macquarie Group Ltd., 0.35%, 03/03/2028	84	0,02
150.000	EUR	Macquarie Group Ltd., 0.94%, 19/01/2029	124	0,02
125.000	EUR	Macquarie Group Ltd., 0.95%, 21/05/2031	96	0,02
250.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 1.25%, 18/05/2026	235	0,05
275.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 2.13%, 24/05/2028	255	0,05
200.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 1.38%, 30/08/2028	176	0,03
100.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 1.13%, 20/05/2031	83	0,02
100.000	EUR	Scentre Group Trust 1, REIT, 1.75%, 11/04/2028	87	0,02
150.000	EUR	Scentre Group Trust 1, REIT, 1.45%, 28/03/2029	125	0,02
100.000	EUR	Stockland Trust, REIT, 1.63%, 27/04/2026	93	0,02
100.000	EUR	Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd., 1.75%, 26/04/2028	90	0,02
225.000	EUR	Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd., 4.38%, 03/05/2033	220	0,04
100.000	EUR	Telstra Group Ltd., 1.13%, 14/04/2026	93	0,02
250.000	EUR	Telstra Group Ltd., 1.00%, 23/04/2030	208	0,04
100.000	EUR	Telstra Group Ltd., 3.75%, 04/05/2031	98	0,02
100.000	EUR	Toyota Finance Australia Ltd., 0.06%, 13/01/2025	95	0,02
200.000	EUR	Toyota Finance Australia Ltd., 2.28%, 21/10/2027	188	0,04
100.000	EUR	Toyota Finance Australia Ltd., 0.44%, 13/01/2028	86	0,02
200.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 2.00%, 28/08/2025	192	0,04
300.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 1.75%, 29/03/2028	272	0,05
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 1.45%, 16/05/2029	86	0,02
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 3.00%, 08/04/2030	92	0,02
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 4.23%, 26/04/2033	98	0,02
100.000	EUR	Vicinity Centres Trust, REIT, 1.13%, 07/11/2029	80	0,02
300.000	EUR	Wesfarmers Ltd., 0.95%, 21/10/2033	217	0,04
150.000	EUR	Westpac Banking Corp., 0.63%, 22/11/2024	144	0,03
350.000	EUR	Westpac Banking Corp., 3.70%, 16/01/2026	348	0,07
150.000	EUR	Westpac Banking Corp., 1.13%, 05/09/2027	135	0,03
100.000	EUR	Westpac Banking Corp., 1.45%, 17/07/2028	89	0,02
200.000	EUR	Westpac Banking Corp., 3.80%, 17/01/2030	196	0,04
250.000	EUR	Westpac Banking Corp., FRN, 0.77%, 13/05/2031	222	0,04
200.000	EUR	Woolworths Group Ltd., 0.38%, 15/11/2028	164	0,03
Australia - Totale			6.832	1,39
Austria (31 marzo 2023: 1,12%)				
100.000	EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 4.13%, 18/01/2027	98	0,02
100.000	EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 0.38%, 03/09/2027	85	0,02
200.000	EUR	CA Immobilien Anlagen AG, REIT, 1.00%, 27/10/2025	179	0,03
100.000	EUR	CA Immobilien Anlagen AG, REIT, 0.88%, 05/02/2027	86	0,02
300.000	EUR	Erste Group Bank AG, 1.50%, 07/04/2026	282	0,06
200.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.88%, 22/05/2026	184	0,04
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.88%, 13/05/2026	89	0,02

NM1123U-3256239-48/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Parteci- pazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Austria (continua)				
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.13%, 17/05/2028	83	0,02
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.25%, 14/09/2029	79	0,01
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.25%, 27/01/2031	75	0,01
200.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 0.10%, 16/11/2028	168	0,03
200.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 4.25%, 30/05/2030	198	0,04
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 1.00%, 10/06/2030	92	0,02
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 1.63%, 08/09/2031	89	0,02
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 0.88%, 15/11/2032	83	0,02
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 4.00%, 07/06/2033	93	0,02
100.000	EUR	Mondi Finance Europe GmbH, 2.38%, 01/04/2028	93	0,02
150.000	EUR	OMV AG, 0.00%, 03/07/2025	140	0,03
225.000	EUR	OMV AG, 1.00%, 14/12/2026	207	0,04
100.000	EUR	OMV AG, 3.50%, 27/09/2027	99	0,02
175.000	EUR	OMV AG, 2.00%, 09/04/2028	163	0,03
200.000	EUR	OMV AG, 1.88%, 04/12/2028	182	0,04
175.000	EUR	OMV AG, 0.75%, 16/06/2030	143	0,03
100.000	EUR	OMV AG, 2.38%, 09/04/2032	89	0,02
100.000	EUR	OMV AG, 1.00%, 03/07/2034	73	0,01
150.000	EUR	OMV AG, FRN, 6.25%, 09/12/2025 ¹	153	0,03
100.000	EUR	OMV AG, FRN, 2.50%, 01/06/2026 ¹	90	0,02
300.000	EUR	OMV AG, FRN, 2.88%, 01/06/2029 ¹	251	0,05
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, 0.25%, 22/01/2025	94	0,02
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, 4.13%, 08/09/2025	99	0,02
200.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, 0.38%, 25/09/2026	175	0,03
200.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, 0.05%, 01/09/2027	165	0,03
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, 5.75%, 27/01/2028	102	0,02
200.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 4.75%, 26/01/2027	196	0,04
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 6.00%, 15/09/2028	100	0,02
200.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 1.50%, 12/03/2030	174	0,04
200.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 7.38%, 20/12/2032	194	0,04
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 1.38%, 17/06/2033	73	0,01
100.000	EUR	Telekom Finanzmanagement GmbH, 1.50%, 07/12/2026	94	0,02
100.000	EUR	UNIQA Insurance Group AG, 1.38%, 09/07/2030	82	0,02
100.000	EUR	UNIQA Insurance Group AG, FRN, 2.38%, 09/12/2041	73	0,01
100.000	EUR	UNIQA Insurance Group AG, FRN, 6.00%, 27/07/2046	101	0,02
200.000	EUR	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe, 1.00%, 26/03/2036	141	0,03
100.000	EUR	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe, FRN, 4.88%, 15/06/2042	92	0,02
200.000	EUR	Wienerberger AG, 2.75%, 04/06/2025	193	0,04
Austria - Totale			5.794	1,17
Belgio (31 marzo 2023: 2,06%)				
100.000	EUR	Aedifica SA, REIT, 0.75%, 09/09/2031	71	0,01
100.000	EUR	AG Insurance SA, FRN, 3.50%, 30/06/2047	92	0,02
100.000	EUR	Ageas SA, FRN, 3.25%, 02/07/2049	86	0,02
100.000	EUR	Ageas SA, FRN, 1.88%, 24/11/2051	73	0,01
300.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.70%, 31/03/2026	292	0,06
400.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 1.15%, 22/01/2027	368	0,07
200.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 1.13%, 01/07/2027	182	0,04
300.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.13%, 02/12/2027	281	0,06
450.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.00%, 17/03/2028	419	0,08
200.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 1.50%, 18/04/2030	174	0,03
250.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 1.65%, 28/03/2031	214	0,04
300.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.88%, 02/04/2032	277	0,06
200.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 3.25%, 24/01/2033	189	0,04
200.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.00%, 23/01/2035	162	0,03
480.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.75%, 17/03/2036	413	0,08

NM1123U-3256239-49/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Belgio (continua)				
400.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 3.70%, 02/04/2040	362	0,07
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 1.00%, 26/10/2024	97	0,02
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 0.38%, 02/09/2025	93	0,02
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 0.01%, 15/10/2025	92	0,02
300.000	EUR	Belfius Bank SA, 0.38%, 13/02/2026	275	0,06
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 3.13%, 11/05/2026	96	0,02
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 0.00%, 28/08/2026	89	0,02
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 0.38%, 08/06/2027	88	0,02
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 3.88%, 12/06/2028	99	0,02
300.000	EUR	Belfius Bank SA, 4.13%, 12/09/2029	298	0,06
100.000	EUR	Belfius Bank SA, FRN, 5.25%, 19/04/2033	97	0,02
200.000	EUR	Belfius Bank SA, FRN, 1.25%, 06/04/2034	158	0,03
300.000	EUR	Cofinimmo SA, REIT, 1.00%, 24/01/2028	257	0,05
100.000	EUR	Cofinimmo SA, REIT, 0.88%, 02/12/2030	74	0,01
100.000	EUR	Elia Group SA, 1.50%, 05/09/2028	88	0,02
200.000	EUR	Elia Group SA/NV, FRN, 5.85%, 15/03/2028 ¹	200	0,04
100.000	EUR	Elia Transmission Belgium SA, 1.38%, 14/01/2026	94	0,02
100.000	EUR	Elia Transmission Belgium SA, 3.25%, 04/04/2028	98	0,02
100.000	EUR	Elia Transmission Belgium SA, 3.00%, 07/04/2029	95	0,02
100.000	EUR	Elia Transmission Belgium SA, 0.88%, 28/04/2030	82	0,02
300.000	EUR	Elia Transmission Belgium SA, 3.63%, 18/01/2033	287	0,06
100.000	EUR	Groupe Bruxelles Lambert NV, 3.13%, 06/09/2029	96	0,02
300.000	EUR	Groupe Bruxelles Lambert NV, 0.13%, 28/01/2031	227	0,05
200.000	EUR	Groupe Bruxelles Lambert NV, 4.00%, 15/05/2033	197	0,04
300.000	EUR	KBC Group NV, 0.63%, 10/04/2025	284	0,06
100.000	EUR	KBC Group NV, 0.75%, 24/01/2030	81	0,02
200.000	EUR	KBC Group NV, 3.00%, 25/08/2030	185	0,04
100.000	EUR	KBC Group NV, 0.75%, 31/05/2031	78	0,02
200.000	EUR	KBC Group NV, 4.38%, 06/12/2031	196	0,04
500.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 4.50%, 06/06/2026	500	0,10
200.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.13%, 10/09/2026	184	0,04
100.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.25%, 01/03/2027	91	0,02
100.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.38%, 16/06/2027	91	0,02
200.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 4.38%, 23/11/2027	199	0,04
200.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.75%, 21/01/2028	177	0,04
200.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.13%, 14/01/2029	167	0,03
100.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.50%, 03/12/2029	94	0,02
100.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 4.38%, 19/04/2030	99	0,02
100.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.63%, 07/12/2031	87	0,02
100.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 4.88%, 25/04/2033	97	0,02
150.000	EUR	Lonza Finance International NV, 1.63%, 21/04/2027	138	0,03
200.000	EUR	Lonza Finance International NV, 3.88%, 25/05/2033	191	0,04
100.000	EUR	Solvay SA, 2.75%, 02/12/2027	96	0,02
100.000	EUR	Solvay SA, 0.50%, 06/09/2029	100	0,02
300.000	EUR	VGP NV, REIT, 1.63%, 17/01/2027	254	0,05
100.000	EUR	VGP NV, REIT, 1.50%, 08/04/2029	74	0,01
100.000	EUR	VGP NV, REIT, 2.25%, 17/01/2030	76	0,01
Belgio - Totale			10.471	2,13
Isole Vergini britanniche (31 marzo 2023: 0,04%)				
100.000	EUR	Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd., 1.00%, 12/12/2024	95	0,02
Isole Vergini britanniche - Totale			95	0,02
Canada (31 marzo 2023: 0,78%)				
200.000	EUR	Bank of Montreal, 2.75%, 15/06/2027	191	0,04
200.000	EUR	Bank of Nova Scotia (The), 0.13%, 04/09/2026	179	0,04

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Canada (continua)				
200.000	EUR	Bank of Nova Scotia (The), 0.25%, 01/11/2028	164	0,03
200.000	EUR	Fairfax Financial Holdings Ltd., 2.75%, 29/03/2028	183	0,04
200.000	EUR	Great-West Lifeco, Inc., 1.75%, 07/12/2026	187	0,04
200.000	EUR	Great-West Lifeco, Inc., 4.70%, 16/11/2029	203	0,04
400.000	EUR	Magna International, Inc., 1.50%, 25/09/2027	366	0,07
100.000	EUR	Magna International, Inc., 4.38%, 17/03/2032	99	0,02
75.000	EUR	Mercedes-Benz Finance Canada, Inc., 3.00%, 23/02/2027	73	0,01
100.000	EUR	National Bank of Canada, 3.75%, 25/01/2028	97	0,02
340.000	EUR	Royal Bank of Canada, 2.13%, 26/04/2029	302	0,06
200.000	EUR	Royal Bank of Canada, 4.38%, 02/10/2030	199	0,04
178.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 0.50%, 18/01/2027	157	0,03
200.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 2.55%, 03/08/2027	187	0,04
250.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 3.63%, 13/12/2029	239	0,05
350.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 1.95%, 08/04/2030	300	0,06
250.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 3.13%, 03/08/2032	226	0,05
300.000	EUR	TotalEnergies Capital Canada Ltd., 2.13%, 18/09/2029	271	0,05
Canada - Totale			3.623	0,73
Isole Cayman (31 marzo 2023: 0,15%)				
125.000	EUR	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd., 1.25%, 13/04/2025	119	0,02
100.000	EUR	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd., 2.00%, 13/04/2030	86	0,02
100.000	EUR	CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd., 0.75%, 02/11/2029	80	0,02
100.000	EUR	CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd., 1.00%, 02/11/2033	70	0,01
200.000	EUR	CK Hutchison Finance 16 II Ltd., 0.88%, 03/10/2024	193	0,04
122.000	EUR	CK Hutchison Finance 16 Ltd., 2.00%, 06/04/2028	112	0,02
Isole Cayman - Totale			660	0,13
Croazia (31 marzo 2023: 0,02%)				
100.000	EUR	Erste&Steiermaerkische Banka dd, FRN, 0.75%, 06/07/2028	82	0,02
Totale Croazia			82	0,02
Repubblica ceca (31 marzo 2023: 0,15%)				
100.000	EUR	Ceska sporitelna A/S, FRN, 6.69%, 14/11/2025	101	0,02
300.000	EUR	Ceska sporitelna A/S, FRN, 5.74%, 08/03/2028	301	0,06
100.000	EUR	Ceska sporitelna A/S, FRN, 0.50%, 13/09/2028	82	0,02
150.000	EUR	EP Infrastructure A/S, 1.70%, 30/07/2026	132	0,03
125.000	EUR	EP Infrastructure A/S, 2.05%, 09/10/2028	101	0,02
100.000	EUR	EP Infrastructure A/S, 1.82%, 02/03/2031	73	0,01
100.000	EUR	Raiffeisenbank A/S, FRN, 1.00%, 09/06/2028	77	0,01
Repubblica Ceca - Totale			867	0,17
Danimarca (31 marzo 2023: 1,13%)				
100.000	EUR	AP Moller - Maersk A/S, 1.75%, 16/03/2026	95	0,02
200.000	EUR	AP Moller - Maersk A/S, 0.75%, 25/11/2031	153	0,03
200.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 3.25%, 12/10/2025	197	0,04
200.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 3.50%, 26/11/2026	197	0,04
100.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 0.38%, 30/06/2027	87	0,02
150.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 0.88%, 01/07/2029	125	0,02
100.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 0.63%, 09/03/2030	80	0,02
100.000	EUR	Danica Pension Livsforsikrings AB, FRN, 4.38%, 29/09/2045	97	0,02
200.000	EUR	Danske Bank A/S, 0.63%, 26/05/2025	189	0,04
200.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 4.00%, 12/01/2027	198	0,04
200.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 1.38%, 17/02/2027	185	0,04
100.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 0.75%, 09/06/2029	84	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Danimarca (continua)				
250.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 1.38%, 12/02/2030	236	0,05
125.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 4.75%, 21/06/2030	124	0,02
100.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 1.50%, 02/09/2030	93	0,02
200.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 4.13%, 10/01/2031	197	0,04
125.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 1.00%, 15/05/2031	112	0,02
200.000	EUR	DSV A/S, 0.38%, 26/02/2027	178	0,04
150.000	EUR	H Lundbeck A/S, 0.88%, 14/10/2027	130	0,03
100.000	EUR	ISS Global A/S, 2.13%, 02/12/2024	97	0,02
300.000	EUR	ISS Global A/S, 0.88%, 18/06/2026	273	0,05
125.000	EUR	ISS Global A/S, 1.50%, 31/08/2027	112	0,02
100.000	EUR	Jyske Bank A/S, 5.50%, 16/11/2027	102	0,02
150.000	EUR	Jyske Bank A/S, FRN, 0.38%, 15/10/2025	144	0,03
200.000	EUR	Jyske Bank A/S, FRN, 4.63%, 11/04/2026	199	0,04
200.000	EUR	Jyske Bank A/S, FRN, 0.25%, 17/02/2028	173	0,03
150.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 0.50%, 10/07/2025	140	0,03
175.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 0.25%, 13/01/2026	160	0,03
300.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 0.75%, 20/01/2027	265	0,05
100.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 1.38%, 12/07/2027	90	0,02
100.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 0.38%, 17/01/2028	84	0,02
200.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 4.00%, 17/07/2028	194	0,04
100.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, FRN, 5.50%, 29/12/2032	98	0,02
300.000	EUR	Pandora A/S, 4.50%, 10/04/2028	299	0,06
100.000	EUR	Sydbank A/S, FRN, 0.50%, 10/11/2026	91	0,02
200.000	EUR	Sydbank A/S, FRN, 5.13%, 06/09/2028	199	0,04
100.000	EUR	TDC Net A/S, 5.06%, 31/05/2028	98	0,02
100.000	EUR	TDC Net A/S, 5.62%, 06/02/2030	98	0,02
100.000	EUR	TDC Net A/S, 6.50%, 01/06/2031	99	0,02
300.000	EUR	Vestas Wind Systems A/S, 4.13%, 15/06/2026	299	0,06
Danimarca - Totale			6.071	1,23
Estonia (31 marzo 2023: 0,03%)				
150.000	EUR	Luminor Bank A/S, FRN, 0.54%, 23/09/2026	134	0,03
Estonia - Totale			134	0,03
Finlandia (31 marzo 2023: 1,39%)				
175.000	EUR	Balder Finland OYJ, REIT, 1.00%, 20/01/2029	119	0,02
100.000	EUR	Balder Finland OYJ, REIT, 1.38%, 24/05/2030	64	0,01
125.000	EUR	Balder Finland OYJ, REIT, 2.00%, 18/01/2031	81	0,02
100.000	EUR	Castellum Helsinki Finance Holding Abp, REIT, 2.00%, 24/03/2025	94	0,02
100.000	EUR	Castellum Helsinki Finance Holding Abp, REIT, 0.88%, 17/09/2029	72	0,01
100.000	EUR	Elisa OYJ, 1.13%, 26/02/2026	93	0,02
100.000	EUR	Elisa OYJ, 0.25%, 15/09/2027	87	0,02
100.000	EUR	Kojamo OYJ, REIT, 1.63%, 07/03/2025	93	0,02
100.000	EUR	Kojamo OYJ, REIT, 2.00%, 31/03/2026	91	0,02
100.000	EUR	Kojamo OYJ, REIT, 1.88%, 27/05/2027	86	0,02
150.000	EUR	Kojamo OYJ, REIT, 0.88%, 28/05/2029	109	0,02
100.000	EUR	Metso OYJ, 0.88%, 26/05/2028	86	0,02
100.000	EUR	Neste OYJ, 0.75%, 25/03/2028	86	0,02
200.000	EUR	Neste OYJ, 3.88%, 16/03/2029	198	0,04
100.000	EUR	Neste OYJ, 4.25%, 16/03/2033	99	0,02
300.000	EUR	Nokia OYJ, 2.00%, 11/03/2026	283	0,06
100.000	EUR	Nokia OYJ, 3.13%, 15/05/2028	94	0,02
100.000	EUR	Nokia OYJ, 4.38%, 21/08/2031	96	0,02
100.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.38%, 28/05/2026	91	0,02
300.000	EUR	Nordea Bank Abp, 1.13%, 16/02/2027	273	0,05
475.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.50%, 14/05/2027	423	0,08

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Finlandia (continua)				
200.000	EUR	Nordea Bank Abp, 1.13%, 27/09/2027	181	0,04
200.000	EUR	Nordea Bank Abp, 4.13%, 05/05/2028	198	0,04
175.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.50%, 02/11/2028	146	0,03
350.000	EUR	Nordea Bank Abp, 2.50%, 23/05/2029	320	0,06
100.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.50%, 19/03/2031	78	0,01
200.000	EUR	Nordea Bank Abp, 2.88%, 24/08/2032	180	0,04
100.000	EUR	Nordea Bank Abp, FRN, 3.63%, 10/02/2026	99	0,02
150.000	EUR	Nordea Bank Abp, FRN, 4.38%, 06/09/2026	150	0,03
200.000	EUR	Nordea Bank Abp, FRN, 0.63%, 18/08/2031	177	0,04
200.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 1.00%, 22/05/2025	190	0,04
400.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.50%, 12/08/2025	375	0,07
125.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.25%, 24/03/2026	114	0,02
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.60%, 18/01/2027	89	0,02
150.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 4.13%, 18/04/2027	150	0,03
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.63%, 27/07/2027	87	0,02
300.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.10%, 16/11/2027	255	0,05
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.38%, 16/06/2028	84	0,02
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.38%, 08/12/2028	82	0,02
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.63%, 12/11/2029	80	0,02
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.75%, 24/03/2031	79	0,02
225.000	EUR	OP Corporate Bank plc, FRN, 1.63%, 09/06/2030	210	0,04
100.000	EUR	Sampo OYJ, 2.25%, 27/09/2030	93	0,02
150.000	EUR	Sampo OYJ, FRN, 3.38%, 23/05/2049	133	0,03
200.000	EUR	Sampo OYJ, FRN, 2.50%, 03/09/2052	153	0,03
100.000	EUR	SATO OYJ, REIT, 1.38%, 24/02/2028	77	0,01
300.000	EUR	Stora Enso OYJ, 4.25%, 01/09/2029	293	0,06
200.000	EUR	Stora Enso OYJ, 0.63%, 02/12/2030	152	0,03
100.000	EUR	Teollisuuden Voima OYJ, 2.13%, 04/02/2025	97	0,02
200.000	EUR	Teollisuuden Voima OYJ, 1.13%, 09/03/2026	184	0,04
150.000	EUR	Teollisuuden Voima OYJ, 2.63%, 31/03/2027	140	0,03
150.000	EUR	Teollisuuden Voima OYJ, 1.38%, 23/06/2028	128	0,03
200.000	EUR	Teollisuuden Voima OYJ, 4.75%, 01/06/2030	196	0,04
200.000	EUR	UPM-Kymmene OYJ, 0.13%, 19/11/2028	163	0,03
100.000	EUR	UPM-Kymmene OYJ, 2.25%, 23/05/2029	90	0,02
150.000	EUR	UPM-Kymmene OYJ, 0.50%, 22/03/2031	114	0,02
Finlandia - Totale			8.055	1,64
Francia (31 marzo 2023: 20,61%)				
200.000	EUR	Accor SA, 3.00%, 04/02/2026	190	0,04
200.000	EUR	Accor SA, 2.38%, 29/11/2028	179	0,04
200.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 1.00%, 02/04/2025	192	0,04
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 1.00%, 08/03/2027	92	0,02
300.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 1.25%, 13/06/2028	273	0,05
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 1.38%, 02/04/2030	87	0,02
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 0.63%, 20/06/2030	82	0,02
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 0.38%, 27/05/2031	78	0,01
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 2.88%, 16/09/2032	92	0,02
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 0.38%, 20/09/2033	71	0,01
100.000	EUR	ALD SA, 4.75%, 13/10/2025	101	0,02
100.000	EUR	ALD SA, 1.25%, 02/03/2026	93	0,02
400.000	EUR	ALD SA, 4.25%, 18/01/2027	396	0,08
100.000	EUR	ALD SA, 4.00%, 05/07/2027	98	0,02
200.000	EUR	Alstom SA, 0.25%, 14/10/2026	179	0,04
100.000	EUR	Alstom SA, 0.13%, 27/07/2027	87	0,02
200.000	EUR	Alstom SA, 0.00%, 11/01/2029	162	0,03
100.000	EUR	Alstom SA, 0.50%, 27/07/2030	79	0,02
100.000	EUR	Altarea SCA, REIT, 1.75%, 16/01/2030	73	0,01
200.000	EUR	APRR SA, 1.13%, 09/01/2026	189	0,04

NM1123U-3256239-53/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Parteci- pazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Francia (continua)				
200.000	EUR	APRR SA, 1.25%, 14/01/2027	184	0,04
100.000	EUR	APRR SA, 1.25%, 18/01/2028	90	0,02
100.000	EUR	APRR SA, 0.00%, 19/06/2028	83	0,02
100.000	EUR	APRR SA, 1.88%, 03/01/2029	90	0,02
100.000	EUR	APRR SA, 0.13%, 18/01/2029	82	0,02
300.000	EUR	APRR SA, 3.13%, 24/01/2030	286	0,06
100.000	EUR	APRR SA, 1.50%, 25/01/2030	87	0,02
200.000	EUR	APRR SA, 1.88%, 06/01/2031	175	0,03
100.000	EUR	APRR SA, 1.63%, 13/01/2032	84	0,02
100.000	EUR	APRR SA, 1.50%, 17/01/2033	81	0,02
200.000	EUR	Arkema SA, 1.50%, 20/01/2025	193	0,04
300.000	EUR	Arkema SA, 0.13%, 14/10/2026	269	0,05
300.000	EUR	Arkema SA, 0.75%, 03/12/2029	248	0,05
100.000	EUR	Arkema SA, 3.50%, 23/01/2031	95	0,02
100.000	EUR	Arval Service Lease SA, 4.63%, 02/12/2024	100	0,02
200.000	EUR	Arval Service Lease SA, 0.88%, 17/02/2025	190	0,04
300.000	EUR	Arval Service Lease SA, 4.25%, 11/11/2025	299	0,06
100.000	EUR	Arval Service Lease SA, 3.38%, 04/01/2026	98	0,02
100.000	EUR	Arval Service Lease SA, 4.13%, 13/04/2026	99	0,02
300.000	EUR	Arval Service Lease SA, 4.00%, 22/09/2026	296	0,06
300.000	EUR	Arval Service Lease SA, 4.75%, 22/05/2027	301	0,06
100.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.13%, 20/04/2026	94	0,02
300.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.25%, 18/01/2027	277	0,06
100.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.38%, 27/06/2028	91	0,02
200.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.38%, 22/01/2030	174	0,03
300.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.38%, 21/02/2031	254	0,05
200.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 2.75%, 02/09/2032	180	0,04
100.000	EUR	AXA SA, 1.13%, 15/05/2028	90	0,02
100.000	EUR	AXA SA, 3.75%, 12/10/2030	99	0,02
300.000	EUR	AXA SA, 3.63%, 10/01/2033	289	0,06
150.000	EUR	AXA SA, FRN, 3.94%, 07/11/2024 ¹	147	0,03
150.000	EUR	AXA SA, FRN, 3.88%, 08/10/2025 ¹	145	0,03
150.000	EUR	AXA SA, FRN, 1.38%, 07/10/2041	114	0,02
250.000	EUR	AXA SA, FRN, 1.88%, 10/07/2042	186	0,04
275.000	EUR	AXA SA, FRN, 4.25%, 10/03/2043	248	0,05
100.000	EUR	AXA SA, FRN, 5.50%, 11/07/2043	98	0,02
440.000	EUR	AXA SA, FRN, 3.38%, 06/07/2047	415	0,08
575.000	EUR	AXA SA, FRN, 3.25%, 28/05/2049	516	0,10
500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.01%, 07/03/2025	471	0,09
500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.00%, 23/05/2025	475	0,10
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.75%, 17/07/2025	94	0,02
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.00%, 11/09/2025	195	0,04
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.63%, 19/01/2026	189	0,04
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.38%, 24/03/2026	190	0,04
500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.01%, 11/05/2026	450	0,09
400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.75%, 08/06/2026	366	0,07
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.88%, 04/11/2026	93	0,02
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.63%, 31/03/2027	94	0,02
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.25%, 26/05/2027	271	0,05
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.13%, 14/09/2027	192	0,04
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.10%, 08/10/2027	171	0,03
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.63%, 15/11/2027	88	0,02
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.63%, 19/11/2027	86	0,02
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.88%, 26/01/2028	195	0,04
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.88%, 14/02/2028	197	0,04
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.50%, 25/05/2028	181	0,04
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.25%, 29/06/2028	84	0,02
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.38%, 16/07/2028	177	0,03
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.25%, 19/07/2028	246	0,05

NM1123U-3256239-54/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Parteci- pazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Francia (continua)				
400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.63%, 03/11/2028	330	0,07
400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.13%, 13/03/2029	396	0,08
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.75%, 15/03/2029	173	0,03
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.88%, 18/06/2029	84	0,02
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.63%, 06/11/2029	89	0,02
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.00%, 21/11/2029	99	0,02
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.75%, 17/01/2030	79	0,02
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.38%, 02/05/2030	197	0,04
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.25%, 03/06/2030	161	0,03
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.13%, 18/09/2030	297	0,06
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.63%, 21/02/2031	151	0,03
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.13%, 19/11/2031	73	0,01
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.13%, 19/01/2032	231	0,05
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.63%, 14/09/2032	95	0,02
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.13%, 13/01/2033	292	0,06
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.00%, 26/01/2033	190	0,04
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.75%, 01/02/2033	286	0,06
400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.13%, 14/06/2033	390	0,08
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 3.88%, 16/06/2032	94	0,02
200.000	EUR	BNP Paribas Cardif SA, 1.00%, 29/11/2024	192	0,04
200.000	EUR	BNP Paribas Cardif SA, FRN, 4.03%, 25/11/2025 ¹	192	0,04
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.38%, 17/02/2025	194	0,04
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.25%, 19/03/2025	192	0,04
300.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.50%, 17/11/2025	285	0,06
150.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.75%, 27/01/2026	145	0,03
250.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.63%, 23/02/2026	237	0,05
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.13%, 11/06/2026	185	0,04
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 0.13%, 04/09/2026	179	0,04
100.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.88%, 01/10/2026	95	0,02
300.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.25%, 11/01/2027	280	0,06
140.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.50%, 23/05/2028	125	0,02
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.50%, 25/05/2028	181	0,04
300.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.38%, 28/05/2029	253	0,05
300.000	EUR	BNP Paribas SA, 3.63%, 01/09/2029	285	0,06
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.63%, 02/07/2031	156	0,03
300.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.10%, 07/04/2032	245	0,05
400.000	EUR	BNP Paribas SA, 0.63%, 03/12/2032	284	0,06
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 4.13%, 24/05/2033	197	0,04
500.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.13%, 23/01/2027	472	0,09
100.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.25%, 13/04/2027	90	0,02
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.38%, 14/10/2027	177	0,04
100.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 19/02/2028	87	0,02
100.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 30/05/2028	87	0,02
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.75%, 25/07/2028	187	0,04
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 01/09/2028	171	0,03
500.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 4.38%, 13/01/2029	496	0,10
400.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 3.88%, 23/02/2029	395	0,08
300.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 1.13%, 17/04/2029	257	0,05
100.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 19/01/2030	80	0,02
400.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.88%, 11/07/2030	323	0,06
300.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.38%, 20/11/2030	282	0,06
500.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 3.88%, 10/01/2031	491	0,10
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 1.13%, 15/01/2032	173	0,03
300.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.50%, 31/03/2032	270	0,05
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.88%, 31/08/2033	160	0,03
100.000	EUR	Bouygues SA, 1.38%, 07/06/2027	92	0,02
200.000	EUR	Bouygues SA, 1.13%, 24/07/2028	178	0,04
200.000	EUR	Bouygues SA, 2.25%, 29/06/2029	182	0,04
200.000	EUR	Bouygues SA, 0.50%, 11/02/2030	161	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Francia (continua)				
300.000	EUR	Bouygues SA, 3.88%, 17/07/2031	292	0,06
300.000	EUR	Bouygues SA, 4.63%, 07/06/2032	306	0,06
200.000	EUR	Bouygues SA, 3.25%, 30/06/2037	174	0,03
200.000	EUR	Bouygues SA, 5.38%, 30/06/2042	208	0,04
100.000	EUR	BPCE SA, 0.13%, 04/12/2024	96	0,02
200.000	EUR	BPCE SA, 1.00%, 01/04/2025	190	0,04
400.000	EUR	BPCE SA, 0.63%, 28/04/2025	379	0,08
300.000	EUR	BPCE SA, 0.38%, 02/02/2026	275	0,05
200.000	EUR	BPCE SA, 1.38%, 23/03/2026	187	0,04
300.000	EUR	BPCE SA, 3.63%, 17/04/2026	296	0,06
100.000	EUR	BPCE SA, 2.88%, 22/04/2026	97	0,02
200.000	EUR	BPCE SA, 0.01%, 14/01/2027	175	0,03
200.000	EUR	BPCE SA, 0.50%, 24/02/2027	176	0,03
300.000	EUR	BPCE SA, 1.75%, 26/04/2027	276	0,06
400.000	EUR	BPCE SA, 3.50%, 25/01/2028	389	0,08
100.000	EUR	BPCE SA, 1.63%, 31/01/2028	89	0,02
100.000	EUR	BPCE SA, 4.13%, 10/07/2028	99	0,02
100.000	EUR	BPCE SA, 4.38%, 13/07/2028	99	0,02
200.000	EUR	BPCE SA, 1.00%, 05/10/2028	173	0,03
100.000	EUR	BPCE SA, 0.63%, 15/01/2030	80	0,02
400.000	EUR	BPCE SA, 0.25%, 14/01/2031	301	0,06
200.000	EUR	BPCE SA, 0.75%, 03/03/2031	153	0,03
200.000	EUR	BPCE SA, 1.00%, 14/01/2032	152	0,03
200.000	EUR	BPCE SA, 2.38%, 26/04/2032	172	0,03
400.000	EUR	BPCE SA, 4.00%, 29/11/2032	388	0,08
200.000	EUR	BPCE SA, 4.50%, 13/01/2033	195	0,04
300.000	EUR	BPCE SA, FRN, 0.50%, 15/09/2027	266	0,05
100.000	EUR	BPCE SA, FRN, 0.50%, 14/01/2028	88	0,02
100.000	EUR	BPCE SA, FRN, 1.63%, 02/03/2029	88	0,02
100.000	EUR	BPCE SA, FRN, 4.63%, 02/03/2030	100	0,02
100.000	EUR	BPCE SA, FRN, 2.25%, 02/03/2032	89	0,02
200.000	EUR	BPCE SA, FRN, 5.75%, 01/06/2033	202	0,04
200.000	EUR	BPCE SA, FRN, 1.75%, 02/02/2034	163	0,03
100.000	EUR	BPCE SA, FRN, 4.75%, 14/06/2034	98	0,02
300.000	EUR	BPCE SA, FRN, 5.13%, 25/01/2035	288	0,06
100.000	EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 6.00%, 23/01/2027	104	0,02
200.000	EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 0.75%, 07/07/2028	166	0,03
100.000	EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 3.38%, 24/09/2028	93	0,02
100.000	EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 2.13%, 16/09/2029	256	0,05
200.000	EUR	Capgemini SE, 0.63%, 23/06/2025	189	0,04
200.000	EUR	Capgemini SE, 1.63%, 15/04/2026	189	0,04
100.000	EUR	Capgemini SE, 1.75%, 18/04/2028	92	0,02
300.000	EUR	Capgemini SE, 2.00%, 15/04/2029	273	0,05
200.000	EUR	Capgemini SE, 1.13%, 23/06/2030	168	0,03
200.000	EUR	Capgemini SE, 2.38%, 15/04/2032	177	0,03
100.000	EUR	Carmila SA, REIT, 1.63%, 30/05/2027	90	0,02
200.000	EUR	Carmila SA, REIT, 1.63%, 01/04/2029	166	0,03
100.000	EUR	Carrefour Banque SA, 0.11%, 14/06/2025	93	0,02
200.000	EUR	Carrefour Banque SA, 4.08%, 05/05/2027	196	0,04
250.000	EUR	Carrefour SA, 1.25%, 03/06/2025	239	0,05
100.000	EUR	Carrefour SA, 1.75%, 04/05/2026	95	0,02
100.000	EUR	Carrefour SA, 1.00%, 17/05/2027	90	0,02
200.000	EUR	Carrefour SA, 2.63%, 15/12/2027	189	0,04
400.000	EUR	Carrefour SA, 4.13%, 12/10/2028	399	0,08
200.000	EUR	Carrefour SA, 2.38%, 30/10/2029	180	0,04

NM1123U-3256239-56/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Francia (continua)				
100.000	EUR	Carrefour SA, 3.75%, 10/10/2030	96	0,02
300.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.00%, 17/03/2025	288	0,06
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.63%, 10/08/2025	96	0,02
200.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.13%, 23/03/2026	188	0,04
200.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.38%, 14/06/2027	184	0,04
200.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 2.38%, 04/10/2027	190	0,04
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 2.13%, 10/06/2028	92	0,02
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.88%, 21/09/2028	91	0,02
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 3.50%, 18/01/2029	97	0,02
200.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.88%, 15/03/2031	172	0,03
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 2.63%, 10/08/2032	89	0,02
100.000	EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 1.75%, 28/05/2027	93	0,02
500.000	EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.00%, 02/11/2028	418	0,08
300.000	EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 1.75%, 03/09/2030	266	0,05
100.000	EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.25%, 02/11/2032	75	0,01
200.000	EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 2.50%, 03/09/2038	165	0,03
100.000	EUR	Coface SA, 6.00%, 22/09/2032	100	0,02
200.000	EUR	Cofiroute SA, 1.13%, 13/10/2027	182	0,04
200.000	EUR	Cofiroute SA, 0.75%, 09/09/2028	174	0,03
100.000	EUR	Cofiroute SA, 1.00%, 19/05/2031	81	0,02
200.000	EUR	Covivio SA, REIT, 1.50%, 21/06/2027	182	0,04
200.000	EUR	Covivio SA, REIT, 2.38%, 20/02/2028	184	0,04
100.000	EUR	Covivio SA, REIT, 1.63%, 23/06/2030	83	0,02
200.000	EUR	Covivio SA, REIT, 1.13%, 17/09/2031	155	0,03
300.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, 2.00%, 17/07/2030	241	0,05
200.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, 1.50%, 06/10/2031	148	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, FRN, 4.25%, 13/01/2025 ¹	194	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, FRN, 4.50%, 14/10/2025 ¹	194	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, FRN, 2.63%, 29/01/2048	175	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, FRN, 4.75%, 27/09/2048	190	0,04
300.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.38%, 13/03/2025	288	0,06
400.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.00%, 18/09/2025	378	0,08
100.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.38%, 21/10/2025	93	0,02
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.13%, 05/02/2026	197	0,04
300.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.25%, 14/04/2026	281	0,06
300.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.88%, 20/12/2026	279	0,06
400.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.63%, 17/03/2027	373	0,07
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.38%, 03/05/2027	183	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.38%, 28/07/2027	195	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.13%, 09/12/2027	169	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.38%, 20/04/2028	168	0,03
100.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.13%, 24/02/2029	86	0,02
100.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.75%, 05/03/2029	87	0,02
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.00%, 25/03/2029	172	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.00%, 03/07/2029	169	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.50%, 29/08/2029	183	0,04
300.000	EUR	Credit Agricole SA, 4.13%, 07/03/2030	299	0,06
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.88%, 20/04/2031	195	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.88%, 14/01/2032	151	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.13%, 12/07/2032	153	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 4.00%, 18/01/2033	195	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.50%, 22/04/2034	167	0,03
500.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.88%, 28/11/2034	475	0,10
200.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 1.00%, 22/04/2026	190	0,04
400.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 4.00%, 12/10/2026	398	0,08
200.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 1.88%, 22/04/2027	187	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 0.63%, 12/01/2028	176	0,04
100.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 4.25%, 11/07/2029	98	0,02
300.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 0.50%, 21/09/2029	247	0,05

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Parteci- pazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Francia (continua)				
200.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 1.63%, 05/06/2030	188	0,04
300.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 5.50%, 28/08/2033	299	0,06
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.01%, 28/01/2026	182	0,04
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.63%, 15/04/2026	188	0,04
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.88%, 07/05/2027	89	0,02
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.38%, 19/09/2027	193	0,04
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.88%, 22/05/2028	98	0,02
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.38%, 03/10/2028	83	0,02
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.50%, 09/02/2029	93	0,02
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.13%, 23/05/2029	85	0,02
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.75%, 18/01/2030	81	0,02
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.38%, 11/03/2031	89	0,02
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 4.13%, 02/04/2031	198	0,04
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.88%, 25/10/2031	151	0,03
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 4.25%, 01/12/2032	98	0,02
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.88%, 11/03/2033	73	0,01
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, FRN, 1.25%, 11/06/2029	174	0,04
200.000	EUR	Danone SA, 0.71%, 03/11/2024	193	0,04
100.000	EUR	Danone SA, 1.13%, 14/01/2025	97	0,02
200.000	EUR	Danone SA, 1.00%, 26/03/2025	192	0,04
100.000	EUR	Danone SA, 0.00%, 01/12/2025	92	0,02
400.000	EUR	Danone SA, 0.57%, 17/03/2027	363	0,07
200.000	EUR	Danone SA, 1.21%, 03/11/2028	177	0,04
200.000	EUR	Danone SA, 0.40%, 10/06/2029	165	0,03
100.000	EUR	Danone SA, 0.52%, 09/11/2030	79	0,02
100.000	EUR	Danone SA, 3.47%, 22/05/2031	97	0,02
200.000	EUR	Danone SA, 3.07%, 07/09/2032	186	0,04
100.000	EUR	Danone SA, FRN, 1.00%, 16/09/2026 ¹	87	0,02
100.000	EUR	Edenred, 1.38%, 10/03/2025	96	0,02
100.000	EUR	Edenred, 1.88%, 06/03/2026	96	0,02
100.000	EUR	Edenred, 3.63%, 13/12/2026	99	0,02
100.000	EUR	Edenred, 1.88%, 30/03/2027	93	0,02
100.000	EUR	Edenred, 1.38%, 18/06/2029	87	0,02
300.000	EUR	Edenred, 3.63%, 13/06/2031	289	0,06
100.000	EUR	ELO SACA, 2.38%, 25/04/2025	96	0,02
200.000	EUR	ELO SACA, 2.88%, 29/01/2026	191	0,04
100.000	EUR	ELO SACA, 3.25%, 23/07/2027	94	0,02
200.000	EUR	ELO SACA, 4.88%, 08/12/2028	191	0,04
100.000	EUR	ELO SACA, 6.00%, 22/03/2029	100	0,02
200.000	EUR	Engie SA, 1.38%, 27/03/2025	192	0,04
100.000	EUR	Engie SA, 0.88%, 19/09/2025	94	0,02
100.000	EUR	Engie SA, 1.00%, 13/03/2026	93	0,02
100.000	EUR	Engie SA, 2.38%, 19/05/2026	96	0,02
100.000	EUR	Engie SA, 0.00%, 04/03/2027	88	0,02
200.000	EUR	Engie SA, 0.38%, 11/06/2027	176	0,03
300.000	EUR	Engie SA, 0.38%, 21/06/2027	263	0,05
300.000	EUR	Engie SA, 3.75%, 06/09/2027	298	0,06
200.000	EUR	Engie SA, 1.50%, 27/03/2028	180	0,04
100.000	EUR	Engie SA, 1.75%, 27/03/2028	91	0,02
100.000	EUR	Engie SA, 1.38%, 22/06/2028	89	0,02
100.000	EUR	Engie SA, 1.38%, 28/02/2029	88	0,02
100.000	EUR	Engie SA, 3.50%, 27/09/2029	97	0,02
200.000	EUR	Engie SA, 0.38%, 26/10/2029	161	0,03
100.000	EUR	Engie SA, 3.63%, 11/01/2030	97	0,02
200.000	EUR	Engie SA, 0.50%, 24/10/2030	156	0,03
100.000	EUR	Engie SA, 3.88%, 06/01/2031	98	0,02
200.000	EUR	Engie SA, 2.13%, 30/03/2032	171	0,03
100.000	EUR	Engie SA, 1.88%, 19/09/2033	81	0,02
100.000	EUR	Engie SA, 4.25%, 06/09/2034	98	0,02

NM1123U-3256239-58/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Francia (continua)				
300.000	EUR	Engie SA, 4.00%, 11/01/2035	287	0,06
100.000	EUR	Engie SA, 1.50%, 13/03/2035	74	0,01
100.000	EUR	Engie SA, 1.00%, 26/10/2036	66	0,01
200.000	EUR	Engie SA, 2.00%, 28/09/2037	148	0,03
100.000	EUR	Engie SA, 1.38%, 21/06/2039	64	0,01
200.000	EUR	Engie SA, 1.25%, 24/10/2041	117	0,02
300.000	EUR	Engie SA, 4.50%, 06/09/2042	289	0,06
100.000	EUR	Engie SA, 4.25%, 11/01/2043	93	0,02
45.000	EUR	Engie SA, 5.95%, 16/03/2111	50	0,01
100.000	EUR	Engie SA, FRN, 1.63%, 08/04/2025 ¹	93	0,02
200.000	EUR	Engie SA, FRN, 1.50%, 30/05/2028 ¹	164	0,03
200.000	EUR	Engie SA, FRN, 1.88%, 02/01/2031 ¹	151	0,03
200.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.13%, 27/05/2025	188	0,04
400.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.38%, 05/01/2026	370	0,07
300.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.38%, 27/11/2027	262	0,05
400.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.50%, 05/06/2028	345	0,07
200.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.75%, 27/11/2031	158	0,03
200.000	EUR	Eutelsat SA, 2.00%, 02/10/2025	183	0,04
100.000	EUR	Eutelsat SA, 2.25%, 13/07/2027	85	0,02
100.000	EUR	Eutelsat SA, 1.50%, 13/10/2028	74	0,01
200.000	EUR	Firmenich Productions Participations SAS, 1.38%, 30/10/2026	185	0,04
100.000	EUR	Firmenich Productions Participations SAS, 1.75%, 30/04/2030	87	0,02
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.50%, 20/01/2025	97	0,02
200.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.38%, 30/06/2027	182	0,04
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.38%, 26/01/2028	90	0,02
200.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.00%, 30/01/2029	172	0,03
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.63%, 14/03/2030	86	0,02
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 2.00%, 30/06/2032	85	0,02
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 0.88%, 25/01/2033	74	0,01
300.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.63%, 29/05/2034	236	0,05
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 0.88%, 30/06/2036	65	0,01
200.000	EUR	Groupe des Assurances du Credit Mutuel SADIR, FRN, 1.85%, 21/04/2042	146	0,03
200.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 2.50%, 04/05/2027	188	0,04
100.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1.63%, 27/11/2027	90	0,02
100.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 0.63%, 14/09/2028	84	0,02
100.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1.63%, 18/09/2029	85	0,02
100.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 4.25%, 18/03/2030	97	0,02
300.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1.48%, 18/01/2031	239	0,05
200.000	EUR	HSBC Continental Europe SA, 0.10%, 03/09/2027	173	0,03
300.000	EUR	HSBC Continental Europe SA, 1.38%, 04/09/2028	267	0,05
200.000	EUR	Icade, REIT, 1.13%, 17/11/2025	187	0,04
100.000	EUR	Icade, REIT, 1.75%, 10/06/2026	93	0,02
100.000	EUR	Icade, REIT, 1.50%, 13/09/2027	89	0,02
100.000	EUR	Icade, REIT, 1.63%, 28/02/2028	89	0,02
300.000	EUR	Icade, REIT, 1.00%, 19/01/2030	237	0,05
100.000	EUR	Icade, REIT, 0.63%, 18/01/2031	73	0,01
100.000	EUR	Imerys SA, 2.00%, 10/12/2024	97	0,02
100.000	EUR	Imerys SA, 1.50%, 15/01/2027	91	0,02
200.000	EUR	Imerys SA, 1.88%, 31/03/2028	180	0,04
100.000	EUR	Imerys SA, 1.00%, 15/07/2031	75	0,01
100.000	EUR	JCDecaux SE, 2.00%, 24/10/2024	98	0,02
100.000	EUR	JCDecaux SE, 2.63%, 24/04/2028	92	0,02
100.000	EUR	JCDecaux SE, 5.00%, 11/01/2029	100	0,02
100.000	EUR	JCDecaux SE, 1.63%, 07/02/2030	82	0,02
300.000	EUR	Kering SA, 1.25%, 05/05/2025	288	0,06
200.000	EUR	Kering SA, 3.75%, 05/09/2025	200	0,04
100.000	EUR	Kering SA, 1.25%, 10/05/2026	94	0,02
100.000	EUR	Kering SA, 1.50%, 05/04/2027	92	0,02
200.000	EUR	Kering SA, 3.63%, 05/09/2027	199	0,04

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Francia (continua)				
100.000	EUR	Kering SA, 0.75%, 13/05/2028	88	0,02
200.000	EUR	Kering SA, 1.88%, 05/05/2030	179	0,04
300.000	EUR	Kering SA, 3.63%, 05/09/2031	293	0,06
200.000	EUR	Kering SA, 3.38%, 27/02/2033	191	0,04
400.000	EUR	Kering SA, 3.88%, 05/09/2035	388	0,08
300.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 1.38%, 16/02/2027	275	0,05
200.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 2.00%, 12/05/2029	177	0,04
200.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 0.63%, 01/07/2030	154	0,03
100.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 0.88%, 17/02/2031	77	0,01
100.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 1.25%, 29/09/2031	77	0,01
200.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 1.63%, 13/12/2032	156	0,03
300.000	EUR	Legrand SA, 0.63%, 24/06/2028	261	0,05
300.000	EUR	Legrand SA, 3.50%, 29/05/2029	295	0,06
100.000	EUR	Legrand SA, 0.75%, 20/05/2030	83	0,02
100.000	EUR	Legrand SA, 0.38%, 06/10/2031	78	0,01
100.000	EUR	Legrand SA, 1.88%, 06/07/2032	89	0,02
100.000	EUR	L'Oreal SA, 3.13%, 19/05/2025	99	0,02
400.000	EUR	L'Oreal SA, 0.88%, 29/06/2026	371	0,07
100.000	EUR	L'Oreal SA, 2.88%, 19/05/2028	97	0,02
400.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.75%, 07/04/2025	382	0,08
100.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.38%, 21/10/2025	99	0,02
500.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.00%, 11/02/2026	459	0,09
400.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.13%, 11/02/2028	345	0,07
200.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.25%, 07/09/2029	196	0,04
300.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.38%, 11/02/2031	239	0,05
400.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.50%, 07/09/2033	388	0,08
100.000	EUR	Mercialys SA, REIT, 1.80%, 27/02/2026	92	0,02
100.000	EUR	Mercialys SA, REIT, 2.50%, 28/02/2029	84	0,02
100.000	EUR	Nerval SAS, REIT, 3.63%, 20/07/2028	94	0,02
200.000	EUR	Nerval SAS, REIT, 2.88%, 14/04/2032	165	0,03
100.000	EUR	New Immo Holding SA, REIT, 2.75%, 26/11/2026	91	0,02
200.000	EUR	Orange SA, 1.00%, 12/05/2025	191	0,04
300.000	EUR	Orange SA, 0.00%, 29/06/2026	271	0,05
100.000	EUR	Orange SA, 0.00%, 04/09/2026	90	0,02
100.000	EUR	Orange SA, 0.88%, 03/02/2027	91	0,02
200.000	EUR	Orange SA, 1.25%, 07/07/2027	183	0,04
200.000	EUR	Orange SA, 1.50%, 09/09/2027	184	0,04
300.000	EUR	Orange SA, 1.38%, 20/03/2028	270	0,05
200.000	EUR	Orange SA, 2.00%, 15/01/2029	183	0,04
100.000	EUR	Orange SA, 0.13%, 16/09/2029	81	0,02
200.000	EUR	Orange SA, 1.38%, 16/01/2030	174	0,03
200.000	EUR	Orange SA, 1.88%, 12/09/2030	176	0,03
200.000	EUR	Orange SA, 1.63%, 07/04/2032	168	0,03
100.000	EUR	Orange SA, 2.38%, 18/05/2032	89	0,02
200.000	EUR	Orange SA, 0.50%, 04/09/2032	149	0,03
300.000	EUR	Orange SA, 8.13%, 28/01/2033	392	0,08
100.000	EUR	Orange SA, 0.63%, 16/12/2033	72	0,01
100.000	EUR	Orange SA, 0.75%, 29/06/2034	72	0,01
100.000	EUR	Orange SA, 3.88%, 11/09/2035	97	0,02
200.000	EUR	Orange SA, 1.38%, 04/09/2049	122	0,02
200.000	EUR	Orange SA, FRN, 2.38%, 15/01/2025 ¹	190	0,04
100.000	EUR	Orange SA, FRN, 5.00%, 01/10/2026 ¹	99	0,02
100.000	EUR	Orange SA, FRN, 1.75%, 19/12/2026 ¹	89	0,02
100.000	EUR	Orange SA, FRN, 1.75%, 15/07/2028 ¹	84	0,02
200.000	EUR	Orange SA, FRN, 1.38%, 11/02/2029 ¹	160	0,03
300.000	EUR	Orange SA, FRN, 5.38%, 18/01/2030 ¹	296	0,06
200.000	EUR	Pernod Ricard SA, 1.13%, 07/04/2025	192	0,04
100.000	EUR	Pernod Ricard SA, 3.75%, 15/09/2027	100	0,02
200.000	EUR	Pernod Ricard SA, 0.50%, 24/10/2027	177	0,03

NM1123U-3256239-60/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Francia (continua)				
100.000	EUR	Pernod Ricard SA, 3.25%, 02/11/2028	97	0,02
100.000	EUR	Pernod Ricard SA, 1.38%, 07/04/2029	87	0,02
100.000	EUR	Pernod Ricard SA, 0.13%, 04/10/2029	80	0,02
400.000	EUR	Pernod Ricard SA, 1.75%, 08/04/2030	351	0,07
100.000	EUR	Pernod Ricard SA, 0.88%, 24/10/2031	79	0,02
100.000	EUR	Pernod Ricard SA, 3.75%, 02/11/2032	98	0,02
200.000	EUR	Pernod Ricard SA, 3.75%, 15/09/2033	194	0,04
100.000	EUR	PSA Tresorerie GIE, 6.00%, 19/09/2033	109	0,02
200.000	EUR	Publicis Groupe SA, 1.63%, 16/12/2024	194	0,04
425.000	EUR	RCI Banque SA, 0.50%, 14/07/2025	397	0,08
75.000	EUR	RCI Banque SA, 4.13%, 01/12/2025	74	0,01
100.000	EUR	RCI Banque SA, 1.75%, 10/04/2026	93	0,02
200.000	EUR	RCI Banque SA, 1.63%, 26/05/2026	186	0,04
150.000	EUR	RCI Banque SA, 4.63%, 13/07/2026	150	0,03
200.000	EUR	RCI Banque SA, 1.13%, 15/01/2027	180	0,04
200.000	EUR	RCI Banque SA, 4.50%, 06/04/2027	198	0,04
75.000	EUR	RCI Banque SA, 4.75%, 06/07/2027	75	0,01
300.000	EUR	RCI Banque SA, 4.88%, 14/06/2028	301	0,06
100.000	EUR	RCI Banque SA, 4.88%, 21/09/2028	100	0,02
100.000	EUR	RCI Banque SA, 4.88%, 02/10/2029	99	0,02
100.000	EUR	SANEF SA, 1.88%, 16/03/2026	94	0,02
400.000	EUR	Sanofi, 1.00%, 01/04/2025	384	0,08
100.000	EUR	Sanofi, 1.50%, 22/09/2025	96	0,02
300.000	EUR	Sanofi, 1.00%, 21/03/2026	281	0,06
300.000	EUR	Sanofi, 1.75%, 10/09/2026	284	0,06
100.000	EUR	Sanofi, 0.50%, 13/01/2027	91	0,02
400.000	EUR	Sanofi, 1.13%, 05/04/2028	360	0,07
100.000	EUR	Sanofi, 0.88%, 21/03/2029	87	0,02
200.000	EUR	Sanofi, 1.25%, 06/04/2029	177	0,03
400.000	EUR	Sanofi, 1.38%, 21/03/2030	350	0,07
200.000	EUR	Sanofi, 1.50%, 01/04/2030	177	0,03
100.000	EUR	Sanofi, 1.25%, 21/03/2034	81	0,02
200.000	EUR	Sanofi, 1.88%, 21/03/2038	160	0,03
200.000	EUR	Schlumberger Finance France SAS, 1.00%, 18/02/2026	187	0,04
500.000	EUR	Schneider Electric SE, 0.88%, 13/12/2026	459	0,09
200.000	EUR	Schneider Electric SE, 1.38%, 21/06/2027	184	0,04
100.000	EUR	Schneider Electric SE, 3.25%, 09/11/2027	98	0,02
100.000	EUR	Schneider Electric SE, 1.50%, 15/01/2028	92	0,02
100.000	EUR	Schneider Electric SE, 3.25%, 12/06/2028	98	0,02
200.000	EUR	Schneider Electric SE, 0.25%, 11/03/2029	167	0,03
100.000	EUR	Schneider Electric SE, 3.13%, 13/10/2029	97	0,02
300.000	EUR	Schneider Electric SE, 3.50%, 09/11/2032	290	0,06
200.000	EUR	Schneider Electric SE, 3.38%, 13/04/2034	190	0,04
200.000	EUR	SCOR SE, FRN, 3.00%, 08/06/2046	189	0,04
100.000	EUR	SCOR SE, FRN, 3.63%, 27/05/2048	94	0,02
100.000	EUR	SCOR SE, FRN, 1.38%, 17/09/2051	72	0,01
200.000	EUR	Societe Fonciere Lyonnaise SA, REIT, 1.50%, 05/06/2027	184	0,04
200.000	EUR	Societe Generale SA, 1.13%, 23/01/2025	192	0,04
200.000	EUR	Societe Generale SA, 2.63%, 27/02/2025	194	0,04
400.000	EUR	Societe Generale SA, 0.13%, 24/02/2026	364	0,07
100.000	EUR	Societe Generale SA, 0.88%, 01/07/2026	91	0,02
200.000	EUR	Societe Generale SA, 4.25%, 28/09/2026	200	0,04
300.000	EUR	Societe Generale SA, 0.75%, 25/01/2027	265	0,05
200.000	EUR	Societe Generale SA, 4.13%, 02/06/2027	199	0,04
300.000	EUR	Societe Generale SA, 0.25%, 08/07/2027	259	0,05
200.000	EUR	Societe Generale SA, 4.00%, 16/11/2027	198	0,04
300.000	EUR	Societe Generale SA, 1.38%, 13/01/2028	265	0,05
100.000	EUR	Societe Generale SA, 0.13%, 18/02/2028	84	0,02
200.000	EUR	Societe Generale SA, 2.13%, 27/09/2028	178	0,04

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Francia (continua)				
200.000	EUR	Societe Generale SA, 1.75%, 22/03/2029	171	0,03
200.000	EUR	Societe Generale SA, 2.63%, 30/05/2029	184	0,04
100.000	EUR	Societe Generale SA, 0.88%, 24/09/2029	80	0,02
300.000	EUR	Societe Generale SA, 1.25%, 12/06/2030	240	0,05
200.000	EUR	Societe Generale SA, 4.25%, 16/11/2032	197	0,04
300.000	EUR	Societe Generale SA, 5.63%, 02/06/2033	290	0,06
100.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 1.13%, 21/04/2026	95	0,02
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 0.13%, 17/11/2026	183	0,04
100.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 0.63%, 02/12/2027	88	0,02
300.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 0.88%, 22/09/2028	259	0,05
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 0.50%, 12/06/2029	164	0,03
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 4.75%, 28/09/2029	199	0,04
100.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 1.00%, 24/11/2030	90	0,02
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 4.25%, 06/12/2030	191	0,04
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 1.13%, 30/06/2031	176	0,04
100.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 5.25%, 06/09/2032	99	0,02
200.000	EUR	Sodexo SA, 0.75%, 27/04/2025	190	0,04
100.000	EUR	Sodexo SA, 1.13%, 22/05/2025	95	0,02
100.000	EUR	Sodexo SA, 2.50%, 24/06/2026	96	0,02
150.000	EUR	Sodexo SA, 0.75%, 14/04/2027	137	0,03
400.000	EUR	Sodexo SA, 1.00%, 17/07/2028	354	0,07
150.000	EUR	Sodexo SA, 1.00%, 27/04/2029	130	0,03
200.000	EUR	Sogecap SA, FRN, 4.13%, 18/02/2026 ¹	192	0,04
400.000	EUR	Suez SACA, 1.88%, 24/05/2027	369	0,07
100.000	EUR	Suez SACA, 4.63%, 03/11/2028	101	0,02
100.000	EUR	Suez SACA, 2.38%, 24/05/2030	89	0,02
200.000	EUR	Suez SACA, 5.00%, 03/11/2032	205	0,04
200.000	EUR	Suez SACA, 2.88%, 24/05/2034	170	0,03
100.000	EUR	Teleperformance SE, 1.88%, 02/07/2025	95	0,02
100.000	EUR	Teleperformance SE, 0.25%, 26/11/2027	84	0,02
100.000	EUR	Teleperformance SE, 3.75%, 24/06/2029	94	0,02
100.000	EUR	Terega SA, 2.20%, 05/08/2025	96	0,02
100.000	EUR	Terega SA, 0.88%, 17/09/2030	78	0,02
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.38%, 19/03/2025	96	0,02
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 2.88%, 19/11/2025	98	0,02
400.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 2.50%, 25/03/2026	387	0,08
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.02%, 04/03/2027	91	0,02
400.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.49%, 08/04/2027	370	0,07
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 0.70%, 31/05/2028	87	0,02
300.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 0.75%, 12/07/2028	262	0,05
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.38%, 04/10/2029	87	0,02
200.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.49%, 04/09/2030	171	0,03
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 0.95%, 18/05/2031	81	0,02
400.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.99%, 08/04/2032	345	0,07
200.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.54%, 31/05/2039	140	0,03
200.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.62%, 18/05/2040	137	0,03
500.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 2.63%, 26/02/2025 ¹	478	0,10
300.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 3.37%, 06/10/2026 ¹	282	0,06
200.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 2.00%, 17/01/2027 ¹	175	0,03
300.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 1.63%, 25/10/2027 ¹	251	0,05
200.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 2.00%, 04/06/2030 ¹	154	0,03
250.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 2.13%, 25/07/2032 ¹	180	0,03
150.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 3.25%, 17/07/2036 ¹	111	0,02
300.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.88%, 21/02/2025	286	0,06
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.13%, 09/04/2025	193	0,04
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.38%, 09/03/2026	187	0,04
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.50%, 04/06/2026	96	0,02
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.00%, 27/02/2027	90	0,02
150.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.13%, 28/04/2027	135	0,03

NM1123U-3256239-62/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Francia (continua)				
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.63%, 04/05/2027	87	0,02
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.50%, 22/02/2028	89	0,02
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.75%, 25/10/2028	83	0,02
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.63%, 09/04/2030	178	0,04
150.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.38%, 15/04/2030	123	0,02
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.88%, 15/01/2031	165	0,03
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.38%, 04/12/2031	154	0,03
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.88%, 29/03/2032	145	0,03
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.00%, 29/06/2032	162	0,03
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.38%, 25/05/2033	74	0,01
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.75%, 27/02/2034	76	0,01
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.00%, 28/04/2036	75	0,01
300.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.00%, 29/05/2037	217	0,04
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.25%, 14/05/2038	73	0,01
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.75%, 01/07/2049	55	0,01
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, FRN, 2.88%, 25/01/2026 ¹	82	0,02
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, FRN, 7.25%, 03/07/2028 ¹	180	0,04
200.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.00%, 03/04/2025	191	0,04
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.75%, 10/09/2025	96	0,02
300.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.00%, 09/06/2026	271	0,05
200.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.00%, 14/01/2027	176	0,03
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 4.63%, 30/03/2027	102	0,02
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.59%, 10/01/2028	91	0,02
300.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.25%, 15/04/2028	268	0,05
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.93%, 04/01/2029	86	0,02
300.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.50%, 03/04/2029	264	0,05
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.94%, 07/01/2030	88	0,02
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.63%, 17/09/2030	86	0,02
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.66%, 15/01/2031	79	0,02
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.50%, 14/10/2031	77	0,01
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.80%, 15/01/2032	77	0,01
200.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.63%, 21/09/2032	164	0,03
150.000	EUR	Veolia Environnement SA, 6.13%, 25/11/2033	175	0,03
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.25%, 14/05/2035	74	0,01
100.000	EUR	Verallia SA, 1.63%, 14/05/2028	88	0,02
100.000	EUR	Verallia SA, 1.88%, 10/11/2031	81	0,02
200.000	EUR	Vinci SA, 1.00%, 26/09/2025	190	0,04
100.000	EUR	Vinci SA, 0.00%, 27/11/2028	83	0,02
200.000	EUR	Vinci SA, 1.63%, 18/01/2029	180	0,04
300.000	EUR	Vinci SA, 1.75%, 26/09/2030	262	0,05
300.000	EUR	Vinci SA, 0.50%, 09/01/2032	230	0,05
100.000	EUR	Vinci SA, 3.38%, 17/10/2032	95	0,02
100.000	EUR	Vivendi SE, 0.63%, 11/06/2025	94	0,02
200.000	EUR	Vivendi SE, 1.13%, 11/12/2028	175	0,03
100.000	EUR	Wendel SE, 2.50%, 09/02/2027	95	0,02
100.000	EUR	Wendel SE, 1.00%, 01/06/2031	77	0,01
100.000	EUR	Wendel SE, 1.38%, 18/01/2034	72	0,01
100.000	EUR	Worldline SA, 0.88%, 30/06/2027	89	0,02
200.000	EUR	Worldline SA, 4.13%, 12/09/2028	198	0,04
100.000	EUR	WPP Finance SA, 2.25%, 22/09/2026	95	0,02
100.000	EUR	WPP Finance SA, 2.38%, 19/05/2027	95	0,02
300.000	EUR	WPP Finance SA, 4.13%, 30/05/2028	297	0,06
Francia - Totale			102.885	20,86
Germania (31 marzo 2023: 8,94%)				
100.000	EUR	Aareal Bank AG, 0.05%, 02/09/2026	86	0,02
100.000	EUR	Aareal Bank AG, 0.50%, 07/04/2027	85	0,02
100.000	EUR	Aareal Bank AG, 0.25%, 23/11/2027	82	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Germania (continua)				
100.000	EUR	Aareal Bank AG, 0.75%, 18/04/2028	82	0,02
100.000	EUR	adidas AG, 3.00%, 21/11/2025	98	0,02
100.000	EUR	adidas AG, 3.13%, 21/11/2029	97	0,02
300.000	EUR	adidas AG, 0.63%, 10/09/2035	207	0,04
100.000	EUR	Albemarle New Holding GmbH, 1.13%, 25/11/2025	94	0,02
300.000	EUR	Albemarle New Holding GmbH, 1.63%, 25/11/2028	262	0,05
300.000	EUR	Allianz SE, FRN, 4.60%, 07/09/2038	291	0,06
300.000	EUR	Allianz SE, FRN, 2.24%, 07/07/2045	285	0,06
100.000	EUR	Allianz SE, FRN, 3.10%, 06/07/2047	94	0,02
200.000	EUR	Allianz SE, FRN, 1.30%, 25/09/2049	159	0,03
200.000	EUR	Allianz SE, FRN, 2.12%, 08/07/2050	163	0,03
400.000	EUR	Allianz SE, FRN, 4.25%, 05/07/2052	364	0,07
300.000	EUR	Allianz SE, FRN, 5.82%, 25/07/2053	303	0,06
100.000	EUR	Amphenol Technologies Holding GmbH, 0.75%, 04/05/2026	92	0,02
100.000	EUR	Amphenol Technologies Holding GmbH, 2.00%, 08/10/2028	92	0,02
300.000	EUR	Amprion GmbH, 3.45%, 22/09/2027	294	0,06
400.000	EUR	Amprion GmbH, 3.97%, 22/09/2032	390	0,08
150.000	EUR	BASF SE, 0.88%, 22/05/2025	144	0,03
400.000	EUR	BASF SE, 0.75%, 17/03/2026	371	0,07
200.000	EUR	BASF SE, 0.25%, 05/06/2027	177	0,04
250.000	EUR	BASF SE, 0.88%, 15/11/2027	225	0,04
200.000	EUR	BASF SE, 3.13%, 29/06/2028	194	0,04
200.000	EUR	BASF SE, 4.00%, 08/03/2029	200	0,04
300.000	EUR	BASF SE, 1.50%, 17/03/2031	253	0,05
100.000	EUR	BASF SE, 0.88%, 06/10/2031	80	0,02
100.000	EUR	BASF SE, 3.75%, 29/06/2032	96	0,02
200.000	EUR	BASF SE, 4.50%, 08/03/2035	199	0,04
100.000	EUR	BASF SE, 1.63%, 15/11/2037	71	0,01
300.000	EUR	Bayer AG, 0.05%, 12/01/2025	285	0,06
150.000	EUR	Bayer AG, 4.00%, 26/08/2026	150	0,03
300.000	EUR	Bayer AG, 0.75%, 06/01/2027	270	0,05
300.000	EUR	Bayer AG, 0.38%, 12/01/2029	247	0,05
150.000	EUR	Bayer AG, 4.25%, 26/08/2029	150	0,03
300.000	EUR	Bayer AG, 1.13%, 06/01/2030	246	0,05
200.000	EUR	Bayer AG, 0.63%, 12/07/2031	151	0,03
300.000	EUR	Bayer AG, 1.38%, 06/07/2032	233	0,05
325.000	EUR	Bayer AG, 4.63%, 26/05/2033	322	0,06
200.000	EUR	Bayer AG, 1.00%, 12/01/2036	132	0,03
100.000	EUR	Berlin Hyp AG, 1.25%, 22/01/2025	96	0,02
200.000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.38%, 25/01/2027	178	0,04
100.000	EUR	Berlin Hyp AG, 1.13%, 25/10/2027	89	0,02
200.000	EUR	Berlin Hyp AG, 1.50%, 18/04/2028	174	0,03
200.000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.38%, 21/04/2031	148	0,03
100.000	EUR	Bertelsmann SE & Co. KGaA, 1.25%, 29/09/2025	95	0,02
200.000	EUR	Bertelsmann SE & Co. KGaA, 1.13%, 27/04/2026	187	0,04
200.000	EUR	Bertelsmann SE & Co. KGaA, 2.00%, 01/04/2028	186	0,04
200.000	EUR	Bertelsmann SE & Co. KGaA, 3.50%, 29/05/2029	192	0,04
100.000	EUR	Bertelsmann SE & Co. KGaA, 1.50%, 15/05/2030	84	0,02
100.000	EUR	Clearstream Banking AG, 0.00%, 01/12/2025	92	0,02
200.000	EUR	Commerzbank AG, 0.10%, 11/09/2025	185	0,04
100.000	EUR	Commerzbank AG, 1.13%, 19/09/2025	94	0,02
300.000	EUR	Commerzbank AG, 1.00%, 04/03/2026	279	0,06
100.000	EUR	Commerzbank AG, 1.13%, 22/06/2026	92	0,02
100.000	EUR	Commerzbank AG, 0.50%, 04/12/2026	89	0,02
100.000	EUR	Commerzbank AG, 0.88%, 22/01/2027	89	0,02
175.000	EUR	Commerzbank AG, 0.38%, 01/09/2027	151	0,03
100.000	EUR	Commerzbank AG, 1.88%, 28/02/2028	90	0,02
100.000	EUR	Commerzbank AG, 1.50%, 28/08/2028	89	0,02
100.000	EUR	Commerzbank AG, FRN, 0.75%, 24/03/2026	94	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Germania (continua)				
200.000	EUR	Commerzbank AG, FRN, 3.00%, 14/09/2027	189	0,04
200.000	EUR	Commerzbank AG, FRN, 4.63%, 21/03/2028	197	0,04
100.000	EUR	Commerzbank AG, FRN, 5.13%, 18/01/2030	99	0,02
210.000	EUR	Continental AG, 0.38%, 27/06/2025	199	0,04
150.000	EUR	Continental AG, 2.50%, 27/08/2026	145	0,03
100.000	EUR	Continental AG, 3.63%, 30/11/2027	98	0,02
375.000	EUR	Continental AG, 4.00%, 01/06/2028	371	0,07
100.000	EUR	Covestro AG, 0.88%, 03/02/2026	94	0,02
200.000	EUR	Covestro AG, 4.75%, 15/11/2028	206	0,04
100.000	EUR	Covestro AG, 1.38%, 12/06/2030	86	0,02
300.000	EUR	Deutsche Bank AG, 2.75%, 17/02/2025	293	0,06
200.000	EUR	Deutsche Bank AG, 1.13%, 17/03/2025	190	0,04
100.000	EUR	Deutsche Bank AG, 2.63%, 12/02/2026	96	0,02
200.000	EUR	Deutsche Bank AG, 4.50%, 19/05/2026	199	0,04
400.000	EUR	Deutsche Bank AG, 1.63%, 20/01/2027	359	0,07
200.000	EUR	Deutsche Bank AG, 1.75%, 17/01/2028	175	0,03
200.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.00%, 19/11/2025	191	0,04
100.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.38%, 10/06/2026	95	0,02
200.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.38%, 03/09/2026	186	0,04
300.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 0.75%, 17/02/2027	270	0,05
400.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.88%, 23/02/2028	357	0,07
100.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 3.25%, 24/05/2028	93	0,02
100.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 5.38%, 11/01/2029	100	0,02
400.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 5.00%, 05/09/2030	385	0,08
300.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.75%, 19/11/2030	238	0,05
300.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 5.63%, 19/05/2031	291	0,06
400.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.38%, 17/02/2032	297	0,06
300.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 4.00%, 24/06/2032	268	0,05
300.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 1.63%, 08/10/2025	287	0,06
200.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 3.75%, 28/09/2029	199	0,04
100.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 0.13%, 22/02/2031	76	0,01
100.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 1.50%, 04/04/2032	82	0,02
200.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 3.88%, 28/09/2033	197	0,04
200.000	EUR	Deutsche Boerse AG, FRN, 1.25%, 16/06/2047	175	0,04
200.000	EUR	Deutsche Boerse AG, FRN, 2.00%, 23/06/2048	175	0,03
100.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.25%, 17/01/2025	94	0,02
100.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.25%, 27/10/2025	90	0,02
100.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.10%, 02/02/2026	89	0,02
100.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 4.38%, 28/08/2026	98	0,02
200.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 5.00%, 05/02/2027	205	0,04
200.000	EUR	Deutsche Post AG, 1.25%, 01/04/2026	191	0,04
250.000	EUR	Deutsche Post AG, 0.38%, 20/05/2026	230	0,05
75.000	EUR	Deutsche Post AG, 1.00%, 13/12/2027	68	0,01
125.000	EUR	Deutsche Post AG, 1.63%, 05/12/2028	114	0,02
200.000	EUR	Deutsche Post AG, 0.75%, 20/05/2029	172	0,03
150.000	EUR	Deutsche Post AG, 1.00%, 20/05/2032	122	0,02
225.000	EUR	Deutsche Post AG, 3.38%, 03/07/2033	214	0,04
100.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 0.88%, 25/03/2026	94	0,02
200.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 0.50%, 05/07/2027	180	0,04
300.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 1.75%, 25/03/2031	262	0,05
200.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 1.38%, 05/07/2034	156	0,03
100.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 2.25%, 29/03/2039	82	0,02
100.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 1.75%, 09/12/2049	64	0,01
100.000	EUR	Deutsche Wohnen SE, REIT, 1.00%, 30/04/2025	94	0,02
300.000	EUR	Deutsche Wohnen SE, REIT, 1.50%, 30/04/2030	250	0,05
100.000	EUR	Deutsche Wohnen SE, REIT, 1.30%, 07/04/2041	58	0,01
25.000	EUR	E.ON SE, 0.88%, 08/01/2025	24	–
400.000	EUR	E.ON SE, 1.00%, 07/10/2025	379	0,08
200.000	EUR	E.ON SE, 0.13%, 18/01/2026	184	0,04

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Germania (continua)				
200.000	EUR	E.ON SE, 0.25%, 24/10/2026	180	0,04
165.000	EUR	E.ON SE, 0.38%, 29/09/2027	144	0,03
200.000	EUR	E.ON SE, 3.50%, 12/01/2028	197	0,04
100.000	EUR	E.ON SE, 0.75%, 20/02/2028	88	0,02
100.000	EUR	E.ON SE, 2.88%, 26/08/2028	95	0,02
125.000	EUR	E.ON SE, 0.10%, 19/12/2028	104	0,02
125.000	EUR	E.ON SE, 3.75%, 01/03/2029	123	0,02
150.000	EUR	E.ON SE, 1.63%, 22/05/2029	133	0,03
150.000	EUR	E.ON SE, 0.35%, 28/02/2030	120	0,02
100.000	EUR	E.ON SE, 0.75%, 18/12/2030	82	0,02
250.000	EUR	E.ON SE, 1.63%, 29/03/2031	212	0,04
70.000	EUR	E.ON SE, 0.88%, 20/08/2031	55	0,01
250.000	EUR	E.ON SE, 0.63%, 07/11/2031	191	0,04
175.000	EUR	E.ON SE, 0.60%, 01/10/2032	130	0,03
100.000	EUR	E.ON SE, 4.00%, 29/08/2033	97	0,02
125.000	EUR	E.ON SE, 0.88%, 18/10/2034	90	0,02
175.000	EUR	E.ON SE, 3.88%, 12/01/2035	166	0,03
200.000	EUR	E.ON SE, 3.50%, 26/10/2037	180	0,04
200.000	EUR	Eurogrid GmbH, 1.88%, 10/06/2025	193	0,04
100.000	EUR	Eurogrid GmbH, 1.50%, 18/04/2028	90	0,02
200.000	EUR	Eurogrid GmbH, 3.72%, 27/04/2030	194	0,04
200.000	EUR	Eurogrid GmbH, 3.28%, 05/09/2031	188	0,04
100.000	EUR	Eurogrid GmbH, 1.11%, 15/05/2032	78	0,01
100.000	EUR	Eurogrid GmbH, 0.74%, 21/04/2033	72	0,01
100.000	EUR	Evonik Industries AG, 0.63%, 18/09/2025	93	0,02
400.000	EUR	Evonik Industries AG, 2.25%, 25/09/2027	372	0,07
75.000	EUR	Evonik Industries AG, 0.75%, 07/09/2028	65	0,01
150.000	EUR	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA, 1.50%, 11/07/2025	143	0,03
300.000	EUR	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA, 1.00%, 29/05/2026	277	0,06
300.000	EUR	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA, 3.88%, 20/09/2027	296	0,06
50.000	EUR	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA, 1.25%, 29/11/2029	41	0,01
200.000	EUR	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA, 1.50%, 29/05/2030	163	0,03
100.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 1.88%, 15/02/2025	97	0,02
150.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 1.88%, 24/05/2025	144	0,03
100.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 4.25%, 28/05/2026	100	0,02
100.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 0.38%, 28/09/2026	90	0,02
100.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 1.63%, 08/10/2027	90	0,02
100.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 0.75%, 15/01/2028	87	0,02
175.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 2.88%, 15/02/2029	163	0,03
100.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 5.00%, 28/11/2029	101	0,02
150.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 2.88%, 24/05/2030	133	0,03
150.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 1.13%, 28/01/2033	111	0,02
100.000	EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 6.25%, 18/11/2024	101	0,02
300.000	EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 4.88%, 17/03/2025	299	0,06
200.000	EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 0.38%, 09/03/2026	180	0,04
150.000	EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 4.88%, 30/03/2027	149	0,03
100.000	EUR	Hamburg Commercial Bank AG, FRN, 0.50%, 22/09/2026	90	0,02
100.000	EUR	Hannover Rueck SE, 1.13%, 18/04/2028	90	0,02
100.000	EUR	Hannover Rueck SE, FRN, 3.38%, 26/06/2025 ¹	96	0,02
200.000	EUR	Hannover Rueck SE, FRN, 1.13%, 09/10/2039	157	0,03
100.000	EUR	Hannover Rueck SE, FRN, 1.75%, 08/10/2040	79	0,02
100.000	EUR	Hannover Rueck SE, FRN, 1.38%, 30/06/2042	72	0,01
100.000	EUR	Hannover Rueck SE, FRN, 5.88%, 26/08/2043	102	0,02
175.000	EUR	Heidelberg Materials AG, 1.50%, 07/02/2025	168	0,03
150.000	EUR	Heidelberg Materials AG, 3.75%, 31/05/2032	138	0,03
100.000	EUR	Hella GmbH & Co. KGaA, 0.50%, 26/01/2027	88	0,02
400.000	EUR	Henkel AG & Co. KGaA, 2.63%, 13/09/2027	384	0,08
100.000	EUR	Henkel AG & Co. KGaA, 0.50%, 17/11/2032	75	0,01
250.000	EUR	Hochtief AG, 1.75%, 03/07/2025	239	0,05

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Germania (continua)				
50.000	EUR	Hochtief AG, 0.50%, 03/09/2027	44	0,01
175.000	EUR	Hochtief AG, 0.63%, 26/04/2029	142	0,03
200.000	EUR	Infineon Technologies AG, 0.63%, 17/02/2025	190	0,04
300.000	EUR	Infineon Technologies AG, 1.13%, 24/06/2026	278	0,06
200.000	EUR	Infineon Technologies AG, 1.63%, 24/06/2029	174	0,03
100.000	EUR	Infineon Technologies AG, 2.00%, 24/06/2032	84	0,02
200.000	EUR	KION Group AG, 1.63%, 24/09/2025	189	0,04
275.000	EUR	Knorr-Bremse AG, 1.13%, 13/06/2025	263	0,05
200.000	EUR	Knorr-Bremse AG, 3.25%, 21/09/2027	195	0,04
300.000	EUR	Lanxess AG, 1.13%, 16/05/2025	286	0,06
275.000	EUR	Lanxess AG, 0.00%, 08/09/2027	230	0,05
100.000	EUR	Lanxess AG, 1.75%, 22/03/2028	87	0,02
200.000	EUR	Lanxess AG, 0.63%, 01/12/2029	155	0,03
200.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 0.38%, 17/01/2026	181	0,04
200.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 0.88%, 28/11/2027	172	0,03
200.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 0.75%, 30/06/2031	143	0,03
100.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 1.00%, 19/11/2032	69	0,01
100.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 0.88%, 30/03/2033	68	0,01
200.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 1.50%, 17/01/2034	140	0,03
175.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.00%, 15/11/2027	157	0,03
350.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.38%, 11/05/2028	314	0,06
250.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.50%, 03/07/2029	220	0,04
150.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.75%, 08/02/2030	124	0,02
175.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 2.38%, 22/05/2030	159	0,03
200.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.75%, 10/09/2030	162	0,03
150.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 2.00%, 27/02/2031	132	0,03
300.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.13%, 06/11/2031	240	0,05
200.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.75%, 11/03/2033	149	0,03
100.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.13%, 08/08/2034	75	0,01
425.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 2.13%, 03/07/2037	336	0,07
200.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.13%, 16/07/2025	187	0,04
100.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 1.88%, 15/06/2026	95	0,02
100.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.38%, 05/07/2027	88	0,02
100.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.50%, 16/07/2028	86	0,02
200.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 2.38%, 15/06/2030	183	0,04
200.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.88%, 05/07/2031	161	0,03
200.000	EUR	Merck KGaA, FRN, 2.88%, 25/06/2079	177	0,04
200.000	EUR	Merck KGaA, FRN, 1.63%, 09/09/2080	179	0,04
100.000	EUR	Metro AG, 1.50%, 19/03/2025	96	0,02
100.000	EUR	MTU Aero Engines AG, 3.00%, 01/07/2025	98	0,02
100.000	EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.88%, 12/09/2025	93	0,02
100.000	EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.50%, 08/06/2026	89	0,02
100.000	EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.38%, 09/03/2029	81	0,02
300.000	EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG, FRN, 1.25%, 26/05/2041	227	0,05
200.000	EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG, FRN, 1.00%, 26/05/2042	143	0,03
200.000	EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG, FRN, 3.25%, 26/05/2049	181	0,04
200.000	EUR	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH, 1.75%, 05/07/2025	191	0,04
100.000	EUR	Robert Bosch GmbH, 3.63%, 02/06/2027	99	0,02
200.000	EUR	Robert Bosch GmbH, 3.63%, 02/06/2030	195	0,04
200.000	EUR	Robert Bosch GmbH, 4.00%, 02/06/2035	193	0,04
500.000	EUR	Robert Bosch GmbH, 4.38%, 02/06/2043	474	0,10
100.000	EUR	Santander Consumer Bank AG, 0.25%, 15/10/2024	96	0,02
300.000	EUR	Santander Consumer Bank AG, 4.50%, 30/06/2026	300	0,06
100.000	EUR	Santander Consumer Bank AG, 4.38%, 13/09/2027	100	0,02
200.000	EUR	SAP SE, 0.75%, 10/12/2024	193	0,04
100.000	EUR	SAP SE, 1.00%, 01/04/2025	97	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Germania (continua)				
100.000	EUR	SAP SE, 1.00%, 13/03/2026	94	0,02
200.000	EUR	SAP SE, 0.13%, 18/05/2026	183	0,04
100.000	EUR	SAP SE, 1.75%, 22/02/2027	97	0,02
100.000	EUR	SAP SE, 1.25%, 10/03/2028	90	0,02
200.000	EUR	SAP SE, 0.38%, 18/05/2029	167	0,03
200.000	EUR	SAP SE, 1.38%, 13/03/2030	175	0,03
200.000	EUR	SAP SE, 1.63%, 10/03/2031	176	0,03
100.000	EUR	Talanx AG, 2.50%, 23/07/2026	96	0,02
100.000	EUR	Talanx AG, 4.00%, 25/10/2029	99	0,02
100.000	EUR	Talanx AG, FRN, 1.75%, 01/12/2042	74	0,01
300.000	EUR	Talanx AG, FRN, 2.25%, 05/12/2047	264	0,05
200.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 2.88%, 12/06/2025	196	0,04
300.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 4.00%, 26/09/2027	299	0,06
200.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 1.50%, 25/09/2028	176	0,03
100.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 0.13%, 10/09/2029	79	0,02
100.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 4.63%, 26/09/2032	101	0,02
200.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 0.50%, 10/09/2034	132	0,03
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.00%, 01/12/2025	181	0,04
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.38%, 28/01/2026	93	0,02
300.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 4.75%, 23/05/2027	298	0,06
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.38%, 16/06/2027	169	0,03
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.88%, 28/06/2028	87	0,02
300.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.25%, 01/09/2028	239	0,05
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.63%, 14/12/2029	154	0,03
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 5.00%, 23/11/2030	99	0,02
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.63%, 24/03/2031	145	0,03
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 2.38%, 25/03/2032	162	0,03
300.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.75%, 01/09/2032	207	0,04
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.00%, 16/06/2033	137	0,03
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.50%, 14/06/2041	55	0,01
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.63%, 01/09/2051	95	0,02
200.000	EUR	WPP Finance Deutschland GmbH, 1.63%, 23/03/2030	171	0,03
100.000	EUR	Wuestenrot & Wuerttembergische AG, FRN, 2.13%, 10/09/2041	71	0,01
Germania - Totale			43.457	8,81
Guernsey (31 marzo 2023: 0,05%)				
200.000	EUR	Sirius Real Estate Ltd., REIT, 1.13%, 22/06/2026	176	0,03
100.000	EUR	Sirius Real Estate Ltd., REIT, 1.75%, 24/11/2028	79	0,02
Guernsey - Totale			255	0,05
Hong Kong (31 marzo 2023: 0,03%)				
200.000	EUR	AIA Group Ltd., FRN, 0.88%, 09/09/2033	159	0,03
Hong Kong - Totale			159	0,03
Ungheria (31 marzo 2023: 0,08%)				
100.000	EUR	MOL Hungarian Oil & Gas plc, 1.50%, 08/10/2027	87	0,02
125.000	EUR	OTP Bank Nyrt., FRN, 7.35%, 04/03/2026	127	0,03
100.000	EUR	OTP Bank Nyrt., FRN, 6.13%, 05/10/2027	100	0,02
Ungheria - Totale			314	0,07
Islanda (31 marzo 2023: 0,02%)				
			-	-
Irlanda (31 marzo 2023: 1,86%)				
100.000	EUR	Abbott Ireland Financing DAC, 0.10%, 19/11/2024	96	0,02

NM1123U-3256239-68/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Irlanda (continua)				
230.000	EUR	Abbott Ireland Financing DAC, 1.50%, 27/09/2026	216	0,04
150.000	EUR	Abbott Ireland Financing DAC, 0.38%, 19/11/2027	132	0,03
100.000	EUR	AIB Group plc, 2.25%, 03/07/2025	97	0,02
300.000	EUR	AIB Group plc, FRN, 3.63%, 04/07/2026	294	0,06
100.000	EUR	AIB Group plc, FRN, 0.50%, 17/11/2027	88	0,02
125.000	EUR	AIB Group plc, FRN, 2.25%, 04/04/2028	114	0,02
400.000	EUR	AIB Group plc, FRN, 5.75%, 16/02/2029	412	0,08
300.000	EUR	Atlas Copco Finance DAC, 0.75%, 08/02/2032	234	0,05
100.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 1.00%, 25/11/2025	96	0,02
325.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 1.88%, 05/06/2026	310	0,06
200.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 0.38%, 10/05/2027	179	0,04
300.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 4.88%, 16/07/2028	302	0,06
100.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 5.00%, 04/07/2031	100	0,02
200.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 1.38%, 11/08/2031	178	0,04
100.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 6.75%, 01/03/2033	103	0,02
500.000	EUR	CA Auto Bank SPA, 4.38%, 08/06/2026	500	0,10
150.000	EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.50%, 06/09/2029	123	0,02
125.000	EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.88%, 06/05/2033	93	0,02
200.000	EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 1.50%, 06/05/2041	131	0,03
150.000	EUR	CRH Finance DAC, 1.38%, 18/10/2028	132	0,03
150.000	EUR	CRH SMW Finance DAC, 1.25%, 05/11/2026	138	0,03
300.000	EUR	CRH SMW Finance DAC, 4.00%, 11/07/2031	292	0,06
100.000	EUR	Dell Bank International DAC, 0.50%, 27/10/2026	89	0,02
100.000	EUR	Dell Bank International DAC, 4.50%, 18/10/2027	101	0,02
150.000	EUR	DXC Capital Funding DAC, 0.45%, 15/09/2027	125	0,02
200.000	EUR	DXC Capital Funding DAC, 0.95%, 15/09/2031	140	0,03
100.000	EUR	Eaton Capital Unlimited Co., 0.70%, 14/05/2025	95	0,02
200.000	EUR	Eaton Capital Unlimited Co., 0.13%, 08/03/2026	182	0,04
300.000	EUR	Eaton Capital Unlimited Co., 0.58%, 08/03/2030	242	0,05
200.000	EUR	Experian Europe DAC, 1.56%, 16/05/2031	167	0,03
300.000	EUR	Fresenius Finance Ireland plc, 0.00%, 01/10/2025	276	0,05
150.000	EUR	Fresenius Finance Ireland plc, 2.13%, 01/02/2027	140	0,03
100.000	EUR	Fresenius Finance Ireland plc, 0.50%, 01/10/2028	83	0,02
100.000	EUR	Fresenius Finance Ireland plc, 0.88%, 01/10/2031	73	0,01
50.000	EUR	Grenke Finance plc, 0.63%, 09/01/2025	46	0,01
200.000	EUR	Grenke Finance plc, 7.88%, 06/04/2027	202	0,04
100.000	EUR	Hammerson Ireland Finance DAC, REIT, 1.75%, 03/06/2027	85	0,02
100.000	EUR	Johnson Controls International plc, 1.38%, 25/02/2025	96	0,02
150.000	EUR	Johnson Controls International plc, 0.38%, 15/09/2027	130	0,03
100.000	EUR	Johnson Controls International plc, 3.00%, 15/09/2028	95	0,02
125.000	EUR	Johnson Controls International plc, 1.00%, 15/09/2032	96	0,02
150.000	EUR	Johnson Controls International plc, 4.25%, 23/05/2035	144	0,03
200.000	EUR	Kerry Group Financial Services Unlimited Co., 2.38%, 10/09/2025	195	0,04
100.000	EUR	Kerry Group Financial Services Unlimited Co., 0.63%, 20/09/2029	82	0,02
200.000	EUR	Kerry Group Financial Services Unlimited Co., 0.88%, 01/12/2031	155	0,03
200.000	EUR	Linde plc, 0.00%, 30/09/2026	179	0,04
300.000	EUR	Linde plc, 1.00%, 31/03/2027	273	0,05
100.000	EUR	Linde plc, 1.38%, 31/03/2031	84	0,02
300.000	EUR	Linde plc, 0.38%, 30/09/2033	212	0,04
200.000	EUR	Linde plc, 3.63%, 12/06/2034	191	0,04
100.000	EUR	Linde plc, 1.63%, 31/03/2035	78	0,01
100.000	EUR	Linde plc, 1.00%, 30/09/2051	49	0,01
200.000	EUR	Ryanair DAC, 2.88%, 15/09/2025	196	0,04
300.000	EUR	Ryanair DAC, 0.88%, 25/05/2026	276	0,06
125.000	EUR	Securitas Treasury Ireland DAC, 4.38%, 06/03/2029	124	0,02
400.000	EUR	Smurfit Kappa Acquisitions ULC, 2.88%, 15/01/2026	389	0,08
400.000	EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC, 1.50%, 15/09/2027	362	0,07
100.000	EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC, 0.50%, 22/09/2029	81	0,02
100.000	EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC, 1.00%, 22/09/2033	73	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Irlanda (continua)				
150.000	EUR	Vodafone International Financing DAC, 3.25%, 02/03/2029	144	0,03
100.000	EUR	Vodafone International Financing DAC, 3.75%, 02/12/2034	94	0,02
125.000	EUR	Vodafone International Financing DAC, 4.00%, 10/02/2043	112	0,02
100.000	EUR	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co., 1.63%, 17/06/2039	70	0,01
200.000	EUR	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co., FRN, 1.88%, 17/09/2050	160	0,03
Irlanda - Totale			10.546	2,13
Italia (31 marzo 2023: 4,36%)				
100.000	EUR	Aeroporti di Roma SpA, 1.63%, 02/02/2029	87	0,02
100.000	EUR	Aeroporti di Roma SpA, 1.75%, 30/07/2031	80	0,02
150.000	EUR	Anima Holding SpA, 1.50%, 22/04/2028	129	0,03
200.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 4.13%, 04/05/2026	198	0,04
100.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 3.88%, 29/01/2029	96	0,02
150.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 2.12%, 01/10/2030	123	0,02
100.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 2.43%, 14/07/2031	81	0,02
150.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 1.71%, 30/06/2032	113	0,02
200.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.80%, 06/07/2032	204	0,04
200.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.27%, 12/09/2033	197	0,04
200.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, FRN, 4.60%, 21/11/2025 ¹	195	0,04
300.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, FRN, 5.50%, 27/10/2047	300	0,06
100.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, FRN, 5.00%, 08/06/2048	99	0,02
250.000	EUR	ASTM SpA, 1.00%, 25/11/2026	225	0,04
100.000	EUR	ASTM SpA, 1.63%, 08/02/2028	90	0,02
450.000	EUR	ASTM SpA, 1.50%, 25/01/2030	365	0,07
200.000	EUR	ASTM SpA, 2.38%, 25/11/2033	153	0,03
125.000	EUR	Azimut Holding SpA, 1.63%, 12/12/2024	121	0,02
200.000	EUR	Credito Emiliano SpA, FRN, 1.13%, 19/01/2028	179	0,04
100.000	EUR	Enel SpA, 5.63%, 21/06/2027	106	0,02
230.000	EUR	Enel SpA, FRN, 3.50%, 24/02/2025 ¹	222	0,04
150.000	EUR	Enel SpA, FRN, 3.38%, 24/08/2026 ¹	139	0,03
100.000	EUR	Enel SpA, FRN, 2.25%, 10/12/2026 ¹	88	0,02
100.000	EUR	Enel SpA, FRN, 1.38%, 08/06/2027 ¹	82	0,02
200.000	EUR	Enel SpA, FRN, 6.38%, 16/04/2028 ¹	202	0,04
150.000	EUR	Enel SpA, FRN, 1.88%, 08/06/2030 ¹	110	0,02
200.000	EUR	Enel SpA, FRN, 6.63%, 16/04/2031 ¹	202	0,04
350.000	EUR	Eni SpA, 1.00%, 14/03/2025	335	0,07
250.000	EUR	Eni SpA, 3.75%, 12/09/2025	249	0,05
200.000	EUR	Eni SpA, 1.50%, 02/02/2026	189	0,04
100.000	EUR	Eni SpA, 1.25%, 18/05/2026	93	0,02
150.000	EUR	Eni SpA, 1.50%, 17/01/2027	139	0,03
200.000	EUR	Eni SpA, 3.63%, 19/05/2027	197	0,04
100.000	EUR	Eni SpA, 1.63%, 17/05/2028	90	0,02
300.000	EUR	Eni SpA, 0.38%, 14/06/2028	254	0,05
100.000	EUR	Eni SpA, 1.13%, 19/09/2028	88	0,02
150.000	EUR	Eni SpA, 3.63%, 29/01/2029	147	0,03
200.000	EUR	Eni SpA, 0.63%, 23/01/2030	161	0,03
300.000	EUR	Eni SpA, 2.00%, 18/05/2031	257	0,05
200.000	EUR	Eni SpA, 4.25%, 19/05/2033	194	0,04
140.000	EUR	Eni SpA, 1.00%, 11/10/2034	99	0,02
225.000	EUR	Eni SpA, FRN, 2.63%, 13/10/2025 ¹	209	0,04
300.000	EUR	Eni SpA, FRN, 2.00%, 11/02/2027 ¹	256	0,05
325.000	EUR	Eni SpA, FRN, 3.38%, 13/07/2029 ¹	274	0,06
250.000	EUR	Eni SpA, FRN, 2.75%, 11/02/2030 ¹	197	0,04
200.000	EUR	ERG SpA, 1.88%, 11/04/2025	193	0,04
300.000	EUR	ERG SpA, 0.50%, 11/09/2027	259	0,05
100.000	EUR	ERG SpA, 0.88%, 15/09/2031	75	0,01
100.000	EUR	FinecoBank Banca Fineco SpA, FRN, 0.50%, 21/10/2027	88	0,02
100.000	EUR	FinecoBank Banca Fineco SpA, FRN, 4.63%, 23/02/2029	98	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Italia (continua)				
200.000	EUR	Genertel SpA, FRN, 4.25%, 14/12/2047	192	0,04
100.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.75%, 04/12/2024	96	0,02
250.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.63%, 21/04/2025	240	0,05
250.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 2.13%, 26/05/2025	241	0,05
300.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.63%, 24/02/2026	274	0,05
100.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.00%, 19/05/2026	99	0,02
250.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.00%, 19/11/2026	225	0,05
175.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.38%, 29/08/2027	173	0,03
300.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.75%, 06/09/2027	299	0,06
300.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.75%, 16/03/2028	255	0,05
150.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.75%, 20/03/2028	134	0,03
100.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.75%, 04/07/2029	85	0,02
100.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.25%, 13/01/2030	101	0,02
300.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.88%, 19/05/2030	296	0,06
250.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.35%, 24/02/2031	186	0,04
200.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.13%, 29/08/2031	198	0,04
150.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.63%, 08/03/2033	147	0,03
150.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, FRN, 5.00%, 08/03/2028	150	0,03
100.000	EUR	Iren SpA, 0.88%, 04/11/2024	96	0,02
300.000	EUR	Iren SpA, 1.95%, 19/09/2025	287	0,06
100.000	EUR	Iren SpA, 0.88%, 14/10/2029	82	0,02
250.000	EUR	Iren SpA, 1.00%, 01/07/2030	198	0,04
100.000	EUR	Iren SpA, 0.25%, 17/01/2031	73	0,01
200.000	EUR	Italgas SpA, 0.25%, 24/06/2025	187	0,04
200.000	EUR	Italgas SpA, 1.63%, 19/01/2027	186	0,04
100.000	EUR	Italgas SpA, 0.00%, 16/02/2028	84	0,02
100.000	EUR	Italgas SpA, 1.63%, 18/01/2029	89	0,02
200.000	EUR	Italgas SpA, 0.88%, 24/04/2030	161	0,03
200.000	EUR	Italgas SpA, 4.13%, 08/06/2032	192	0,04
150.000	EUR	Italgas SpA, 0.50%, 16/02/2033	105	0,02
100.000	EUR	Leasys SpA, 4.38%, 07/12/2024	100	0,02
300.000	EUR	Leasys SpA, 4.50%, 26/07/2026	300	0,06
250.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.13%, 23/04/2025	237	0,05
100.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.13%, 15/07/2025	95	0,02
150.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 0.88%, 15/01/2026	139	0,03
200.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.00%, 08/09/2027	178	0,04
200.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, FRN, 4.75%, 14/03/2028	200	0,04
100.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, FRN, 4.63%, 07/02/2029	99	0,02
175.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, FRN, 1.00%, 17/07/2029	147	0,03
200.000	EUR	Pirelli & C SpA, 4.25%, 18/01/2028	201	0,04
100.000	EUR	Snam SpA, 0.00%, 15/08/2025	93	0,02
200.000	EUR	Snam SpA, 1.25%, 28/08/2025	190	0,04
150.000	EUR	Snam SpA, 0.88%, 25/10/2026	136	0,03
100.000	EUR	Snam SpA, 3.38%, 05/12/2026	98	0,02
100.000	EUR	Snam SpA, 1.38%, 25/10/2027	91	0,02
250.000	EUR	Snam SpA, 0.00%, 07/12/2028	202	0,04
200.000	EUR	Snam SpA, 0.75%, 20/06/2029	165	0,03
100.000	EUR	Snam SpA, 0.75%, 17/06/2030	79	0,02
250.000	EUR	Snam SpA, 0.63%, 30/06/2031	189	0,04
100.000	EUR	Snam SpA, 1.25%, 20/06/2034	73	0,01
100.000	EUR	Snam SpA, 1.00%, 12/09/2034	70	0,01
200.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.13%, 25/07/2025	186	0,04
100.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.00%, 10/04/2026	93	0,02
200.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.38%, 26/07/2027	183	0,04
100.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.00%, 11/10/2028	87	0,02
300.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 3.63%, 21/04/2029	292	0,06
200.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.38%, 23/06/2029	163	0,03
125.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.38%, 25/09/2030	97	0,02
100.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.75%, 24/07/2032	75	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Italia (continua)				
100.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 3.88%, 24/07/2033	96	0,02
100.000	EUR	UniCredit SpA, 0.50%, 09/04/2025	94	0,02
300.000	EUR	UniCredit SpA, 0.33%, 19/01/2026	274	0,05
150.000	EUR	UniCredit SpA, 2.13%, 24/10/2026	141	0,03
400.000	EUR	UniCredit SpA, 0.85%, 19/01/2031	301	0,06
100.000	EUR	UniCredit SpA, 1.63%, 18/01/2032	77	0,02
205.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 1.25%, 16/06/2026	194	0,04
250.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 2.20%, 22/07/2027	231	0,05
200.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 5.85%, 15/11/2027	204	0,04
400.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 0.93%, 18/01/2028	354	0,07
300.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 4.80%, 17/01/2029	299	0,06
150.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 4.45%, 16/02/2029	145	0,03
250.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 0.80%, 05/07/2029	209	0,04
		Italia - Totale	20.335	4,13
Giappone (31 marzo 2023: 1,61%)				
200.000	EUR	Asahi Group Holdings Ltd., 0.16%, 23/10/2024	192	0,04
200.000	EUR	Asahi Group Holdings Ltd., 0.34%, 19/04/2027	176	0,03
100.000	EUR	Asahi Group Holdings Ltd., 0.54%, 23/10/2028	84	0,02
100.000	EUR	East Japan Railway Co., 2.61%, 08/09/2025	98	0,02
100.000	EUR	East Japan Railway Co., 3.25%, 08/09/2030	95	0,02
200.000	EUR	East Japan Railway Co., 3.98%, 05/09/2032	198	0,04
100.000	EUR	East Japan Railway Co., 1.85%, 13/04/2033	82	0,02
200.000	EUR	East Japan Railway Co., 0.77%, 15/09/2034	141	0,03
200.000	EUR	East Japan Railway Co., 1.10%, 15/09/2039	125	0,02
100.000	EUR	East Japan Railway Co., 4.11%, 22/02/2043	93	0,02
100.000	EUR	East Japan Railway Co., 4.39%, 05/09/2043	96	0,02
200.000	EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 0.85%, 19/07/2029	169	0,03
200.000	EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 3.56%, 15/06/2032	189	0,04
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.96%, 16/10/2024	97	0,02
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.21%, 07/10/2025	93	0,02
150.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.18%, 13/04/2026	136	0,03
200.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 1.63%, 08/04/2027	183	0,04
150.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 3.49%, 05/09/2027	145	0,03
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 1.60%, 10/04/2028	89	0,02
300.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 4.16%, 20/05/2028	295	0,06
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.40%, 06/09/2029	79	0,01
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.80%, 15/04/2030	79	0,01
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 4.61%, 28/08/2030	99	0,02
125.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.69%, 07/10/2030	97	0,02
200.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 2.10%, 08/04/2032	166	0,03
150.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 4.03%, 05/09/2032	144	0,03
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.84%, 12/04/2033	73	0,01
200.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 4.42%, 20/05/2033	194	0,04
200.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., FRN, 0.47%, 06/09/2029	163	0,03
200.000	EUR	Nissan Motor Co. Ltd., 2.65%, 17/03/2026	191	0,04
200.000	EUR	Nissan Motor Co. Ltd., 3.20%, 17/09/2028	181	0,04
300.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.01%, 03/03/2025	284	0,06
100.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.08%, 13/12/2025	92	0,02
150.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.40%, 13/12/2028	125	0,02
350.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.34%, 03/03/2030	280	0,06
300.000	EUR	ORIX Corp., 1.92%, 20/04/2026	284	0,06
200.000	EUR	ORIX Corp., 4.48%, 01/06/2028	201	0,04
100.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 0.93%, 11/10/2024	97	0,02
150.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 1.55%, 15/06/2026	140	0,03
100.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 1.41%, 14/06/2027	90	0,02
150.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 0.30%, 28/10/2027	129	0,03
250.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 0.63%, 23/10/2029	201	0,04

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Parteci- pazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Giappone (continua)				
100.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 4.49%, 12/06/2030	99	0,02
300.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 2.25%, 21/11/2026	284	0,06
200.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 0.75%, 09/07/2027	178	0,03
100.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 1.00%, 09/07/2029	84	0,02
400.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 3.00%, 21/11/2030	371	0,07
200.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 1.38%, 09/07/2032	159	0,03
275.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 2.00%, 09/07/2040	194	0,04
Giappone - Totale			7.534	1,52
Jersey (31 marzo 2023: 0,28%)				
250.000	EUR	Aptiv plc, 1.50%, 10/03/2025	240	0,05
100.000	EUR	Aptiv plc, 1.60%, 15/09/2028	88	0,02
250.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.50%, 12/10/2025	237	0,05
100.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.50%, 11/02/2030	85	0,02
100.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.13%, 08/10/2030	80	0,01
100.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.88%, 12/07/2032	81	0,01
300.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.88%, 14/03/2034	234	0,05
Jersey - Totale			1.045	0,21
Liechtenstein (31 marzo 2023: 0,05%)				
100.000	EUR	Swiss Life Finance I Ltd., 3.25%, 31/08/2029	94	0,02
200.000	EUR	Swiss Life Finance I Ltd., 0.50%, 15/09/2031	149	0,03
Totale Liechtenstein			243	0,05
Lussemburgo (31 marzo 2023: 4,78%)				
200.000	EUR	Acef Holding SCA, REIT, 0.75%, 14/06/2028	163	0,03
200.000	EUR	Acef Holding SCA, REIT, 1.25%, 26/04/2030	150	0,03
300.000	EUR	ArcelorMittal SA, 1.75%, 19/11/2025	284	0,06
100.000	EUR	ArcelorMittal SA, 4.88%, 26/09/2026	101	0,02
300.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, 0.38%, 15/04/2027	228	0,05
100.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, 1.63%, 31/01/2028	76	0,01
200.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, 1.45%, 09/07/2028	145	0,03
100.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, FRN, 2.88%, 12/01/2025 ¹	38	0,01
200.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, FRN, 1.63%, 15/04/2026 ¹	67	0,01
200.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.21%, 04/06/2026	186	0,04
125.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 0.33%, 13/08/2028	105	0,02
400.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 3.55%, 13/09/2029	388	0,08
200.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.21%, 12/02/2036	138	0,03
100.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.34%, 13/08/2041	59	0,01
250.000	EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 0.75%, 17/04/2026	229	0,05
200.000	EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 1.13%, 17/10/2028	172	0,03
300.000	EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 1.50%, 17/10/2031	233	0,05
100.000	EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.75%, 12/09/2025	96	0,02
150.000	EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.88%, 19/01/2026	143	0,03
300.000	EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.75%, 25/03/2027	278	0,06
200.000	EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.63%, 03/07/2029	173	0,03
100.000	EUR	CPI Property Group SA, REIT, 2.75%, 12/05/2026	84	0,02
100.000	EUR	CPI Property Group SA, REIT, 1.63%, 23/04/2027	75	0,01
150.000	EUR	CPI Property Group SA, REIT, 1.75%, 14/01/2030	94	0,02
200.000	EUR	CPI Property Group SA, REIT, 1.50%, 27/01/2031	111	0,02
125.000	EUR	Cromwell Ereit Lux Finco Sarl, REIT, 2.13%, 19/11/2025	110	0,02
400.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.20%, 18/03/2026	366	0,07
100.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.45%, 18/03/2028	86	0,02
300.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.75%, 18/09/2031	235	0,05
405.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 1.35%, 18/09/2039	269	0,05

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Lussemburgo (continua)				
100.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 1.80%, 18/09/2049	61	0,01
200.000	EUR	DH Europe Finance Sarl, 1.20%, 30/06/2027	182	0,04
300.000	EUR	Eurofins Scientific SE, 4.00%, 06/07/2029	289	0,06
200.000	EUR	Eurofins Scientific SE, 4.75%, 06/09/2030	198	0,04
200.000	EUR	Eurofins Scientific SE, 0.88%, 19/05/2031	149	0,03
200.000	EUR	GELF Bond Issuer I SA, REIT, 1.13%, 18/07/2029	163	0,03
300.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, 1.38%, 03/08/2026	262	0,05
100.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, 1.50%, 22/02/2027	85	0,02
200.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, 0.13%, 11/01/2028	153	0,03
100.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, FRN, 1.50%, 11/03/2026 ¹	47	0,01
100.000	EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 2.50%, 09/10/2024	98	0,02
200.000	EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.63%, 07/04/2026	188	0,04
100.000	EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.50%, 14/06/2027	92	0,02
250.000	EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.13%, 01/12/2027	222	0,04
100.000	EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.75%, 24/04/2028	90	0,02
100.000	EUR	Helvetia Europe SA, FRN, 2.75%, 30/09/2041	80	0,02
100.000	EUR	Highland Holdings Sarl, 0.32%, 15/12/2026	89	0,02
150.000	EUR	Highland Holdings Sarl, 0.93%, 15/12/2031	115	0,02
300.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 2.38%, 09/04/2025	292	0,06
200.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.50%, 29/11/2026	179	0,04
200.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.13%, 19/07/2027	174	0,03
300.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 2.25%, 26/05/2028	277	0,06
150.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 1.75%, 29/08/2029	131	0,03
250.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.50%, 03/09/2030	191	0,04
100.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.50%, 23/04/2031	75	0,01
100.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.63%, 19/01/2033	71	0,01
100.000	EUR	John Deere Bank SA, 2.50%, 14/09/2026	96	0,02
150.000	EUR	John Deere Cash Management SARL, 1.85%, 02/04/2028	139	0,03
200.000	EUR	John Deere Cash Management SARL, 2.20%, 02/04/2032	177	0,04
100.000	EUR	John Deere Cash Management SARL, 1.65%, 13/06/2039	72	0,01
150.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.25%, 02/07/2025	141	0,03
100.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 2.63%, 15/10/2025	97	0,02
300.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.13%, 07/03/2027	273	0,05
200.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.38%, 15/10/2028	168	0,03
450.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.00%, 15/10/2028	432	0,09
100.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.63%, 07/03/2031	85	0,02
350.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.00%, 02/07/2031	282	0,06
150.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.13%, 15/10/2031	141	0,03
200.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.75%, 15/10/2032	151	0,03
300.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.38%, 15/10/2034	278	0,06
300.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 2.25%, 07/03/2039	228	0,05
100.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.50%, 02/07/2039	67	0,01
275.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.38%, 15/10/2040	174	0,03
150.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.75%, 02/07/2049	88	0,02
225.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.63%, 15/10/2050	126	0,03
100.000	EUR	Mohawk Capital Finance SA, 1.75%, 12/06/2027	92	0,02
250.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.13%, 01/04/2026	236	0,05
325.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.00%, 14/06/2026	295	0,06
75.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.88%, 29/03/2027	69	0,01
225.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.13%, 12/11/2027	198	0,04
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 3.00%, 15/03/2028	98	0,02
275.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.25%, 14/06/2029	230	0,05
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.25%, 02/11/2029	88	0,02
225.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.50%, 01/04/2030	198	0,04
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 3.25%, 15/01/2031	97	0,02
200.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.25%, 29/03/2031	169	0,03
225.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.38%, 12/05/2032	173	0,03
150.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.00%, 03/03/2033	107	0,02
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 3.75%, 13/03/2033	100	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Parteci- pazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Lussemburgo (continua)				
75.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.63%, 14/02/2034	56	0,01
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 3.38%, 15/11/2034	96	0,02
175.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.50%, 29/03/2035	137	0,03
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.75%, 02/11/2037	77	0,02
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.38%, 03/12/2040	58	0,01
175.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.88%, 14/06/2041	109	0,02
150.000	EUR	Novartis Finance SA, 1.63%, 09/11/2026	141	0,03
100.000	EUR	Novartis Finance SA, 1.13%, 30/09/2027	91	0,02
350.000	EUR	Novartis Finance SA, 0.00%, 23/09/2028	294	0,06
250.000	EUR	Novartis Finance SA, 1.38%, 14/08/2030	218	0,04
100.000	EUR	Novartis Finance SA, 1.70%, 14/08/2038	77	0,02
200.000	EUR	Repsol Europe Finance Sarl, 0.38%, 06/07/2029	164	0,03
200.000	EUR	Repsol Europe Finance Sarl, 0.88%, 06/07/2033	147	0,03
100.000	EUR	Segro Capital Sarl, REIT, 1.25%, 23/03/2026	92	0,02
300.000	EUR	Segro Capital Sarl, REIT, 1.88%, 23/03/2030	254	0,05
100.000	EUR	Segro Capital Sarl, REIT, 0.50%, 22/09/2031	72	0,01
150.000	EUR	SES SA, 1.63%, 22/03/2026	141	0,03
250.000	EUR	SES SA, 2.00%, 02/07/2028	222	0,04
100.000	EUR	SES SA, 3.50%, 14/01/2029	93	0,02
200.000	EUR	Simon International Finance SCA, REIT, 1.13%, 19/03/2033	143	0,03
200.000	EUR	Swiss Re Finance Luxembourg SA, FRN, 2.53%, 30/04/2050	169	0,03
300.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 0.13%, 24/03/2025	281	0,06
300.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 4.00%, 16/09/2025	297	0,06
100.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 4.13%, 22/11/2025	99	0,02
200.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 4.25%, 16/05/2028	197	0,04
200.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 0.75%, 24/03/2029	164	0,03
200.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 1.25%, 24/03/2033	145	0,03
200.000	EUR	Tyco Electronics Group SA, 0.00%, 14/02/2025	189	0,04
100.000	EUR	Tyco Electronics Group SA, 0.00%, 16/02/2029	82	0,02
200.000	EUR	Whirlpool Finance Luxembourg Sarl, 1.25%, 02/11/2026	183	0,04
150.000	EUR	Whirlpool Finance Luxembourg Sarl, 1.10%, 09/11/2027	133	0,03
		Lussemburgo - Totale	18.821	3,81
Messico (31 marzo 2023: 0,04%)				
100.000	EUR	America Movil SAB de CV, 0.75%, 26/06/2027	89	0,02
100.000	EUR	America Movil SAB de CV, 2.13%, 10/03/2028	93	0,02
		Messico - Totale	182	0,04
Paesi Bassi (31 marzo 2023: 16,88%)				
200.000	EUR	ABB Finance BV, 0.00%, 19/01/2030	156	0,03
300.000	EUR	ABB Finance BV, 3.38%, 16/01/2031	288	0,06
300.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.00%, 16/04/2025	287	0,06
400.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.75%, 20/04/2025	398	0,08
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.88%, 22/04/2025	191	0,04
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.25%, 28/05/2025	191	0,04
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.63%, 10/01/2026	198	0,04
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.50%, 15/04/2026	184	0,04
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.88%, 21/12/2026	199	0,04
300.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.60%, 15/01/2027	266	0,05
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 2.38%, 01/06/2027	187	0,04
100.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.00%, 16/01/2028	98	0,02
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.38%, 20/10/2028	199	0,04
300.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.50%, 23/09/2029	238	0,05
300.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.25%, 21/02/2030	294	0,06
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.00%, 01/06/2032	181	0,04
100.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.00%, 02/06/2033	75	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Parteci- pazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Paesi Bassi (continua)				
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.25%, 20/01/2034	148	0,03
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.50%, 21/11/2034	196	0,04
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, FRN, 5.13%, 22/02/2033	195	0,04
100.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, FRN, 5.50%, 21/09/2033	99	0,02
100.000	EUR	Achmea BV, 3.63%, 29/11/2025	99	0,02
150.000	EUR	Achmea BV, 1.50%, 26/05/2027	138	0,03
150.000	EUR	Achmea BV, FRN, 4.25%, 04/02/2025 ¹	146	0,03
100.000	EUR	Achmea BV, FRN, 6.75%, 26/12/2043	99	0,02
150.000	EUR	Adecco International Financial Services BV, 1.00%, 02/12/2024	145	0,03
200.000	EUR	Adecco International Financial Services BV, 0.13%, 21/09/2028	166	0,03
100.000	EUR	Adecco International Financial Services BV, 0.50%, 21/09/2031	74	0,01
250.000	EUR	Adecco International Financial Services BV, FRN, 1.00%, 21/03/2082	199	0,04
300.000	EUR	AGCO International Holdings BV, 0.80%, 06/10/2028	248	0,05
100.000	EUR	Akelius Residential Property Financing BV, REIT, 1.00%, 17/01/2028	82	0,02
125.000	EUR	Akelius Residential Property Financing BV, REIT, 1.13%, 11/01/2029	99	0,02
300.000	EUR	Akelius Residential Property Financing BV, REIT, 0.75%, 22/02/2030	219	0,04
200.000	EUR	Akzo Nobel NV, 1.75%, 07/11/2024	195	0,04
100.000	EUR	Akzo Nobel NV, 1.50%, 28/03/2028	90	0,02
150.000	EUR	Akzo Nobel NV, 1.63%, 14/04/2030	127	0,02
100.000	EUR	Akzo Nobel NV, 2.00%, 28/03/2032	83	0,02
150.000	EUR	Akzo Nobel NV, 4.00%, 24/05/2033	144	0,03
100.000	EUR	Alcon Finance BV, 2.38%, 31/05/2028	93	0,02
200.000	EUR	Allianz Finance II BV, 0.88%, 15/01/2026	188	0,04
300.000	EUR	Allianz Finance II BV, 0.00%, 22/11/2026	268	0,05
200.000	EUR	Allianz Finance II BV, 3.00%, 13/03/2028	195	0,04
200.000	EUR	Allianz Finance II BV, 1.50%, 15/01/2030	175	0,03
100.000	EUR	Allianz Finance II BV, 0.50%, 14/01/2031	79	0,02
100.000	EUR	Allianz Finance II BV, 1.38%, 21/04/2031	85	0,02
100.000	EUR	Allianz Finance II BV, 0.50%, 22/11/2033	72	0,01
300.000	EUR	American Medical Systems Europe BV, 0.75%, 08/03/2025	286	0,06
200.000	EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.38%, 08/03/2028	179	0,04
200.000	EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.88%, 08/03/2034	158	0,03
300.000	EUR	Arcadis NV, 4.88%, 28/02/2028	297	0,06
300.000	EUR	ASML Holding NV, 3.50%, 06/12/2025	298	0,06
350.000	EUR	ASML Holding NV, 1.38%, 07/07/2026	329	0,07
100.000	EUR	ASML Holding NV, 1.63%, 28/05/2027	93	0,02
200.000	EUR	ASML Holding NV, 0.63%, 07/05/2029	170	0,03
125.000	EUR	ASML Holding NV, 0.25%, 25/02/2030	101	0,02
100.000	EUR	ASML Holding NV, 2.25%, 17/05/2032	90	0,02
200.000	EUR	ASR Nederland NV, FRN, 7.00%, 07/12/2043	205	0,04
250.000	EUR	ASR Nederland NV, FRN, 5.13%, 29/09/2045	246	0,05
100.000	EUR	ASR Nederland NV, FRN, 3.38%, 02/05/2049	87	0,02
100.000	EUR	Athora Netherlands NV, FRN, 2.25%, 15/07/2031	84	0,02
150.000	EUR	Athora Netherlands NV, FRN, 5.38%, 31/08/2032	139	0,03
100.000	EUR	BASF Finance Europe NV, 0.75%, 10/11/2026	92	0,02
100.000	EUR	Bayer Capital Corp. BV, 1.50%, 26/06/2026	93	0,02
300.000	EUR	Bayer Capital Corp. BV, 2.13%, 15/12/2029	264	0,05
250.000	EUR	BMW Finance NV, 1.00%, 14/11/2024	242	0,05
50.000	EUR	BMW Finance NV, 1.00%, 21/01/2025	48	0,01
325.000	EUR	BMW Finance NV, 0.50%, 22/02/2025	310	0,06
300.000	EUR	BMW Finance NV, 3.50%, 06/04/2025	297	0,06
100.000	EUR	BMW Finance NV, 1.00%, 29/08/2025	95	0,02
250.000	EUR	BMW Finance NV, 0.00%, 11/01/2026	230	0,05
400.000	EUR	BMW Finance NV, 1.13%, 22/05/2026	374	0,08
150.000	EUR	BMW Finance NV, 0.75%, 13/07/2026	139	0,03
150.000	EUR	BMW Finance NV, 0.38%, 14/01/2027	135	0,03
150.000	EUR	BMW Finance NV, 0.38%, 24/09/2027	132	0,03
200.000	EUR	BMW Finance NV, 1.13%, 10/01/2028	180	0,04
200.000	EUR	BMW Finance NV, 1.00%, 22/05/2028	176	0,03

NM1123U-3256239-76/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Paesi Bassi (continua)				
250.000	EUR	BMW Finance NV, 1.50%, 06/02/2029	222	0,04
200.000	EUR	BMW Finance NV, 3.25%, 22/07/2030	192	0,04
100.000	EUR	BMW Finance NV, 0.88%, 14/01/2032	80	0,02
100.000	EUR	BMW Finance NV, 0.20%, 11/01/2033	72	0,01
300.000	EUR	BMW Finance NV, 3.63%, 22/05/2035	283	0,06
200.000	EUR	BP Capital Markets BV, 4.32%, 12/05/2035	194	0,04
200.000	EUR	BP Capital Markets BV, 0.93%, 04/12/2040	113	0,02
200.000	EUR	BP Capital Markets BV, 1.47%, 21/09/2041	121	0,02
200.000	EUR	Brenntag Finance BV, 1.13%, 27/09/2025	189	0,04
100.000	EUR	Brenntag Finance BV, 0.50%, 06/10/2029	79	0,02
100.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 1.88%, 11/11/2024	98	0,02
300.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 2.75%, 23/09/2025	293	0,06
150.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 1.00%, 14/05/2027	135	0,03
200.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 0.63%, 21/11/2029	163	0,03
100.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 1.63%, 14/05/2031	84	0,02
300.000	EUR	Coloplast Finance BV, 2.25%, 19/05/2027	282	0,06
300.000	EUR	Coloplast Finance BV, 2.75%, 19/05/2030	275	0,05
100.000	EUR	Compass Group Finance Netherlands BV, 1.50%, 05/09/2028	90	0,02
100.000	EUR	Compass Group Finance Netherlands BV, 3.00%, 08/03/2030	94	0,02
350.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 4.13%, 14/07/2025	352	0,07
360.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.25%, 23/03/2026	340	0,07
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.25%, 30/10/2026	180	0,04
400.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.38%, 03/02/2027	371	0,07
300.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 4.00%, 10/01/2030	293	0,06
300.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.13%, 07/05/2031	241	0,05
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.63%, 25/02/2033	147	0,03
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 0.38%, 01/12/2027	177	0,04
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 4.63%, 27/01/2028	201	0,04
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 0.88%, 05/05/2028	177	0,04
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 4.23%, 25/04/2029	197	0,04
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 3.88%, 30/11/2032	190	0,04
100.000	EUR	CRH Funding BV, 1.63%, 05/05/2030	85	0,02
100.000	EUR	CTP NV, REIT, 0.50%, 21/06/2025	91	0,02
300.000	EUR	CTP NV, REIT, 0.88%, 20/01/2026	267	0,05
200.000	EUR	CTP NV, REIT, 0.63%, 27/09/2026	170	0,03
200.000	EUR	CTP NV, REIT, 1.25%, 21/06/2029	150	0,03
100.000	EUR	CTP NV, REIT, 1.50%, 27/09/2031	71	0,01
100.000	EUR	Daimler Truck International Finance BV, 1.25%, 06/04/2025	96	0,02
400.000	EUR	Daimler Truck International Finance BV, 1.63%, 06/04/2027	367	0,07
300.000	EUR	Daimler Truck International Finance BV, 3.88%, 19/06/2029	293	0,06
100.000	EUR	de Volksbank NV, 4.63%, 23/11/2027	99	0,02
100.000	EUR	de Volksbank NV, 0.38%, 03/03/2028	83	0,02
200.000	EUR	de Volksbank NV, 4.88%, 07/03/2030	198	0,04
100.000	EUR	de Volksbank NV, FRN, 2.38%, 04/05/2027	94	0,02
100.000	EUR	de Volksbank NV, FRN, 1.75%, 22/10/2030	92	0,02
100.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 0.63%, 13/12/2024	97	0,02
100.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.38%, 01/12/2025	96	0,02
200.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.13%, 22/05/2026	188	0,04
200.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.38%, 30/01/2027	185	0,04
150.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 3.25%, 17/01/2028	148	0,03
400.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.50%, 03/04/2028	364	0,07
300.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 2.00%, 01/12/2029	273	0,05
100.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 4.50%, 28/10/2030	104	0,02
100.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 7.50%, 24/01/2033	127	0,02
200.000	EUR	Diageo Capital BV, 0.13%, 28/09/2028	168	0,03
100.000	EUR	Diageo Capital BV, 1.50%, 08/06/2029	88	0,02
200.000	EUR	Diageo Capital BV, 1.88%, 08/06/2034	163	0,03
300.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 0.63%, 15/07/2025	278	0,06
200.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 1.50%, 15/03/2030	161	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Paesi Bassi (continua)				
200.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 1.25%, 01/02/2031	153	0,03
100.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 1.00%, 15/01/2032	72	0,01
100.000	EUR	Digital Intrepid Holding BV, REIT, 0.63%, 15/07/2031	71	0,01
150.000	EUR	Digital Intrepid Holding BV, REIT, 1.38%, 18/07/2032	110	0,02
100.000	EUR	DSM BV, 1.00%, 09/04/2025	96	0,02
100.000	EUR	DSM BV, 0.75%, 28/09/2026	92	0,02
100.000	EUR	DSM BV, 0.25%, 23/06/2028	85	0,02
100.000	EUR	DSM BV, 0.63%, 23/06/2032	75	0,01
200.000	EUR	DSV Finance BV, 1.38%, 16/03/2030	171	0,03
100.000	EUR	DSV Finance BV, 0.50%, 03/03/2031	78	0,01
150.000	EUR	DSV Finance BV, 0.88%, 17/09/2036	99	0,02
225.000	EUR	E.ON International Finance BV, 1.00%, 13/04/2025	215	0,04
20.000	EUR	E.ON International Finance BV, 1.63%, 30/05/2026	19	–
175.000	EUR	E.ON International Finance BV, 1.25%, 19/10/2027	158	0,03
280.000	EUR	E.ON International Finance BV, 1.50%, 31/07/2029	247	0,05
100.000	EUR	E.ON International Finance BV, 5.75%, 14/02/2033	111	0,02
550.000	EUR	easyJet FinCo. BV, 1.88%, 03/03/2028	482	0,10
200.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.97%, 27/01/2025	195	0,04
150.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.50%, 21/07/2025	143	0,03
100.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.25%, 17/11/2025	92	0,02
325.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.00%, 28/05/2026	292	0,06
300.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.38%, 01/06/2026	281	0,06
200.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.13%, 16/09/2026	185	0,04
350.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.00%, 17/06/2027	301	0,06
200.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.38%, 17/06/2027	175	0,03
300.000	EUR	Enel Finance International NV, 3.88%, 09/03/2029	296	0,06
300.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.38%, 28/05/2029	244	0,05
350.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.50%, 17/06/2030	273	0,05
100.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.88%, 17/01/2031	78	0,01
100.000	EUR	Enel Finance International NV, 4.00%, 20/02/2031	97	0,02
175.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.88%, 28/09/2034	120	0,02
200.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.13%, 17/10/2034	140	0,03
125.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.25%, 17/01/2035	89	0,02
250.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.88%, 17/06/2036	160	0,03
125.000	EUR	Enel Finance International NV, 4.50%, 20/02/2043	114	0,02
100.000	EUR	Essity Capital BV, 3.00%, 21/09/2026	97	0,02
250.000	EUR	Essity Capital BV, 0.25%, 15/09/2029	201	0,04
200.000	EUR	Euronext NV, 0.13%, 17/05/2026	181	0,04
200.000	EUR	Euronext NV, 1.13%, 12/06/2029	173	0,03
200.000	EUR	Euronext NV, 0.75%, 17/05/2031	157	0,03
200.000	EUR	Euronext NV, 1.50%, 17/05/2041	131	0,03
140.000	EUR	EXOR NV, 2.50%, 08/10/2024	137	0,03
100.000	EUR	EXOR NV, 2.25%, 29/04/2030	88	0,02
100.000	EUR	EXOR NV, 0.88%, 19/01/2031	78	0,01
100.000	EUR	EXOR NV, 1.75%, 14/10/2034	75	0,01
200.000	EUR	Ferrovial SE, 4.38%, 13/09/2030	197	0,04
200.000	EUR	Givaudan Finance Europe BV, 1.63%, 22/04/2032	164	0,03
100.000	EUR	GSK Capital BV, 3.00%, 28/11/2027	97	0,02
150.000	EUR	GSK Capital BV, 3.13%, 28/11/2032	141	0,03
300.000	EUR	H&M Finance BV, 0.25%, 25/08/2029	240	0,05
200.000	EUR	Haleon Netherlands Capital BV, 1.25%, 29/03/2026	187	0,04
150.000	EUR	Haleon Netherlands Capital BV, 1.75%, 29/03/2030	129	0,03
200.000	EUR	Haleon Netherlands Capital BV, 2.13%, 29/03/2034	162	0,03
150.000	EUR	Heineken NV, 1.63%, 30/03/2025	145	0,03
150.000	EUR	Heineken NV, 2.88%, 04/08/2025	148	0,03
200.000	EUR	Heineken NV, 1.00%, 04/05/2026	187	0,04
150.000	EUR	Heineken NV, 1.38%, 29/01/2027	139	0,03
100.000	EUR	Heineken NV, 1.25%, 17/03/2027	92	0,02
300.000	EUR	Heineken NV, 1.50%, 03/10/2029	263	0,05

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Paesi Bassi (continua)				
150.000	EUR	Heineken NV, 2.25%, 30/03/2030	136	0,03
100.000	EUR	Heineken NV, 3.88%, 23/09/2030	99	0,02
150.000	EUR	Heineken NV, 1.75%, 17/03/2031	129	0,03
200.000	EUR	Heineken NV, 1.25%, 07/05/2033	155	0,03
200.000	EUR	Heineken NV, 4.13%, 23/03/2035	197	0,04
200.000	EUR	Heineken NV, 1.75%, 07/05/2040	141	0,03
100.000	EUR	Iberdrola International BV, 0.38%, 15/09/2025	94	0,02
300.000	EUR	Iberdrola International BV, 1.13%, 21/04/2026	282	0,06
200.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 3.25%, 12/11/2024 ¹	195	0,04
400.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.87%, 28/01/2026 ¹	362	0,07
200.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.45%, 09/11/2026 ¹	173	0,03
300.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 2.25%, 28/01/2029 ¹	246	0,05
100.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.83%, 09/08/2029 ¹	78	0,02
100.000	EUR	IMCD NV, 2.13%, 31/03/2027	91	0,02
200.000	EUR	IMCD NV, 4.88%, 18/09/2028	198	0,04
200.000	EUR	ING Bank NV, 4.13%, 02/10/2026	200	0,04
200.000	EUR	ING Groep NV, 2.13%, 10/01/2026	192	0,04
200.000	EUR	ING Groep NV, 1.38%, 11/01/2028	180	0,04
300.000	EUR	ING Groep NV, 2.00%, 20/09/2028	272	0,05
200.000	EUR	ING Groep NV, 2.50%, 15/11/2030	180	0,04
400.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.13%, 29/11/2025	381	0,08
300.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 2.13%, 23/05/2026	289	0,06
500.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 1.25%, 16/02/2027	463	0,09
100.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.38%, 29/09/2028	85	0,02
400.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.25%, 18/02/2029	330	0,06
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 4.50%, 23/05/2029	198	0,04
100.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 1.63%, 26/09/2029	96	0,02
400.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.25%, 01/02/2030	316	0,06
100.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 2.00%, 22/03/2030	95	0,02
100.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 1.00%, 13/11/2030	91	0,02
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.88%, 29/11/2030	160	0,03
300.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 1.75%, 16/02/2031	252	0,05
400.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 2.13%, 26/05/2031	368	0,07
100.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.88%, 09/06/2032	85	0,02
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 1.00%, 16/11/2032	167	0,03
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 4.13%, 24/08/2033	189	0,04
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 5.25%, 14/11/2033	206	0,04
400.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 4.75%, 23/05/2034	395	0,08
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 5.00%, 20/02/2035	192	0,04
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.63%, 30/04/2025	96	0,02
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.75%, 25/06/2026	94	0,02
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 2.50%, 17/04/2027	94	0,02
200.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.00%, 20/12/2027	176	0,03
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 2.00%, 18/05/2028	91	0,02
200.000	EUR	JAB Holdings BV, 2.50%, 25/06/2029	182	0,04
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.00%, 14/07/2031	77	0,01
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 4.75%, 29/06/2032	99	0,02
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 5.00%, 12/06/2033	99	0,02
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 3.38%, 17/04/2035	86	0,02
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 2.25%, 19/12/2039	67	0,01
100.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.24%, 16/01/2025	95	0,02
200.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.00%, 16/01/2026	182	0,04
100.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.63%, 09/02/2028	86	0,02
200.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.50%, 16/01/2029	163	0,03
100.000	EUR	JDE Peet's NV, 1.13%, 16/06/2033	73	0,01
200.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 0.25%, 26/06/2025	188	0,04
100.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1.13%, 19/03/2026	94	0,02
200.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1.75%, 02/04/2027	187	0,04
100.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 0.38%, 18/03/2030	80	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Parteci- pazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Paesi Bassi (continua)				
200.000	EUR	Koninklijke KPN NV, 0.63%, 09/04/2025	190	0,04
100.000	EUR	Koninklijke KPN NV, 1.13%, 11/09/2028	88	0,02
200.000	EUR	Koninklijke KPN NV, 3.88%, 03/07/2031	194	0,04
100.000	EUR	Koninklijke KPN NV, 0.88%, 14/12/2032	75	0,01
200.000	EUR	Koninklijke KPN NV, 0.88%, 15/11/2033	147	0,03
300.000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 2.13%, 06/05/2025	290	0,06
325.000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 0.25%, 23/02/2026	294	0,06
350.000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 0.25%, 07/09/2026	310	0,06
100.000	EUR	Linde Finance BV, 0.25%, 19/05/2027	88	0,02
150.000	EUR	Linde Finance BV, 1.00%, 20/04/2028	136	0,03
100.000	EUR	Linde Finance BV, 0.55%, 19/05/2032	76	0,01
100.000	EUR	Lseg Netherlands BV, 0.00%, 06/04/2025	94	0,02
100.000	EUR	Lseg Netherlands BV, 0.25%, 06/04/2028	85	0,02
125.000	EUR	Lseg Netherlands BV, 4.23%, 29/09/2030	125	0,02
100.000	EUR	Lseg Netherlands BV, 0.75%, 06/04/2033	73	0,01
100.000	EUR	LYB International Finance II BV, 0.88%, 17/09/2026	90	0,02
100.000	EUR	LYB International Finance II BV, 1.63%, 17/09/2031	80	0,02
150.000	EUR	Madrilena Red de Gas Finance BV, 2.25%, 11/04/2029	128	0,03
150.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.85%, 28/02/2025	144	0,03
200.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 2.63%, 07/04/2025	196	0,04
200.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.40%, 13/04/2025	198	0,04
250.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.00%, 11/11/2025	237	0,05
300.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.50%, 09/03/2026	285	0,06
350.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.50%, 30/05/2026	347	0,07
300.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.38%, 26/06/2026	282	0,06
225.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 2.00%, 22/08/2026	215	0,04
150.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.38%, 08/11/2026	136	0,03
225.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.50%, 09/02/2027	209	0,04
300.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.63%, 06/05/2027	269	0,05
125.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.70%, 30/05/2031	123	0,02
400.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.00%, 22/09/2026	358	0,07
100.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.25%, 09/09/2029	81	0,02
100.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.38%, 22/09/2029	81	0,02
100.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.88%, 01/10/2031	79	0,02
200.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.63%, 09/09/2032	148	0,03
250.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 1.25%, 09/09/2041	153	0,03
100.000	EUR	Nationale-Nederlanden Bank NV (The) Netherlands, 0.50%, 21/09/2028	83	0,02
100.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.38%, 21/01/2025	96	0,02
100.000	EUR	Naturgy Finance BV, 0.88%, 15/05/2025	95	0,02
300.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.25%, 15/01/2026	282	0,06
100.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.25%, 19/04/2026	93	0,02
300.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.38%, 19/01/2027	276	0,06
100.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.50%, 29/01/2028	91	0,02
200.000	EUR	Naturgy Finance BV, 0.75%, 28/11/2029	166	0,03
100.000	EUR	NE Property BV, REIT, 1.75%, 23/11/2024	96	0,02
100.000	EUR	NE Property BV, REIT, 1.88%, 09/10/2026	89	0,02
100.000	EUR	NE Property BV, REIT, 3.38%, 14/07/2027	92	0,02
100.000	EUR	NE Property BV, REIT, 2.00%, 20/01/2030	77	0,01
100.000	EUR	NIBC Bank NV, 0.88%, 08/07/2025	94	0,02
100.000	EUR	NIBC Bank NV, 0.25%, 09/09/2026	87	0,02
100.000	EUR	NIBC Bank NV, 0.88%, 24/06/2027	87	0,02
200.000	EUR	NN Group NV, 1.63%, 01/06/2027	184	0,04
200.000	EUR	NN Group NV, 0.88%, 23/11/2031	157	0,03
200.000	EUR	NN Group NV, FRN, 4.50%, 15/01/2026 ¹	193	0,04
100.000	EUR	NN Group NV, FRN, 5.25%, 01/03/2043	93	0,02
126.000	EUR	NN Group NV, FRN, 6.00%, 03/11/2043	122	0,02
150.000	EUR	NN Group NV, FRN, 4.63%, 13/01/2048	142	0,03
200.000	EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 1.13%, 30/09/2027	182	0,04
200.000	EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 0.13%, 04/06/2028	171	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Paesi Bassi (continua)				
90.000	EUR	OCI NV, 3.63%, 15/10/2025	88	0,02
100.000	EUR	PACCAR Financial Europe BV, 0.00%, 01/03/2026	91	0,02
500.000	EUR	PACCAR Financial Europe BV, 3.38%, 15/05/2026	492	0,10
150.000	EUR	PostNL NV, 0.63%, 23/09/2026	136	0,03
100.000	EUR	Prosus NV, 1.21%, 19/01/2026	91	0,02
125.000	EUR	Prosus NV, 1.54%, 03/08/2028	102	0,02
300.000	EUR	Prosus NV, 1.29%, 13/07/2029	227	0,05
200.000	EUR	Prosus NV, 2.09%, 19/01/2030	154	0,03
250.000	EUR	Prosus NV, 2.03%, 03/08/2032	175	0,03
100.000	EUR	Prosus NV, 1.99%, 13/07/2033	67	0,01
100.000	EUR	Prosus NV, 2.78%, 19/01/2034	71	0,01
200.000	EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV, 0.38%, 19/05/2026	183	0,04
200.000	EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV, 0.75%, 19/05/2030	164	0,03
250.000	EUR	RELX Finance BV, 1.50%, 13/05/2027	231	0,05
200.000	EUR	RELX Finance BV, 0.50%, 10/03/2028	173	0,03
100.000	EUR	RELX Finance BV, 3.75%, 12/06/2031	98	0,02
100.000	EUR	RELX Finance BV, 0.88%, 10/03/2032	78	0,01
200.000	EUR	Ren Finance BV, 1.75%, 18/01/2028	182	0,04
200.000	EUR	Ren Finance BV, 0.50%, 16/04/2029	166	0,03
100.000	EUR	Rentokil Initial Finance BV, 3.88%, 27/06/2027	99	0,02
200.000	EUR	Rentokil Initial Finance BV, 4.38%, 27/06/2030	200	0,04
200.000	EUR	Repsol International Finance BV, 2.00%, 15/12/2025	192	0,04
100.000	EUR	Repsol International Finance BV, 2.25%, 10/12/2026	95	0,02
100.000	EUR	Repsol International Finance BV, 0.25%, 02/08/2027	87	0,02
300.000	EUR	Repsol International Finance BV, 2.63%, 15/04/2030	281	0,06
150.000	EUR	Repsol International Finance BV, FRN, 3.75%, 11/03/2026 ¹	141	0,03
400.000	EUR	Repsol International Finance BV, FRN, 2.50%, 22/12/2026 ¹	353	0,07
100.000	EUR	Robert Bosch Investment Nederland BV, 2.63%, 24/05/2028	95	0,02
325.000	EUR	Roche Finance Europe BV, 3.20%, 27/08/2029	319	0,06
200.000	EUR	Roche Finance Europe BV, 3.36%, 27/02/2035	192	0,04
225.000	EUR	Sagax Euro Mtn NL BV, REIT, 1.00%, 17/05/2029	171	0,03
300.000	EUR	Sartorius Finance BV, 4.50%, 14/09/2032	296	0,06
300.000	EUR	Sartorius Finance BV, 4.88%, 14/09/2035	296	0,06
100.000	EUR	Schlumberger Finance BV, 1.38%, 28/10/2026	93	0,02
100.000	EUR	Schlumberger Finance BV, 0.25%, 15/10/2027	87	0,02
200.000	EUR	Schlumberger Finance BV, 0.50%, 15/10/2031	153	0,03
200.000	EUR	Schlumberger Finance BV, 2.00%, 06/05/2032	171	0,03
300.000	EUR	SGS Nederland Holding BV, 0.13%, 21/04/2027	262	0,05
400.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.38%, 15/02/2025	381	0,08
300.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.88%, 15/09/2025	289	0,06
300.000	EUR	Shell International Finance BV, 2.50%, 24/03/2026	290	0,06
200.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.63%, 20/01/2027	186	0,04
300.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.13%, 08/11/2027	259	0,05
200.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.50%, 07/04/2028	181	0,04
100.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.25%, 12/05/2028	89	0,02
125.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.75%, 15/08/2028	108	0,02
325.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.50%, 08/11/2031	248	0,05
200.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.88%, 07/04/2032	169	0,03
200.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.25%, 11/11/2032	158	0,03
250.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.88%, 08/11/2039	150	0,03
300.000	EUR	Siemens Energy Finance BV, 4.00%, 05/04/2026	294	0,06
200.000	EUR	Siemens Energy Finance BV, 4.25%, 05/04/2029	190	0,04
300.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.25%, 10/03/2025	293	0,06
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.00%, 20/02/2026	183	0,04
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.38%, 05/06/2026	183	0,04
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.63%, 25/02/2027	90	0,02
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.00%, 06/09/2027	183	0,04
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.50%, 08/09/2027	96	0,02
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.90%, 28/02/2028	90	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Paesi Bassi (continua)				
250.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.88%, 10/03/2028	244	0,05
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.25%, 20/02/2029	167	0,03
175.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.13%, 05/09/2029	144	0,03
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.00%, 25/02/2030	85	0,02
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.38%, 06/09/2030	172	0,03
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.75%, 09/09/2030	187	0,04
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.25%, 28/02/2031	85	0,02
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.38%, 24/08/2031	97	0,02
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.50%, 20/02/2032	77	0,01
400.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.00%, 08/09/2033	372	0,07
50.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.50%, 05/09/2034	35	0,01
300.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.25%, 25/02/2035	227	0,05
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.50%, 24/02/2036	94	0,02
150.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.75%, 28/02/2039	110	0,02
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.63%, 24/02/2043	178	0,04
100.000	EUR	Signify NV, 2.38%, 11/05/2027	93	0,02
100.000	EUR	Sika Capital BV, 3.75%, 03/11/2026	99	0,02
100.000	EUR	Sika Capital BV, 0.88%, 29/04/2027	90	0,02
300.000	EUR	Sika Capital BV, 3.75%, 03/05/2030	294	0,06
100.000	EUR	Sika Capital BV, 1.50%, 29/04/2031	84	0,02
100.000	EUR	Stellantis NV, 2.00%, 20/03/2025	97	0,02
100.000	EUR	Stellantis NV, 3.88%, 05/01/2026	100	0,02
300.000	EUR	Stellantis NV, 2.75%, 15/05/2026	291	0,06
400.000	EUR	Stellantis NV, 0.63%, 30/03/2027	355	0,07
250.000	EUR	Stellantis NV, 4.50%, 07/07/2028	252	0,05
300.000	EUR	Stellantis NV, 0.75%, 18/01/2029	248	0,05
100.000	EUR	Stellantis NV, 1.13%, 18/09/2029	83	0,02
300.000	EUR	Stellantis NV, 4.38%, 14/03/2030	296	0,06
350.000	EUR	Stellantis NV, 4.25%, 16/06/2031	336	0,07
200.000	EUR	Stellantis NV, 2.75%, 01/04/2032	170	0,03
275.000	EUR	Stellantis NV, 1.25%, 20/06/2033	199	0,04
150.000	EUR	Sudzucker International Finance BV, 1.00%, 28/11/2025	141	0,03
100.000	EUR	Sudzucker International Finance BV, 5.13%, 31/10/2027	102	0,02
100.000	EUR	Technip Energies NV, 1.13%, 28/05/2028	86	0,02
100.000	EUR	Telefonica Europe BV, 5.88%, 14/02/2033	113	0,02
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.00%, 18/11/2025	92	0,02
450.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.80%, 18/10/2030	364	0,07
250.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 1.13%, 18/10/2033	189	0,04
300.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 1.63%, 18/10/2041	194	0,04
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 2.00%, 18/10/2051	59	0,01
200.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 0.00%, 27/10/2025	184	0,04
100.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 3.38%, 13/01/2026	98	0,02
101.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 3.50%, 13/01/2028	99	0,02
350.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.25%, 25/03/2025	337	0,07
100.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 0.88%, 31/07/2025	95	0,02
150.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 0.75%, 28/02/2026	140	0,03
200.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.13%, 12/02/2027	184	0,04
150.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.00%, 14/02/2027	138	0,03
150.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.13%, 29/04/2028	134	0,03
150.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.75%, 16/11/2028	137	0,03
100.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.38%, 31/07/2029	88	0,02
500.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.75%, 25/03/2030	443	0,09
100.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.38%, 04/09/2030	86	0,02
300.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.25%, 28/02/2031	251	0,05
200.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.63%, 12/02/2033	167	0,03
150.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 2.25%, 16/05/2034	129	0,03
100.000	EUR	Universal Music Group NV, 3.00%, 30/06/2027	97	0,02
200.000	EUR	Universal Music Group NV, 4.00%, 13/06/2031	195	0,04
100.000	EUR	Universal Music Group NV, 3.75%, 30/06/2032	95	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Paesi Bassi (continua)				
200.000	EUR	Upjohn Finance BV, 1.36%, 23/06/2027	177	0,04
250.000	EUR	Upjohn Finance BV, 1.91%, 23/06/2032	193	0,04
200.000	EUR	Vestas Wind Systems Finance BV, 2.00%, 15/06/2034	160	0,03
200.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.25%, 06/12/2024	192	0,04
200.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.80%, 29/06/2025	191	0,04
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.13%, 08/09/2025	94	0,02
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.50%, 22/03/2026	93	0,02
200.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.50%, 10/06/2026	186	0,04
200.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 0.63%, 09/07/2026	180	0,04
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 0.63%, 07/10/2027	84	0,02
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.50%, 14/01/2028	87	0,02
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 0.50%, 14/09/2029	77	0,01
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 2.25%, 07/04/2030	84	0,02
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.00%, 09/07/2030	77	0,01
300.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.13%, 14/09/2034	197	0,04
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.63%, 07/10/2039	60	0,01
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.00%, 28/01/2041	51	0,01
100.000	EUR	Wabtec Transportation Netherlands BV, 1.25%, 03/12/2027	88	0,02
200.000	EUR	Wintershall Dea Finance BV, 0.84%, 25/09/2025	186	0,04
300.000	EUR	Wintershall Dea Finance BV, 1.33%, 25/09/2028	255	0,05
200.000	EUR	Wintershall Dea Finance BV, 1.82%, 25/09/2031	158	0,03
100.000	EUR	Wolters Kluwer NV, 3.00%, 23/09/2026	98	0,02
200.000	EUR	Wolters Kluwer NV, 1.50%, 22/03/2027	185	0,04
100.000	EUR	Wolters Kluwer NV, 0.75%, 03/07/2030	81	0,02
100.000	EUR	Wolters Kluwer NV, 3.75%, 03/04/2031	98	0,02
150.000	EUR	WPC Eurobond BV, REIT, 2.25%, 09/04/2026	141	0,03
100.000	EUR	WPC Eurobond BV, REIT, 2.13%, 15/04/2027	92	0,02
100.000	EUR	WPC Eurobond BV, REIT, 1.35%, 15/04/2028	85	0,02
200.000	EUR	WPC Eurobond BV, REIT, 0.95%, 01/06/2030	153	0,03
200.000	EUR	Wurth Finance International BV, 1.00%, 26/05/2025	192	0,04
75.000	EUR	Wurth Finance International BV, 0.75%, 22/11/2027	67	0,01
400.000	EUR	Wurth Finance International BV, 2.13%, 23/08/2030	355	0,07
Paesi Bassi - Totale			77.380	15,69
Nuova Zelanda (31 marzo 2023: 0,31%)				
200.000	EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd., 1.13%, 20/03/2025	192	0,04
200.000	EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd., 0.38%, 17/09/2029	163	0,03
125.000	EUR	ASB Bank Ltd., 4.50%, 16/03/2027	126	0,02
100.000	EUR	ASB Bank Ltd., 0.25%, 08/09/2028	83	0,02
100.000	EUR	ASB Bank Ltd., 0.50%, 24/09/2029	81	0,02
100.000	EUR	Chorus Ltd., 0.88%, 05/12/2026	90	0,02
100.000	EUR	Chorus Ltd., 3.63%, 07/09/2029	96	0,02
150.000	EUR	Fonterra Co-operative Group Ltd., 0.75%, 08/11/2024	144	0,03
150.000	EUR	Westpac Securities NZ Ltd., 1.10%, 24/03/2026	139	0,03
300.000	EUR	Westpac Securities NZ Ltd., 0.43%, 14/12/2026	265	0,05
100.000	EUR	Westpac Securities NZ Ltd., 0.10%, 13/07/2027	86	0,02
Nuova Zelanda - Totale			1.465	0,30
Norvegia (31 marzo 2023: 0,62%)				
200.000	EUR	Aker BP ASA, 1.13%, 12/05/2029	166	0,03
219.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 1.63%, 31/05/2026	210	0,04
400.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 3.63%, 16/02/2027	394	0,08
375.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 0.38%, 18/01/2028	332	0,07
400.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 4.50%, 19/07/2028	402	0,08
200.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 0.25%, 23/02/2029	167	0,04
175.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 4.00%, 14/03/2029	174	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Norvegia (continua)				
100.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 4.63%, 28/02/2033	98	0,02
100.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 5.00%, 13/09/2033	99	0,02
300.000	EUR	Norsk Hydro ASA, 1.13%, 11/04/2025	286	0,06
100.000	EUR	Norsk Hydro ASA, 2.00%, 11/04/2029	87	0,02
300.000	EUR	Santander Consumer Bank A/S, 0.50%, 11/08/2025	279	0,05
100.000	EUR	Santander Consumer Bank A/S, 0.13%, 14/04/2026	90	0,02
100.000	EUR	Sparebank 1 Oestlandet, 1.75%, 27/04/2027	92	0,02
100.000	EUR	Sparebank 1 Oestlandet, 0.13%, 03/03/2028	84	0,02
100.000	EUR	SpareBank 1 SMN, 3.13%, 22/12/2025	98	0,02
150.000	EUR	SpareBank 1 SMN, 0.13%, 11/09/2026	133	0,03
100.000	EUR	SpareBank 1 SMN, 0.01%, 18/02/2028	84	0,01
100.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 2.88%, 20/09/2025	97	0,02
100.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 0.25%, 09/11/2026	88	0,02
200.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 3.75%, 23/11/2027	196	0,04
200.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 4.88%, 24/08/2028	199	0,04
100.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, FRN, 0.38%, 15/07/2027	88	0,02
100.000	EUR	Storebrand Livsforsikring A/S, FRN, 1.88%, 30/09/2051	72	0,01
Norvegia - Totale			4.015	0,81
Polonia (31 marzo 2023: 0,11%)				
250.000	EUR	ORLEN SA, 1.13%, 27/05/2028	213	0,04
200.000	EUR	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA, FRN, 5.63%, 01/02/2026	201	0,04
Polonia - Totale			414	0,08
Portogallo (31 marzo 2023: 0,08%)				
200.000	EUR	Banco Comercial Portugues SA, FRN, 1.13%, 12/02/2027	180	0,03
100.000	EUR	Banco Comercial Portugues SA, FRN, 1.75%, 07/04/2028	88	0,02
100.000	EUR	Fidelidade - Cia de Seguros SA, FRN, 4.25%, 04/09/2031	86	0,02
Portogallo - Totale			354	0,07
Romania (31 marzo 2023: 0,00%)				
100.000	EUR	Banca Comerciala Romana SA, FRN, 7.63%, 19/05/2027	103	0,02
Romania - Totale			103	0,02
Singapore (31 marzo 2023: 0,02%)				
150.000	EUR	CapitaLand Ascendas, REIT, 0.75%, 23/06/2028	121	0,02
Singapore - Totale			121	0,02
Slovacchia (31 marzo 2023: 0,03%)				
			-	-
Corea del Sud (31 marzo 2023: 0,02%)				
100.000	EUR	Shinhan Bank Co. Ltd., 0.25%, 16/10/2024	96	0,02
Corea del Sud - Totale			96	0,02
Spagna (31 marzo 2023: 4,91%)				
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 0.63%, 15/07/2025	94	0,02
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.38%, 20/05/2026	188	0,04
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.00%, 27/02/2027	91	0,02
300.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 2.38%, 27/09/2027	281	0,06
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.25%, 07/02/2028	88	0,02
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.13%, 26/03/2028	174	0,03
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 2.25%, 29/03/2029	178	0,03

NM1123U-3256239-84/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Spagna (continua)				
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.63%, 15/07/2029	86	0,02
300.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 4.13%, 07/08/2029	291	0,06
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 3.00%, 27/03/2031	179	0,03
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.88%, 26/03/2032	81	0,01
200.000	EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 0.38%, 07/10/2027	174	0,03
100.000	EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 3.75%, 25/04/2030	96	0,02
300.000	EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 1.38%, 26/01/2032	240	0,05
100.000	EUR	ACS Servicios Comunicaciones y Energia SA, 1.88%, 20/04/2026	94	0,02
100.000	EUR	Amadeus IT Group SA, 1.50%, 18/09/2026	94	0,02
100.000	EUR	Amadeus IT Group SA, 2.88%, 20/05/2027	96	0,02
200.000	EUR	Amadeus IT Group SA, 1.88%, 24/09/2028	182	0,04
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.38%, 02/10/2024	193	0,04
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.38%, 14/05/2025	191	0,04
100.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.75%, 04/06/2025	95	0,02
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.75%, 26/11/2025	190	0,04
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.38%, 15/11/2026	268	0,05
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.50%, 14/01/2027	177	0,03
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 3.50%, 10/02/2027	194	0,04
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 3.38%, 20/09/2027	291	0,06
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.38%, 14/10/2029	301	0,06
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 4.13%, 10/05/2026	199	0,04
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 0.13%, 24/03/2027	271	0,05
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 0.88%, 14/01/2029	172	0,03
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 1.00%, 16/01/2030	282	0,06
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 4.63%, 13/01/2031	197	0,04
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 5.75%, 15/09/2033	198	0,04
300.000	EUR	Banco de Sabadell SA, 0.88%, 22/07/2025	282	0,06
100.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 0.63%, 07/11/2025	96	0,02
200.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 1.13%, 11/03/2027	184	0,04
100.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 5.13%, 10/11/2028	101	0,02
200.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 5.00%, 07/06/2029	199	0,04
300.000	EUR	Banco Santander SA, 1.13%, 17/01/2025	288	0,06
400.000	EUR	Banco Santander SA, 2.50%, 18/03/2025	388	0,08
300.000	EUR	Banco Santander SA, 1.38%, 05/01/2026	282	0,06
400.000	EUR	Banco Santander SA, 3.75%, 16/01/2026	396	0,08
200.000	EUR	Banco Santander SA, 3.25%, 04/04/2026	193	0,04
300.000	EUR	Banco Santander SA, 0.30%, 04/10/2026	269	0,05
200.000	EUR	Banco Santander SA, 3.13%, 19/01/2027	191	0,04
300.000	EUR	Banco Santander SA, 0.50%, 04/02/2027	265	0,05
300.000	EUR	Banco Santander SA, 1.13%, 23/06/2027	269	0,05
300.000	EUR	Banco Santander SA, 3.88%, 16/01/2028	295	0,06
300.000	EUR	Banco Santander SA, 2.13%, 08/02/2028	269	0,05
200.000	EUR	Banco Santander SA, 0.20%, 11/02/2028	169	0,03
300.000	EUR	Banco Santander SA, 4.25%, 12/06/2030	298	0,06
100.000	EUR	Banco Santander SA, 1.63%, 22/10/2030	79	0,01
200.000	EUR	Banco Santander SA, 1.00%, 04/11/2031	156	0,03
300.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 3.63%, 27/09/2026	296	0,06
200.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 0.50%, 24/03/2027	182	0,04
200.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 0.63%, 24/06/2029	167	0,03
200.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 5.75%, 23/08/2033	198	0,04
200.000	EUR	Bankinter SA, 0.88%, 08/07/2026	182	0,04
200.000	EUR	Bankinter SA, 0.63%, 06/10/2027	173	0,03
100.000	EUR	Bankinter SA, FRN, 4.38%, 03/05/2030	99	0,02
200.000	EUR	Bankinter SA, FRN, 4.88%, 13/09/2031	198	0,04
100.000	EUR	Bankinter SA, FRN, 1.25%, 23/12/2032	83	0,02
200.000	EUR	CaixaBank SA, 0.38%, 03/02/2025	190	0,04
200.000	EUR	CaixaBank SA, 1.13%, 27/03/2026	185	0,04
200.000	EUR	CaixaBank SA, 1.38%, 19/06/2026	184	0,04
200.000	EUR	CaixaBank SA, 0.75%, 09/07/2026	183	0,04

NM1123U-3256239-85/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Spagna (continua)				
200.000	EUR	CaixaBank SA, 1.13%, 12/11/2026	180	0,04
200.000	EUR	CaixaBank SA, 3.75%, 07/09/2029	195	0,04
300.000	EUR	CaixaBank SA, 4.25%, 06/09/2030	295	0,06
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 1.63%, 13/04/2026	191	0,04
300.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.75%, 10/07/2026	281	0,06
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.38%, 18/11/2026	182	0,04
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 4.63%, 16/05/2027	199	0,04
400.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.63%, 21/01/2028	354	0,07
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.75%, 26/05/2028	173	0,03
400.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.50%, 09/02/2029	333	0,07
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 2.25%, 17/04/2030	189	0,04
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 5.38%, 14/11/2030	203	0,04
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 1.25%, 18/06/2031	179	0,04
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 6.25%, 23/02/2033	201	0,04
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 6.13%, 30/05/2034	199	0,04
100.000	EUR	Criteria Caixa SA, 0.88%, 28/10/2027	87	0,02
200.000	EUR	Enagas Financiaciones SA, 1.25%, 06/02/2025	192	0,04
100.000	EUR	Enagas Financiaciones SA, 0.75%, 27/10/2026	91	0,02
100.000	EUR	Enagas Financiaciones SA, 1.38%, 05/05/2028	91	0,02
200.000	EUR	Enagas Financiaciones SA, 0.38%, 05/11/2032	148	0,03
250.000	EUR	FCC Aqualia SA, 2.63%, 08/06/2027	236	0,05
100.000	EUR	FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU, 1.66%, 04/12/2026	92	0,02
100.000	EUR	Ferrovial Emisiones SA, 1.38%, 31/03/2025	96	0,02
100.000	EUR	Ferrovial Emisiones SA, 1.38%, 14/05/2026	94	0,02
200.000	EUR	Ferrovial Emisiones SA, 0.54%, 12/11/2028	166	0,03
200.000	EUR	Ibercaja Banco SA, FRN, 5.63%, 07/06/2027	201	0,04
300.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.00%, 07/03/2025	288	0,06
200.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 0.88%, 16/06/2025	190	0,04
100.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.25%, 28/10/2026	93	0,02
200.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.25%, 13/09/2027	184	0,04
100.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.13%, 22/11/2028	97	0,02
100.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.62%, 29/11/2029	90	0,02
400.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.38%, 11/03/2032	332	0,07
200.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.38%, 22/11/2032	190	0,04
100.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.63%, 13/07/2033	96	0,02
200.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, FRN, 1.58%, 16/08/2027 ¹	169	0,03
300.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, FRN, 4.88%, 25/04/2028 ¹	289	0,06
300.000	EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, REIT, 1.63%, 28/11/2025	284	0,06
100.000	EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, REIT, 1.35%, 14/10/2028	86	0,02
400.000	EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, REIT, 0.75%, 22/06/2029	328	0,07
100.000	EUR	Lar Espana Real Estate Socimi SA, REIT, 1.75%, 22/07/2026	88	0,02
100.000	EUR	Mapfre SA, 1.63%, 19/05/2026	96	0,02
100.000	EUR	Mapfre SA, 2.88%, 13/04/2030	85	0,02
200.000	EUR	Mapfre SA, FRN, 4.38%, 31/03/2047	190	0,04
100.000	EUR	Mapfre SA, FRN, 4.13%, 07/09/2048	92	0,02
200.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 1.75%, 26/05/2025	191	0,04
150.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 1.88%, 02/11/2026	140	0,03
200.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 2.38%, 13/07/2027	186	0,04
100.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 2.38%, 18/09/2029	88	0,02
100.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 1.38%, 01/06/2030	78	0,01
100.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 1.88%, 04/12/2034	70	0,01
100.000	EUR	Prosegur Cash SA, 1.38%, 04/02/2026	93	0,02
100.000	EUR	Prosegur Cia de Seguridad SA, 2.50%, 06/04/2029	90	0,02
100.000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 1.00%, 21/04/2026	94	0,02
100.000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 1.25%, 13/03/2027	92	0,02
200.000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 0.38%, 24/07/2028	173	0,03
100.000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 0.50%, 24/05/2033	75	0,01
100.000	EUR	Redeia Corp. SA, 0.88%, 14/04/2025	95	0,02
400.000	EUR	Redeia Corp. SA, FRN, 4.63%, 07/05/2028 ¹	393	0,08

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Spagna (continua)				
200.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.38%, 17/01/2025	191	0,04
100.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.00%, 23/02/2026	91	0,02
100.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.50%, 14/11/2026	89	0,02
200.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.50%, 14/01/2027	177	0,03
600.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.50%, 11/09/2025	574	0,12
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.46%, 13/04/2026	189	0,04
100.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.45%, 22/01/2027	93	0,02
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.20%, 21/08/2027	181	0,04
300.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.72%, 12/01/2028	276	0,05
100.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.32%, 17/10/2028	93	0,02
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.79%, 12/03/2029	180	0,04
300.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.93%, 17/10/2029	285	0,06
100.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 0.66%, 03/02/2030	82	0,01
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.59%, 25/05/2031	181	0,04
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.93%, 17/10/2031	171	0,03
100.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.81%, 21/05/2032	84	0,02
100.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.96%, 01/07/2039	72	0,01
100.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.86%, 13/07/2040	69	0,01
200.000	EUR	Unicaja Banco SA, FRN, 1.00%, 01/12/2026	182	0,04
100.000	EUR	Unicaja Banco SA, FRN, 5.13%, 21/02/2029	97	0,02
Spagna - Totale			26.245	5,33
Svezia (31 marzo 2023: 2,38%)				
100.000	EUR	Akelius Residential Property AB, REIT, 1.75%, 07/02/2025	95	0,02
100.000	EUR	Alfa Laval Treasury International AB, 1.38%, 18/02/2029	86	0,02
200.000	EUR	Assa Abloy AB, 3.75%, 13/09/2026	200	0,04
200.000	EUR	Assa Abloy AB, 4.13%, 13/09/2035	197	0,04
200.000	EUR	Atlas Copco AB, 0.63%, 30/08/2026	184	0,04
250.000	EUR	Castellum AB, REIT, 0.75%, 04/09/2026	214	0,04
100.000	EUR	Electrolux AB, 4.13%, 05/10/2026	100	0,02
100.000	EUR	Electrolux AB, 2.50%, 18/05/2030	88	0,02
200.000	EUR	EQT AB, 2.38%, 06/04/2028	177	0,04
100.000	EUR	EQT AB, 0.88%, 14/05/2031	73	0,01
250.000	EUR	EQT AB, 2.88%, 06/04/2032	204	0,04
100.000	EUR	Essity AB, 1.13%, 05/03/2025	96	0,02
100.000	EUR	Essity AB, 1.63%, 30/03/2027	92	0,02
100.000	EUR	Essity AB, 0.25%, 08/02/2031	76	0,01
100.000	EUR	Fastighets AB Balder, REIT, 1.88%, 14/03/2025	93	0,02
100.000	EUR	Fastighets AB Balder, REIT, 1.88%, 23/01/2026	88	0,02
100.000	EUR	Fastighets AB Balder, REIT, 1.25%, 28/01/2028	75	0,01
125.000	EUR	Investor AB, 1.50%, 12/09/2030	107	0,02
150.000	EUR	Investor AB, 2.75%, 10/06/2032	135	0,03
100.000	EUR	Investor AB, 0.38%, 29/10/2035	64	0,01
100.000	EUR	Investor AB, 1.50%, 20/06/2039	67	0,01
100.000	EUR	Molnlycke Holding AB, 1.88%, 28/02/2025	96	0,02
100.000	EUR	Molnlycke Holding AB, 4.25%, 08/09/2028	99	0,02
125.000	EUR	Molnlycke Holding AB, 0.88%, 05/09/2029	101	0,02
100.000	EUR	Molnlycke Holding AB, 0.63%, 15/01/2031	75	0,01
275.000	EUR	Sagax AB, REIT, 2.25%, 13/03/2025	263	0,05
100.000	EUR	Sandvik AB, 3.00%, 18/06/2026	97	0,02
100.000	EUR	Sandvik AB, 2.13%, 07/06/2027	94	0,02
100.000	EUR	Sandvik AB, 0.38%, 25/11/2028	83	0,02
300.000	EUR	Sandvik AB, 3.75%, 27/09/2029	294	0,06
400.000	EUR	Scania CV AB, 2.25%, 03/06/2025	386	0,08
100.000	EUR	Securitas AB, 1.25%, 06/03/2025	95	0,02
100.000	EUR	Securitas AB, 0.25%, 22/02/2028	84	0,02
300.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.25%, 24/11/2025	295	0,06
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.00%, 09/11/2026	199	0,04

NM1123U-3256239-87/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Svezia (continua)				
275.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1.75%, 11/11/2026	257	0,05
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.38%, 11/02/2027	176	0,04
150.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.13%, 29/06/2027	150	0,03
400.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.75%, 07/02/2028	390	0,08
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.88%, 09/05/2028	198	0,04
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.38%, 21/06/2028	167	0,03
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.63%, 12/11/2029	161	0,03
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN, 0.75%, 03/11/2031	174	0,03
200.000	EUR	SKF AB, 1.25%, 17/09/2025	189	0,04
100.000	EUR	SKF AB, 3.13%, 14/09/2028	96	0,02
150.000	EUR	SKF AB, 0.25%, 15/02/2031	111	0,02
400.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 1.00%, 15/04/2025	382	0,08
300.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.75%, 05/05/2026	297	0,06
100.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.05%, 03/09/2026	89	0,02
125.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.13%, 03/11/2026	111	0,02
150.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.75%, 01/11/2027	149	0,03
100.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.01%, 02/12/2027	85	0,02
150.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.38%, 17/02/2028	146	0,03
175.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.05%, 06/09/2028	144	0,03
300.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 1.38%, 23/02/2029	260	0,05
200.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 2.63%, 05/09/2029	186	0,04
175.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.50%, 18/02/2030	139	0,03
100.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 3.25%, 01/06/2033	92	0,02
250.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.00%, 16/08/2034	246	0,05
100.000	EUR	Swedbank AB, 0.75%, 05/05/2025	95	0,02
200.000	EUR	Swedbank AB, 3.75%, 14/11/2025	198	0,04
250.000	EUR	Swedbank AB, 0.25%, 02/11/2026	221	0,04
300.000	EUR	Swedbank AB, 1.30%, 17/02/2027	270	0,05
175.000	EUR	Swedbank AB, 2.10%, 25/05/2027	163	0,03
150.000	EUR	Swedbank AB, 0.20%, 12/01/2028	126	0,03
300.000	EUR	Swedbank AB, 4.25%, 11/07/2028	297	0,06
100.000	EUR	Swedbank AB, 4.38%, 05/09/2030	98	0,02
400.000	EUR	Swedbank AB, FRN, 0.30%, 20/05/2027	358	0,07
100.000	EUR	Swedbank AB, FRN, 3.63%, 23/08/2032	93	0,02
100.000	EUR	Tele2 AB, 2.13%, 15/05/2028	92	0,02
100.000	EUR	Tele2 AB, 3.75%, 22/11/2029	97	0,02
100.000	EUR	Tele2 AB, 0.75%, 23/03/2031	77	0,02
150.000	EUR	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1.13%, 08/02/2027	133	0,03
100.000	EUR	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1.00%, 26/05/2029	79	0,02
100.000	EUR	Telia Co. AB, 3.88%, 01/10/2025	100	0,02
100.000	EUR	Telia Co. AB, 3.00%, 07/09/2027	97	0,02
100.000	EUR	Telia Co. AB, 0.13%, 27/11/2030	76	0,01
100.000	EUR	Telia Co. AB, 3.63%, 22/02/2032	96	0,02
100.000	EUR	Telia Co. AB, 2.13%, 20/02/2034	82	0,02
250.000	EUR	Telia Co. AB, 1.63%, 23/02/2035	191	0,04
100.000	EUR	Telia Co. AB, FRN, 1.38%, 11/05/2081	89	0,02
100.000	EUR	Telia Co. AB, FRN, 4.63%, 21/12/2082	96	0,02
100.000	EUR	Telia Co. AB, FRN, 2.75%, 30/06/2083	88	0,02
125.000	EUR	Volvo Treasury AB, 0.63%, 14/02/2025	119	0,02
100.000	EUR	Volvo Treasury AB, 1.63%, 26/05/2025	96	0,02
200.000	EUR	Volvo Treasury AB, 3.50%, 17/11/2025	198	0,04
150.000	EUR	Volvo Treasury AB, 2.63%, 20/02/2026	145	0,03
100.000	EUR	Volvo Treasury AB, 0.00%, 18/05/2026	90	0,02
300.000	EUR	Volvo Treasury AB, 3.88%, 29/08/2026	299	0,06
300.000	EUR	Volvo Treasury AB, 3.63%, 25/05/2027	296	0,06
100.000	EUR	Volvo Treasury AB, 2.00%, 19/08/2027	93	0,02
Svezia - Totale			13.815	2,80

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Svizzera (31 marzo 2023: 0,78%)				
300.000	EUR	Credit Suisse AG, 0.25%, 05/01/2026	273	0,05
300.000	EUR	Credit Suisse AG, 1.50%, 10/04/2026	279	0,06
300.000	EUR	Credit Suisse AG, 5.50%, 20/08/2026	308	0,06
300.000	EUR	Credit Suisse AG, 0.25%, 01/09/2028	247	0,05
100.000	EUR	Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, 5.23%, 01/11/2027	103	0,02
200.000	EUR	Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, 4.84%, 03/11/2028	201	0,04
200.000	EUR	UBS AG, 0.01%, 31/03/2026	180	0,04
200.000	EUR	UBS AG, 0.50%, 31/03/2031	151	0,03
200.000	EUR	UBS Group AG, 1.50%, 30/11/2024	197	0,04
200.000	EUR	UBS Group AG, 1.25%, 01/09/2026	182	0,04
200.000	EUR	UBS Group AG, 0.25%, 24/02/2028	166	0,03
200.000	EUR	UBS Group AG, 0.65%, 10/09/2029	157	0,03
400.000	EUR	UBS Group AG, 0.88%, 03/11/2031	294	0,06
300.000	EUR	UBS Group AG, 0.63%, 18/01/2033	205	0,04
400.000	EUR	UBS Group AG, 0.63%, 24/02/2033	277	0,06
250.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 0.25%, 29/01/2026	235	0,05
600.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 2.13%, 13/10/2026	570	0,11
600.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 0.25%, 03/11/2026	545	0,11
400.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 2.75%, 15/06/2027	378	0,08
300.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 1.00%, 24/06/2027	270	0,05
275.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 0.65%, 14/01/2028	240	0,05
200.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 4.63%, 17/03/2028	198	0,04
200.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 0.25%, 05/11/2028	166	0,03
800.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 7.75%, 01/03/2029	885	0,18
200.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 3.13%, 15/06/2030	182	0,04
200.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 4.38%, 11/01/2031	194	0,04
200.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 4.75%, 17/03/2032	195	0,04
Svizzera - Totale			7.278	1,47
Regno Unito (31 marzo 2023: 6,55%)				
100.000	EUR	3i Group plc, 4.88%, 14/06/2029	97	0,02
100.000	EUR	Amcor UK Finance plc, 1.13%, 23/06/2027	89	0,02
100.000	EUR	Anglo American Capital plc, 1.63%, 18/09/2025	96	0,02
100.000	EUR	Anglo American Capital plc, 1.63%, 11/03/2026	94	0,02
300.000	EUR	Anglo American Capital plc, 4.50%, 15/09/2028	300	0,06
200.000	EUR	Anglo American Capital plc, 4.75%, 21/09/2032	195	0,04
150.000	EUR	Aon Global Ltd., 2.88%, 14/05/2026	145	0,03
150.000	EUR	AstraZeneca plc, 3.63%, 03/03/2027	149	0,03
200.000	EUR	AstraZeneca plc, 1.25%, 12/05/2028	179	0,03
100.000	EUR	AstraZeneca plc, 0.38%, 03/06/2029	83	0,02
125.000	EUR	AstraZeneca plc, 3.75%, 03/03/2032	123	0,02
150.000	EUR	Aviva plc, 1.88%, 13/11/2027	140	0,03
200.000	EUR	Aviva plc, FRN, 3.38%, 04/12/2045	191	0,04
300.000	EUR	Barclays plc, FRN, 1.38%, 24/01/2026	288	0,06
100.000	EUR	Barclays plc, FRN, 2.89%, 31/01/2027	96	0,02
300.000	EUR	Barclays plc, FRN, 0.88%, 28/01/2028	265	0,05
400.000	EUR	Barclays plc, FRN, 0.58%, 09/08/2029	325	0,07
300.000	EUR	Barclays plc, FRN, 4.92%, 08/08/2030	296	0,06
300.000	EUR	Barclays plc, FRN, 1.13%, 22/03/2031	265	0,05
200.000	EUR	Barclays plc, FRN, 1.11%, 12/05/2032	150	0,03
200.000	EUR	Barclays plc, FRN, 5.26%, 29/01/2034	197	0,04
200.000	EUR	BG Energy Capital plc, 2.25%, 21/11/2029	179	0,04
50.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.95%, 03/03/2025	49	0,01
200.000	EUR	BP Capital Markets plc, 2.97%, 27/02/2026	196	0,04
350.000	EUR	BP Capital Markets plc, 2.21%, 25/09/2026	333	0,07
70.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.57%, 16/02/2027	65	0,01
150.000	EUR	BP Capital Markets plc, 0.83%, 08/11/2027	134	0,03
300.000	EUR	BP Capital Markets plc, 2.52%, 07/04/2028	282	0,06

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Regno Unito (continua)				
100.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.59%, 03/07/2028	90	0,02
200.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.64%, 26/06/2029	177	0,03
250.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.23%, 08/05/2031	202	0,04
200.000	EUR	BP Capital Markets plc, 2.82%, 07/04/2032	180	0,04
225.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.10%, 15/11/2034	158	0,03
500.000	EUR	BP Capital Markets plc, FRN, 3.25%, 22/03/2026 ¹	468	0,09
450.000	EUR	BP Capital Markets plc, FRN, 3.63%, 22/03/2029 ¹	392	0,08
100.000	EUR	Brambles Finance plc, 1.50%, 04/10/2027	92	0,02
125.000	EUR	Brambles Finance plc, 4.25%, 22/03/2031	123	0,02
125.000	EUR	British Telecommunications plc, 1.00%, 21/11/2024	121	0,02
100.000	EUR	British Telecommunications plc, 0.50%, 12/09/2025	93	0,02
150.000	EUR	British Telecommunications plc, 1.75%, 10/03/2026	142	0,03
300.000	EUR	British Telecommunications plc, 1.50%, 23/06/2027	274	0,05
100.000	EUR	British Telecommunications plc, 2.75%, 30/08/2027	95	0,02
150.000	EUR	British Telecommunications plc, 2.13%, 26/09/2028	137	0,03
100.000	EUR	British Telecommunications plc, 1.13%, 12/09/2029	84	0,02
100.000	EUR	British Telecommunications plc, 3.75%, 13/05/2031	96	0,02
100.000	EUR	British Telecommunications plc, 3.38%, 30/08/2032	92	0,02
375.000	EUR	British Telecommunications plc, 4.25%, 06/01/2033	366	0,07
150.000	EUR	Cadent Finance plc, 4.25%, 05/07/2029	148	0,03
300.000	EUR	Cadent Finance plc, 0.63%, 19/03/2030	236	0,05
100.000	EUR	Cadent Finance plc, 0.75%, 11/03/2032	75	0,01
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 2.38%, 07/05/2025	97	0,02
400.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.75%, 27/03/2026	380	0,08
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.50%, 08/11/2027	91	0,02
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.75%, 26/05/2028	91	0,02
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 0.20%, 02/12/2028	83	0,02
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.13%, 12/04/2029	86	0,02
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.88%, 18/03/2030	87	0,02
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 0.70%, 12/09/2031	77	0,01
100.000	EUR	Diageo Finance plc, 1.00%, 22/04/2025	96	0,02
300.000	EUR	Diageo Finance plc, 3.50%, 26/06/2025	298	0,06
200.000	EUR	Diageo Finance plc, 2.38%, 20/05/2026	193	0,04
100.000	EUR	Diageo Finance plc, 1.88%, 27/03/2027	94	0,02
100.000	EUR	Diageo Finance plc, 1.50%, 22/10/2027	92	0,02
200.000	EUR	Diageo Finance plc, 2.50%, 27/03/2032	180	0,04
150.000	EUR	DS Smith plc, 0.88%, 12/09/2026	135	0,03
325.000	EUR	DS Smith plc, 4.50%, 27/07/2030	318	0,06
100.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.38%, 02/12/2024	97	0,02
250.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 4.00%, 16/06/2025	253	0,05
250.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.25%, 21/05/2026	234	0,05
100.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.00%, 12/09/2026	93	0,02
200.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.38%, 12/09/2029	175	0,03
150.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.75%, 21/05/2030	132	0,03
100.000	EUR	HBOS plc, FRN, 4.50%, 18/03/2030	98	0,02
400.000	EUR	HSBC Holdings plc, 3.00%, 30/06/2025	390	0,08
250.000	EUR	HSBC Holdings plc, 2.50%, 15/03/2027	236	0,05
200.000	EUR	HSBC Holdings plc, 3.13%, 07/06/2028	185	0,04
250.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 0.31%, 13/11/2026	229	0,05
400.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 3.02%, 15/06/2027	384	0,08
375.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 4.75%, 10/03/2028	375	0,08
250.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 0.64%, 24/09/2029	206	0,04
225.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 0.77%, 13/11/2031	174	0,03
275.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 4.79%, 10/03/2032	271	0,05
250.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 6.36%, 16/11/2032	256	0,05
275.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 4.86%, 23/05/2033	270	0,05
125.000	EUR	Informa plc, 2.13%, 06/10/2025	120	0,02
100.000	EUR	Informa plc, 1.25%, 22/04/2028	87	0,02
100.000	EUR	InterContinental Hotels Group plc, 1.63%, 08/10/2024	97	0,02

NM1123U-3256239-90/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Regno Unito (continua)				
350.000	EUR	InterContinental Hotels Group plc, 2.13%, 15/05/2027	325	0,06
100.000	EUR	Intermediate Capital Group plc, 1.63%, 17/02/2027	88	0,02
150.000	EUR	Intermediate Capital Group plc, 2.50%, 28/01/2030	117	0,02
100.000	EUR	International Distributions Services plc, 1.25%, 08/10/2026	91	0,02
200.000	EUR	International Distributions Services plc, 5.25%, 14/09/2028	201	0,04
200.000	EUR	Investec Bank plc, FRN, 1.25%, 11/08/2026	183	0,04
100.000	EUR	ITV plc, 1.38%, 26/09/2026	92	0,02
100.000	EUR	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 0.38%, 28/01/2025	95	0,02
200.000	EUR	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 2.38%, 09/04/2026	192	0,04
200.000	EUR	Lloyds Bank plc, 1.25%, 13/01/2025	193	0,04
300.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, 1.50%, 12/09/2027	271	0,05
200.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 0.50%, 12/11/2025	192	0,04
300.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 3.50%, 01/04/2026	295	0,06
175.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 4.50%, 11/01/2029	173	0,03
100.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 4.50%, 18/03/2030	97	0,02
200.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 3.13%, 24/08/2030	182	0,04
250.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 4.75%, 21/09/2031	247	0,05
100.000	EUR	London Stock Exchange Group plc, 1.75%, 06/12/2027	92	0,02
125.000	EUR	London Stock Exchange Group plc, 1.75%, 19/09/2029	110	0,02
200.000	EUR	Mitsubishi HC Capital UK plc, 0.00%, 29/10/2024	190	0,04
300.000	EUR	Mitsubishi HC Capital UK plc, 0.25%, 03/02/2025	284	0,06
200.000	EUR	Mondi Finance plc, 1.63%, 27/04/2026	188	0,04
425.000	EUR	Motability Operations Group plc, 0.88%, 14/03/2025	406	0,08
150.000	EUR	Motability Operations Group plc, 0.38%, 03/01/2026	138	0,03
100.000	EUR	Motability Operations Group plc, 3.50%, 17/07/2031	95	0,02
100.000	EUR	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc, 3.53%, 20/09/2028	96	0,02
100.000	EUR	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc, 3.95%, 20/09/2032	95	0,02
100.000	EUR	National Grid Electricity Transmission plc, 0.19%, 20/01/2025	95	0,02
150.000	EUR	National Grid Electricity Transmission plc, 0.82%, 07/07/2032	112	0,02
100.000	EUR	National Grid Electricity Transmission plc, 0.87%, 26/11/2040	57	0,01
200.000	EUR	National Grid plc, 2.18%, 30/06/2026	190	0,04
100.000	EUR	National Grid plc, 0.16%, 20/01/2028	84	0,02
200.000	EUR	National Grid plc, 0.25%, 01/09/2028	165	0,03
300.000	EUR	National Grid plc, 3.88%, 16/01/2029	292	0,06
125.000	EUR	National Grid plc, 0.55%, 18/09/2029	100	0,02
100.000	EUR	National Grid plc, 2.95%, 30/03/2030	91	0,02
100.000	EUR	National Grid plc, 0.75%, 01/09/2033	69	0,01
100.000	EUR	National Grid plc, 3.25%, 30/03/2034	87	0,02
250.000	EUR	National Grid plc, 4.28%, 16/01/2035	238	0,05
200.000	EUR	Nationwide Building Society, 1.25%, 03/03/2025	192	0,04
175.000	EUR	Nationwide Building Society, 0.25%, 22/07/2025	163	0,03
175.000	EUR	Nationwide Building Society, 2.00%, 28/04/2027	162	0,03
250.000	EUR	Nationwide Building Society, 0.25%, 14/09/2028	206	0,04
100.000	EUR	Nationwide Building Society, 3.25%, 05/09/2029	94	0,02
175.000	EUR	Nationwide Building Society, FRN, 1.50%, 08/03/2026	167	0,03
200.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 0.75%, 15/11/2025	192	0,04
250.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 1.75%, 02/03/2026	240	0,05
500.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 4.07%, 06/09/2028	488	0,10
200.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 0.67%, 14/09/2029	163	0,03
200.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 0.78%, 26/02/2030	161	0,04
200.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 1.04%, 14/09/2032	166	0,03
200.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 5.76%, 28/02/2034	197	0,04
200.000	EUR	NatWest Markets plc, 2.75%, 02/04/2025	196	0,04
400.000	EUR	NatWest Markets plc, 0.13%, 12/11/2025	367	0,07
300.000	EUR	NatWest Markets plc, 0.13%, 18/06/2026	268	0,05
200.000	EUR	NatWest Markets plc, 1.38%, 02/03/2027	181	0,04
100.000	EUR	Omnicom Finance Holdings plc, 0.80%, 08/07/2027	89	0,02
100.000	EUR	Omnicom Finance Holdings plc, 1.40%, 08/07/2031	82	0,02
300.000	EUR	OTE plc, 0.88%, 24/09/2026	275	0,05

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Regno Unito (continua)				
100.000	EUR	Pearson Funding plc, 1.38%, 06/05/2025	95	0,02
100.000	EUR	Phoenix Group Holdings plc, 4.38%, 24/01/2029	91	0,02
200.000	EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services plc, 3.63%, 14/09/2028	198	0,04
300.000	EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services plc, 3.88%, 14/09/2033	294	0,06
100.000	EUR	Rentokil Initial plc, 0.95%, 22/11/2024	96	0,02
400.000	EUR	Rentokil Initial plc, 0.88%, 30/05/2026	369	0,07
100.000	EUR	Rentokil Initial plc, 0.50%, 14/10/2028	84	0,02
100.000	EUR	Rio Tinto Finance plc, 2.88%, 11/12/2024	99	0,02
200.000	EUR	Santander UK Group Holdings plc, FRN, 3.53%, 25/08/2028	190	0,04
225.000	EUR	Santander UK Group Holdings plc, FRN, 0.60%, 13/09/2029	182	0,04
200.000	EUR	Sky Ltd., 2.50%, 15/09/2026	192	0,04
200.000	EUR	Smith & Nephew plc, 4.57%, 11/10/2029	201	0,04
100.000	EUR	Smiths Group plc, 2.00%, 23/02/2027	94	0,02
125.000	EUR	SSE plc, 1.25%, 16/04/2025	119	0,02
150.000	EUR	SSE plc, 0.88%, 06/09/2025	141	0,03
200.000	EUR	SSE plc, 1.38%, 04/09/2027	182	0,04
300.000	EUR	SSE plc, 2.88%, 01/08/2029	282	0,06
250.000	EUR	SSE plc, 1.75%, 16/04/2030	216	0,04
100.000	EUR	SSE plc, FRN, 3.13%, 14/04/2027 ¹	91	0,02
300.000	EUR	SSE plc, FRN, 4.00%, 21/01/2028 ¹	276	0,06
100.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 0.90%, 02/07/2027	91	0,02
200.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 0.85%, 27/01/2028	176	0,03
100.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 0.80%, 17/11/2029	82	0,02
400.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 2.50%, 09/09/2030	377	0,08
200.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 4.87%, 10/05/2031	197	0,04
200.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 1.20%, 23/09/2031	172	0,03
100.000	EUR	Swiss Re Finance UK plc, FRN, 2.71%, 04/06/2052	80	0,02
200.000	EUR	Tesco Corporate Treasury Services plc, 0.88%, 29/05/2026	183	0,04
150.000	EUR	Tesco Corporate Treasury Services plc, 0.38%, 27/07/2029	119	0,02
100.000	EUR	Tesco Corporate Treasury Services plc, 4.25%, 27/02/2031	97	0,02
100.000	EUR	Thames Water Utilities Finance plc, 4.00%, 18/04/2027	93	0,02
200.000	EUR	Thames Water Utilities Finance plc, 0.88%, 31/01/2028	164	0,03
150.000	EUR	Thames Water Utilities Finance plc, 4.38%, 18/01/2031	133	0,03
200.000	EUR	Thames Water Utilities Finance plc, 1.25%, 31/01/2032	141	0,03
100.000	EUR	Unilever plc, 1.50%, 11/06/2039	71	0,01
100.000	EUR	Virgin Money UK plc, FRN, 4.63%, 29/10/2028	96	0,02
200.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.88%, 11/09/2025	192	0,04
200.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.13%, 20/11/2025	189	0,04
300.000	EUR	Vodafone Group plc, 2.20%, 25/08/2026	287	0,06
100.000	EUR	Vodafone Group plc, 0.90%, 24/11/2026	91	0,02
100.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.50%, 24/07/2027	92	0,02
150.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.88%, 20/11/2029	132	0,03
250.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.63%, 24/11/2030	211	0,04
200.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.60%, 29/07/2031	165	0,03
200.000	EUR	Vodafone Group plc, 2.88%, 20/11/2037	164	0,03
100.000	EUR	Vodafone Group plc, 2.50%, 24/05/2039	76	0,01
100.000	EUR	Wellcome Trust Ltd. (The), 1.13%, 21/01/2027	92	0,02
100.000	EUR	WPP Finance 2016, 1.38%, 20/03/2025	96	0,02
150.000	EUR	Yorkshire Building Society, 0.63%, 21/09/2025	139	0,03
100.000	EUR	Yorkshire Building Society, 0.50%, 01/07/2028	83	0,02
Regno Unito - Totale			33.732	6,84
Stati Uniti (31 marzo 2023: 15,17%)				
200.000	EUR	3M Co., 1.50%, 09/11/2026	185	0,04
100.000	EUR	3M Co., 1.75%, 15/05/2030	85	0,02
100.000	EUR	3M Co., 1.50%, 02/06/2031	81	0,02
200.000	EUR	AbbVie, Inc., 0.75%, 18/11/2027	177	0,04
100.000	EUR	AbbVie, Inc., 2.63%, 15/11/2028	94	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Stati Uniti (continua)				
200.000	EUR	AbbVie, Inc., 2.13%, 17/11/2028	184	0,04
100.000	EUR	AbbVie, Inc., 2.13%, 01/06/2029	91	0,02
100.000	EUR	AbbVie, Inc., 1.25%, 18/11/2031	82	0,02
200.000	EUR	Air Products and Chemicals, Inc., 0.50%, 05/05/2028	172	0,03
100.000	EUR	Air Products and Chemicals, Inc., 0.80%, 05/05/2032	77	0,01
100.000	EUR	Air Products and Chemicals, Inc., 4.00%, 03/03/2035	97	0,02
300.000	EUR	American Honda Finance Corp., 1.95%, 18/10/2024	294	0,06
250.000	EUR	American Honda Finance Corp., 0.30%, 07/07/2028	209	0,04
200.000	EUR	American International Group, Inc., 1.88%, 21/06/2027	183	0,04
100.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 1.38%, 04/04/2025	96	0,02
200.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 1.95%, 22/05/2026	188	0,04
200.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 0.45%, 15/01/2027	176	0,03
300.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 0.40%, 15/02/2027	263	0,05
200.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 4.13%, 16/05/2027	198	0,04
200.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 0.50%, 15/01/2028	170	0,03
100.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 1.00%, 15/01/2032	75	0,01
150.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 1.25%, 21/05/2033	109	0,02
200.000	EUR	Amgen, Inc., 2.00%, 25/02/2026	191	0,04
200.000	EUR	Apple, Inc., 0.88%, 24/05/2025	191	0,04
300.000	EUR	Apple, Inc., 0.00%, 15/11/2025	278	0,06
350.000	EUR	Apple, Inc., 1.63%, 10/11/2026	331	0,07
250.000	EUR	Apple, Inc., 2.00%, 17/09/2027	236	0,05
350.000	EUR	Apple, Inc., 1.38%, 24/05/2029	313	0,06
200.000	EUR	Apple, Inc., 0.50%, 15/11/2031	158	0,03
150.000	EUR	Archer-Daniels-Midland Co., 1.00%, 12/09/2025	142	0,03
325.000	EUR	AT&T, Inc., 3.55%, 18/11/2025	321	0,06
150.000	EUR	AT&T, Inc., 3.50%, 17/12/2025	148	0,03
225.000	EUR	AT&T, Inc., 0.25%, 04/03/2026	205	0,04
150.000	EUR	AT&T, Inc., 1.80%, 05/09/2026	140	0,03
400.000	EUR	AT&T, Inc., 1.60%, 19/05/2028	358	0,07
300.000	EUR	AT&T, Inc., 2.35%, 05/09/2029	270	0,05
150.000	EUR	AT&T, Inc., 2.60%, 17/12/2029	136	0,03
300.000	EUR	AT&T, Inc., 0.80%, 04/03/2030	241	0,05
200.000	EUR	AT&T, Inc., 2.05%, 19/05/2032	166	0,03
400.000	EUR	AT&T, Inc., 3.55%, 17/12/2032	368	0,07
100.000	EUR	AT&T, Inc., 3.38%, 15/03/2034	89	0,02
300.000	EUR	AT&T, Inc., 4.30%, 18/11/2034	288	0,06
250.000	EUR	AT&T, Inc., 2.45%, 15/03/2035	200	0,04
300.000	EUR	AT&T, Inc., 3.15%, 04/09/2036	251	0,05
100.000	EUR	AT&T, Inc., 2.60%, 19/05/2038	76	0,01
200.000	EUR	AT&T, Inc., 1.80%, 14/09/2039	132	0,03
200.000	EUR	Athene Global Funding, 0.37%, 10/09/2026	175	0,03
175.000	EUR	Athene Global Funding, 0.83%, 08/01/2027	153	0,03
175.000	EUR	Athene Global Funding, 0.63%, 12/01/2028	146	0,03
400.000	EUR	Autoliv, Inc., 4.25%, 15/03/2028	396	0,08
100.000	EUR	Avery Dennison Corp., 1.25%, 03/03/2025	96	0,02
150.000	EUR	Bank of America Corp., 1.38%, 26/03/2025	144	0,03
100.000	EUR	Bank of America Corp., 4.13%, 12/06/2028	99	0,02
275.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.81%, 09/05/2026	260	0,05
400.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.95%, 27/10/2026	381	0,08
450.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.78%, 04/05/2027	422	0,09
200.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.66%, 25/04/2028	182	0,04
200.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.58%, 24/08/2028	173	0,04
430.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 3.65%, 31/03/2029	415	0,08
250.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.58%, 08/08/2029	209	0,04
200.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.38%, 09/05/2030	168	0,03
300.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.69%, 22/03/2031	235	0,05
300.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.65%, 26/10/2031	229	0,05
375.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.10%, 24/05/2032	291	0,06

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Stati Uniti (continua)				
275.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 2.82%, 27/04/2033	240	0,05
250.000	EUR	Baxter International, Inc., 1.30%, 15/05/2029	215	0,04
100.000	EUR	Becton Dickinson and Co., 0.03%, 13/08/2025	93	0,02
100.000	EUR	Becton Dickinson and Co., 1.90%, 15/12/2026	94	0,02
125.000	EUR	Berkshire Hathaway Finance Corp., 1.50%, 18/03/2030	107	0,02
200.000	EUR	Berkshire Hathaway Finance Corp., 2.00%, 18/03/2034	161	0,03
200.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 0.00%, 12/03/2025	189	0,04
350.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 1.13%, 16/03/2027	320	0,06
200.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 1.63%, 16/03/2035	152	0,03
100.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 0.50%, 15/01/2041	54	0,01
100.000	EUR	Berry Global, Inc., 1.00%, 15/01/2025	95	0,02
150.000	EUR	Berry Global, Inc., 1.50%, 15/01/2027	135	0,03
250.000	EUR	Blackstone Holdings Finance Co. LLC, 1.00%, 05/10/2026	228	0,05
250.000	EUR	Blackstone Holdings Finance Co. LLC, 1.50%, 10/04/2029	214	0,04
100.000	EUR	Blackstone Holdings Finance Co. LLC, 3.50%, 01/06/2034	87	0,02
100.000	EUR	BMW US Capital LLC, 1.00%, 20/04/2027	91	0,02
200.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 0.10%, 08/03/2025	189	0,04
100.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 4.00%, 15/11/2026	100	0,02
250.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 1.80%, 03/03/2027	233	0,05
200.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 0.50%, 08/03/2028	172	0,03
100.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 3.63%, 12/11/2028	98	0,02
300.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 4.25%, 15/05/2029	302	0,06
100.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 4.50%, 15/11/2031	101	0,02
350.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 4.13%, 12/05/2033	344	0,07
225.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 4.75%, 15/11/2034	231	0,05
400.000	EUR	BorgWarner, Inc., 1.00%, 19/05/2031	302	0,06
200.000	EUR	Boston Scientific Corp., 0.63%, 01/12/2027	175	0,03
100.000	EUR	Bristol-Myers Squibb Co., 1.00%, 15/05/2025	96	0,02
100.000	EUR	Bristol-Myers Squibb Co., 1.75%, 15/05/2035	79	0,02
100.000	EUR	Brown-Forman Corp., 1.20%, 07/07/2026	93	0,02
100.000	EUR	Capital One Financial Corp., 1.65%, 12/06/2029	82	0,02
200.000	EUR	Cargill, Inc., 3.88%, 24/04/2030	196	0,04
250.000	EUR	Caterpillar Financial Services Corp., 3.74%, 04/09/2026	249	0,05
150.000	EUR	Chubb INA Holdings, Inc., 0.30%, 15/12/2024	143	0,03
100.000	EUR	Chubb INA Holdings, Inc., 0.88%, 15/06/2027	89	0,02
300.000	EUR	Chubb INA Holdings, Inc., 1.55%, 15/03/2028	269	0,05
100.000	EUR	Chubb INA Holdings, Inc., 0.88%, 15/12/2029	82	0,02
100.000	EUR	Chubb INA Holdings, Inc., 1.40%, 15/06/2031	81	0,02
200.000	EUR	Chubb INA Holdings, Inc., 2.50%, 15/03/2038	155	0,03
100.000	EUR	Citigroup, Inc., 1.75%, 28/01/2025	97	0,02
100.000	EUR	Citigroup, Inc., 2.13%, 10/09/2026	95	0,02
200.000	EUR	Citigroup, Inc., 1.63%, 21/03/2028	179	0,04
100.000	EUR	Citigroup, Inc., 1.50%, 26/10/2028	88	0,02
325.000	EUR	Citigroup, Inc., 1.25%, 10/04/2029	277	0,06
350.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 1.25%, 06/07/2026	331	0,07
265.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 1.50%, 24/07/2026	252	0,05
400.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 0.50%, 08/10/2027	357	0,07
300.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 3.71%, 22/09/2028	293	0,06
200.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 4.25%, 25/02/2030	198	0,04
300.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 4.11%, 22/09/2033	287	0,06
400.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.75%, 22/09/2026	369	0,07
200.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.88%, 22/09/2026	190	0,04
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.13%, 09/03/2027	92	0,02
200.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.13%, 09/03/2029	165	0,03
125.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.13%, 15/03/2029	103	0,02
175.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.40%, 06/05/2030	141	0,03
250.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.25%, 08/03/2031	210	0,04
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.50%, 09/03/2033	74	0,01
125.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.38%, 15/03/2033	91	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Stati Uniti (continua)				
340.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.63%, 09/03/2035	266	0,05
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.95%, 06/05/2036	69	0,01
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.10%, 02/09/2036	71	0,01
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.80%, 15/03/2040	61	0,01
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.00%, 09/03/2041	62	0,01
100.000	EUR	Colgate-Palmolive Co., 0.50%, 06/03/2026	93	0,02
100.000	EUR	Colgate-Palmolive Co., 0.30%, 10/11/2029	83	0,02
100.000	EUR	Colgate-Palmolive Co., 1.38%, 06/03/2034	80	0,02
100.000	EUR	Colgate-Palmolive Co., 0.88%, 12/11/2039	63	0,01
650.000	EUR	Comcast Corp., 0.00%, 14/09/2026	579	0,12
100.000	EUR	Comcast Corp., 0.25%, 20/05/2027	88	0,02
200.000	EUR	Comcast Corp., 0.25%, 14/09/2029	161	0,03
300.000	EUR	Comcast Corp., 0.75%, 20/02/2032	232	0,05
100.000	EUR	Comcast Corp., 1.25%, 20/02/2040	65	0,01
100.000	EUR	Computershare US, Inc., 1.13%, 07/10/2031	73	0,01
160.000	EUR	Danaher Corp., 2.10%, 30/09/2026	152	0,03
200.000	EUR	Danaher Corp., 2.50%, 30/03/2030	183	0,04
200.000	EUR	Digital Euro Finco LLC, REIT, 2.50%, 16/01/2026	190	0,04
100.000	EUR	Digital Euro Finco LLC, REIT, 1.13%, 09/04/2028	85	0,02
100.000	EUR	Discovery Communications LLC, 1.90%, 19/03/2027	92	0,02
100.000	EUR	Dover Corp., 1.25%, 09/11/2026	92	0,02
100.000	EUR	Dover Corp., 0.75%, 04/11/2027	88	0,02
110.000	EUR	Dow Chemical Co. (The), 0.50%, 15/03/2027	97	0,02
300.000	EUR	Dow Chemical Co. (The), 1.13%, 15/03/2032	230	0,05
100.000	EUR	Dow Chemical Co. (The), 1.88%, 15/03/2040	66	0,01
100.000	EUR	DXC Technology Co., 1.75%, 15/01/2026	93	0,02
100.000	EUR	Eli Lilly & Co., 1.63%, 02/06/2026	95	0,02
100.000	EUR	Eli Lilly & Co., 2.13%, 03/06/2030	91	0,02
100.000	EUR	Eli Lilly & Co., 0.63%, 01/11/2031	79	0,02
150.000	EUR	Eli Lilly & Co., 0.50%, 14/09/2033	111	0,02
125.000	EUR	Eli Lilly & Co., 1.70%, 01/11/2049	78	0,02
200.000	EUR	Eli Lilly & Co., 1.13%, 14/09/2051	103	0,02
150.000	EUR	Eli Lilly & Co., 1.38%, 14/09/2061	70	0,01
100.000	EUR	Emerson Electric Co., 1.25%, 15/10/2025	95	0,02
100.000	EUR	Emerson Electric Co., 2.00%, 15/10/2029	90	0,02
200.000	EUR	Equinix, Inc., REIT, 0.25%, 15/03/2027	175	0,03
200.000	EUR	Equinix, Inc., REIT, 1.00%, 15/03/2033	148	0,03
100.000	EUR	Euronet Worldwide, Inc., 1.38%, 22/05/2026	90	0,02
350.000	EUR	FedEx Corp., 1.63%, 11/01/2027	324	0,06
175.000	EUR	FedEx Corp., 0.45%, 04/05/2029	143	0,03
100.000	EUR	FedEx Corp., 1.30%, 05/08/2031	81	0,02
100.000	EUR	FedEx Corp., 0.95%, 04/05/2033	73	0,01
100.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 0.63%, 03/12/2025	93	0,02
300.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 1.50%, 21/05/2027	272	0,05
200.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 1.00%, 03/12/2028	170	0,03
225.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 2.00%, 21/05/2030	195	0,04
100.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 2.95%, 21/05/2039	77	0,01
100.000	EUR	Fiserv, Inc., 1.13%, 01/07/2027	90	0,02
100.000	EUR	Fiserv, Inc., 1.63%, 01/07/2030	84	0,02
200.000	EUR	Fiserv, Inc., 4.50%, 24/05/2031	198	0,04
100.000	EUR	General Electric Co., 0.88%, 17/05/2025	95	0,02
200.000	EUR	General Electric Co., 1.88%, 28/05/2027	186	0,04
150.000	EUR	General Electric Co., 1.50%, 17/05/2029	132	0,03
200.000	EUR	General Electric Co., 4.13%, 19/09/2035	195	0,04
225.000	EUR	General Electric Co., 2.13%, 17/05/2037	172	0,03
100.000	EUR	General Mills, Inc., 0.13%, 15/11/2025	92	0,02
200.000	EUR	General Mills, Inc., 0.45%, 15/01/2026	184	0,04
300.000	EUR	General Mills, Inc., 3.91%, 13/04/2029	296	0,06
100.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 1.69%, 26/03/2025	96	0,02

NM1123U-3256239-95/201

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Stati Uniti (continua)				
200.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 0.85%, 26/02/2026	184	0,04
100.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 0.60%, 20/05/2027	87	0,02
275.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 4.50%, 22/11/2027	272	0,05
200.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 0.65%, 07/09/2028	165	0,03
325.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 4.30%, 15/02/2029	314	0,06
100.000	EUR	Global Payments, Inc., 4.88%, 17/03/2031	97	0,02
340.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 3.38%, 27/03/2025	336	0,07
200.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.25%, 01/05/2025	191	0,04
200.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 2.88%, 03/06/2026	195	0,04
500.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.63%, 27/07/2026	469	0,09
400.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.25%, 26/01/2028	338	0,07
150.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 2.00%, 22/03/2028	137	0,03
300.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 2.00%, 01/11/2028	270	0,05
279.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.25%, 07/02/2029	235	0,05
150.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.88%, 09/05/2029	123	0,02
200.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 4.00%, 21/09/2029	195	0,04
375.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.88%, 21/01/2030	302	0,06
275.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 3.00%, 12/02/2031	252	0,05
225.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.75%, 23/03/2032	165	0,03
225.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.00%, 18/03/2033	164	0,03
150.000	EUR	Harley-Davidson Financial Services, Inc., 0.90%, 19/11/2024	144	0,03
300.000	EUR	Harley-Davidson Financial Services, Inc., 5.13%, 05/04/2026	303	0,06
150.000	EUR	Illinois Tool Works, Inc., 0.25%, 05/12/2024	144	0,03
475.000	EUR	Illinois Tool Works, Inc., 0.63%, 05/12/2027	419	0,08
100.000	EUR	Illinois Tool Works, Inc., 2.13%, 22/05/2030	90	0,02
100.000	EUR	Illinois Tool Works, Inc., 1.00%, 05/06/2031	82	0,02
200.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.88%, 31/01/2025	192	0,04
200.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.95%, 23/05/2025	190	0,04
150.000	EUR	International Business Machines Corp., 2.88%, 07/11/2025	147	0,03
200.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.25%, 29/01/2027	184	0,04
300.000	EUR	International Business Machines Corp., 3.38%, 06/02/2027	295	0,06
100.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.30%, 11/02/2028	86	0,02
150.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.75%, 07/03/2028	137	0,03
100.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.50%, 23/05/2029	88	0,02
150.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.88%, 09/02/2030	124	0,02
200.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.75%, 31/01/2031	171	0,03
250.000	EUR	International Business Machines Corp., 3.63%, 06/02/2031	242	0,05
375.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.65%, 11/02/2032	284	0,06
250.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.25%, 09/02/2034	189	0,04
325.000	EUR	International Business Machines Corp., 3.75%, 06/02/2035	309	0,06
175.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.20%, 11/02/2040	109	0,02
200.000	EUR	International Business Machines Corp., 4.00%, 06/02/2043	183	0,04
400.000	EUR	International Flavors & Fragrances, Inc., 1.80%, 25/09/2026	362	0,07
200.000	EUR	Johnson & Johnson, 1.15%, 20/11/2028	178	0,04
250.000	EUR	Johnson & Johnson, 1.65%, 20/05/2035	203	0,04
150.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., 1.50%, 27/01/2025	145	0,03
300.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., 3.00%, 19/02/2026	293	0,06
300.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., 1.50%, 29/10/2026	278	0,06
100.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., 2.88%, 24/05/2028	95	0,02
490.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.09%, 11/03/2027	453	0,09
350.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 0.39%, 24/02/2028	306	0,06
450.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.64%, 18/05/2028	410	0,08
300.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.81%, 12/06/2029	267	0,05
475.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.96%, 23/03/2030	418	0,09
250.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.00%, 25/07/2031	201	0,04
375.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.05%, 04/11/2032	290	0,06
325.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 0.60%, 17/02/2033	239	0,05
200.000	EUR	Kellogg Co., 1.25%, 10/03/2025	192	0,04
100.000	EUR	Kellogg Co., 0.50%, 20/05/2029	82	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Stati Uniti (continua)				
100.000	EUR	Kinder Morgan, Inc., 2.25%, 16/03/2027	93	0,02
150.000	EUR	KKR Group Finance Co. V LLC, 1.63%, 22/05/2029	126	0,02
300.000	EUR	Kraft Heinz Foods Co., 2.25%, 25/05/2028	278	0,06
200.000	EUR	Liberty Mutual Group, Inc., 2.75%, 04/05/2026	192	0,04
100.000	EUR	Liberty Mutual Group, Inc., 4.63%, 02/12/2030	96	0,02
100.000	EUR	Linde, Inc., 1.63%, 01/12/2025	95	0,02
100.000	EUR	ManpowerGroup, Inc., 1.75%, 22/06/2026	94	0,02
300.000	EUR	ManpowerGroup, Inc., 3.50%, 30/06/2027	292	0,06
200.000	EUR	Marsh & McLennan Cos., Inc., 1.35%, 21/09/2026	185	0,04
200.000	EUR	Marsh & McLennan Cos., Inc., 1.98%, 21/03/2030	175	0,03
100.000	EUR	MassMutual Global Funding II, 3.75%, 19/01/2030	97	0,02
200.000	EUR	Mastercard, Inc., 2.10%, 01/12/2027	189	0,04
100.000	EUR	Mastercard, Inc., 1.00%, 22/02/2029	87	0,02
200.000	EUR	McDonald's Corp., 2.38%, 27/11/2024	197	0,04
100.000	EUR	McDonald's Corp., 1.88%, 26/05/2027	93	0,02
200.000	EUR	McDonald's Corp., 1.75%, 03/05/2028	183	0,04
125.000	EUR	McDonald's Corp., 0.25%, 04/10/2028	104	0,02
100.000	EUR	McDonald's Corp., 2.38%, 31/05/2029	91	0,02
100.000	EUR	McDonald's Corp., 2.63%, 11/06/2029	93	0,02
100.000	EUR	McDonald's Corp., 1.50%, 28/11/2029	86	0,02
300.000	EUR	McDonald's Corp., 4.00%, 07/03/2030	299	0,06
100.000	EUR	McDonald's Corp., 1.60%, 15/03/2031	85	0,02
150.000	EUR	McDonald's Corp., 0.88%, 04/10/2033	110	0,02
100.000	EUR	McDonald's Corp., 3.00%, 31/05/2034	89	0,02
100.000	EUR	McDonald's Corp., 4.25%, 07/03/2035	99	0,02
250.000	EUR	McKesson Corp., 1.63%, 30/10/2026	234	0,05
100.000	EUR	Merck & Co., Inc., 0.50%, 02/11/2024	96	0,02
200.000	EUR	Merck & Co., Inc., 2.50%, 15/10/2034	176	0,03
100.000	EUR	Merck & Co., Inc., 1.38%, 02/11/2036	74	0,01
200.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.55%, 16/06/2027	177	0,03
100.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 4.00%, 05/04/2028	100	0,02
200.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.50%, 25/05/2029	163	0,03
100.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 3.75%, 05/12/2030	97	0,02
450.000	EUR	Microsoft Corp., 3.13%, 06/12/2028	442	0,09
100.000	EUR	Microsoft Corp., 2.63%, 02/05/2033	92	0,02
100.000	EUR	MMS USA Holdings, Inc., 0.63%, 13/06/2025	94	0,02
100.000	EUR	MMS USA Holdings, Inc., 1.25%, 13/06/2028	88	0,02
200.000	EUR	MMS USA Holdings, Inc., 1.75%, 13/06/2031	168	0,03
125.000	EUR	Mondelez International, Inc., 0.25%, 17/03/2028	107	0,02
100.000	EUR	Mondelez International, Inc., 0.75%, 17/03/2033	74	0,01
125.000	EUR	Mondelez International, Inc., 1.38%, 17/03/2041	79	0,02
300.000	EUR	Moody's Corp., 0.95%, 25/02/2030	247	0,05
350.000	EUR	Morgan Stanley, 1.75%, 30/01/2025	339	0,07
330.000	EUR	Morgan Stanley, 1.38%, 27/10/2026	304	0,06
190.000	EUR	Morgan Stanley, 1.88%, 27/04/2027	176	0,03
175.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 2.10%, 08/05/2026	169	0,03
100.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 1.34%, 23/10/2026	94	0,02
475.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 0.41%, 29/10/2027	421	0,09
300.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 4.81%, 25/10/2028	304	0,06
375.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 4.66%, 02/03/2029	375	0,08
475.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 0.50%, 26/10/2029	389	0,08
250.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 0.50%, 07/02/2031	193	0,04
350.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 2.95%, 07/05/2032	311	0,06
420.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 1.10%, 29/04/2033	315	0,06
300.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 5.15%, 25/01/2034	308	0,06
100.000	EUR	Mylan, Inc., 2.13%, 23/05/2025	96	0,02
100.000	EUR	Nasdaq, Inc., 1.75%, 28/03/2029	88	0,02
300.000	EUR	Nasdaq, Inc., 0.88%, 13/02/2030	245	0,05
100.000	EUR	Nasdaq, Inc., 4.50%, 15/02/2032	99	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Stati Uniti (continua)				
200.000	EUR	Nasdaq, Inc., 0.90%, 30/07/2033	143	0,03
200.000	EUR	National Grid North America, Inc., 0.41%, 20/01/2026	183	0,04
100.000	EUR	National Grid North America, Inc., 1.05%, 20/01/2031	79	0,02
125.000	EUR	National Grid North America, Inc., 4.67%, 12/09/2033	123	0,02
200.000	EUR	Nestle Holdings, Inc., 0.88%, 18/07/2025	190	0,04
100.000	EUR	Netflix, Inc., 3.00%, 15/06/2025	98	0,02
400.000	EUR	Netflix, Inc., 3.63%, 15/05/2027	392	0,08
200.000	EUR	Netflix, Inc., 4.63%, 15/05/2029	202	0,04
300.000	EUR	Netflix, Inc., 3.88%, 15/11/2029	291	0,06
200.000	EUR	Netflix, Inc., 3.63%, 15/06/2030	190	0,04
200.000	EUR	New York Life Global Funding, 0.25%, 23/01/2027	177	0,04
100.000	EUR	New York Life Global Funding, 0.25%, 04/10/2028	84	0,02
100.000	EUR	New York Life Global Funding, 3.63%, 09/01/2030	97	0,02
200.000	EUR	Oracle Corp., 3.13%, 10/07/2025	197	0,04
150.000	EUR	Parker-Hannifin Corp., 1.13%, 01/03/2025	144	0,03
100.000	EUR	PepsiCo, Inc., 2.63%, 28/04/2026	97	0,02
150.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.75%, 18/03/2027	136	0,03
100.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.50%, 06/05/2028	87	0,02
100.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.88%, 18/07/2028	88	0,02
100.000	EUR	PepsiCo, Inc., 1.13%, 18/03/2031	83	0,02
150.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.40%, 09/10/2032	112	0,02
200.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.75%, 14/10/2033	150	0,03
100.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.88%, 16/10/2039	63	0,01
200.000	EUR	PepsiCo, Inc., 1.05%, 09/10/2050	108	0,02
200.000	EUR	Pfizer, Inc., 1.00%, 06/03/2027	183	0,04
100.000	EUR	PPG Industries, Inc., 0.88%, 03/11/2025	94	0,02
100.000	EUR	PPG Industries, Inc., 1.40%, 13/03/2027	91	0,02
200.000	EUR	PPG Industries, Inc., 2.75%, 01/06/2029	186	0,04
100.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 0.50%, 25/10/2024	97	0,02
100.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 0.63%, 30/10/2024	97	0,02
300.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 3.25%, 02/08/2026	296	0,06
200.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 4.88%, 11/05/2027	208	0,04
150.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 1.20%, 30/10/2028	134	0,03
300.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 0.35%, 05/05/2030	244	0,05
200.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 1.88%, 30/10/2038	155	0,03
100.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 0.90%, 04/11/2041	61	0,01
200.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 0.25%, 10/09/2027	172	0,03
100.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 0.38%, 06/02/2028	85	0,02
100.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 1.00%, 08/02/2029	83	0,02
200.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 3.88%, 31/01/2030	192	0,04
150.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 0.63%, 10/09/2031	111	0,02
450.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 0.50%, 16/02/2032	320	0,06
100.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 4.63%, 23/05/2033	97	0,02
200.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 1.50%, 08/02/2034	146	0,03
105.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 1.00%, 06/02/2035	69	0,01
100.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 1.00%, 16/02/2041	53	0,01
100.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 4.25%, 31/01/2043	87	0,02
100.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 1.50%, 10/09/2049	50	0,01
100.000	EUR	Prologis LP, REIT, 3.00%, 02/06/2026	97	0,02
125.000	EUR	Public Storage Operating Co., REIT, 0.50%, 09/09/2030	96	0,02
200.000	EUR	Public Storage Operating Co., REIT, 0.88%, 24/01/2032	150	0,03
200.000	EUR	PVH Corp., 3.13%, 15/12/2027	188	0,04
300.000	EUR	Realty Income Corp., REIT, 4.88%, 06/07/2030	298	0,06
100.000	EUR	Realty Income Corp., REIT, 5.13%, 06/07/2034	99	0,02
100.000	EUR	RELX Capital, Inc., 1.30%, 12/05/2025	95	0,02
200.000	EUR	Revvity, Inc., 1.88%, 19/07/2026	187	0,04
200.000	EUR	Stryker Corp., 0.25%, 03/12/2024	191	0,04
100.000	EUR	Stryker Corp., 2.13%, 30/11/2027	93	0,02
200.000	EUR	Stryker Corp., 0.75%, 01/03/2029	169	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Stati Uniti (continua)				
100.000	EUR	Stryker Corp., 2.63%, 30/11/2030	91	0,02
200.000	EUR	Stryker Corp., 1.00%, 03/12/2031	158	0,03
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 0.13%, 01/03/2025	94	0,02
200.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 2.00%, 15/04/2025	194	0,04
200.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 3.20%, 21/01/2026	197	0,04
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.40%, 23/01/2026	94	0,02
200.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.45%, 16/03/2027	185	0,04
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.75%, 15/04/2027	93	0,02
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 0.50%, 01/03/2028	86	0,02
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.38%, 12/09/2028	89	0,02
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.95%, 24/07/2029	90	0,02
200.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 0.88%, 01/10/2031	157	0,03
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 2.38%, 15/04/2032	88	0,02
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 3.65%, 21/11/2034	95	0,02
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 2.88%, 24/07/2037	85	0,02
150.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.50%, 01/10/2039	100	0,02
350.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.88%, 01/10/2049	206	0,04
100.000	EUR	Toyota Motor Credit Corp., 0.63%, 21/11/2024	96	0,02
400.000	EUR	Toyota Motor Credit Corp., 0.25%, 16/07/2026	361	0,07
150.000	EUR	Toyota Motor Credit Corp., 0.13%, 05/11/2027	129	0,03
400.000	EUR	Toyota Motor Credit Corp., 4.05%, 13/09/2029	400	0,08
200.000	EUR	Toyota Motor Credit Corp., 3.85%, 24/07/2030	197	0,04
175.000	EUR	Unilever Capital Corp., 3.40%, 06/06/2033	167	0,03
100.000	EUR	United Parcel Service, Inc., 1.63%, 15/11/2025	96	0,02
100.000	EUR	United Parcel Service, Inc., 1.00%, 15/11/2028	87	0,02
100.000	EUR	United Parcel Service, Inc., 1.50%, 15/11/2032	81	0,02
200.000	EUR	Utah Acquisition Sub, Inc., 2.25%, 22/11/2024	195	0,04
200.000	EUR	Utah Acquisition Sub, Inc., 3.13%, 22/11/2028	184	0,04
200.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 0.88%, 02/04/2025	191	0,04
300.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 3.25%, 17/02/2026	294	0,06
200.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.38%, 27/10/2026	185	0,04
200.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 0.88%, 08/04/2027	179	0,04
400.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.38%, 02/11/2028	351	0,07
250.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 0.38%, 22/03/2029	204	0,04
400.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.25%, 08/04/2030	333	0,07
325.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 4.25%, 31/10/2030	324	0,06
150.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 2.63%, 01/12/2031	133	0,03
100.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 0.88%, 19/03/2032	76	0,01
275.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 0.75%, 22/03/2032	206	0,04
275.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.30%, 18/05/2033	209	0,04
225.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 4.75%, 31/10/2034	229	0,05
100.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.13%, 19/09/2035	69	0,01
300.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 2.88%, 15/01/2038	245	0,05
100.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.50%, 19/09/2039	65	0,01
200.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.85%, 18/05/2040	134	0,03
300.000	EUR	VF Corp., 4.13%, 07/03/2026	296	0,06
100.000	EUR	VF Corp., 0.25%, 25/02/2028	83	0,02
125.000	EUR	VF Corp., 4.25%, 07/03/2029	121	0,02
100.000	EUR	VF Corp., 0.63%, 25/02/2032	71	0,01
400.000	EUR	Visa, Inc., 1.50%, 15/06/2026	377	0,08
100.000	EUR	Visa, Inc., 2.00%, 15/06/2029	91	0,02
200.000	EUR	Visa, Inc., 2.38%, 15/06/2034	175	0,03
100.000	EUR	Walgreens Boots Alliance, Inc., 2.13%, 20/11/2026	93	0,02
550.000	EUR	Walmart, Inc., 2.55%, 08/04/2026	533	0,11
100.000	EUR	Walmart, Inc., 4.88%, 21/09/2029	106	0,02
200.000	EUR	Westlake Corp., 1.63%, 17/07/2029	167	0,03
200.000	EUR	Worley US Finance Sub Ltd., 0.88%, 09/06/2026	180	0,04
100.000	EUR	Zimmer Biomet Holdings, Inc., 2.43%, 13/12/2026	95	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto		
OBBLIGAZIONI (continua)						
Titoli del debito societario (continua)						
		Stati Uniti (continua)				
100.000	EUR	Zimmer Biomet Holdings, Inc., 1.16%, 15/11/2027	89	0,02		
		Stati Uniti - Totale	72.565	14,71		
Totale investimenti in titoli di debito societario			486.043	98,53		
Totale investimenti in obbligazioni			486.043	98,53		
Numero di contratti	Valuta	Importo	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto	
Contratti future						
Germania (31 marzo 2023: 0,00%)						
(9)	EUR	(900.000)	Euro-Bobl	07/12/2023	2	–
(10)	EUR	(1.000.000)	Euro-Bund	07/12/2023	12	–
Germania - Totale			14	–		
Totale utili non realizzati su contratti future (31 marzo 2023: 0,00%)			14	–		
Germania (31 marzo 2023: (0,03)%)			–	–		
Totale perdite non realizzate su contratti future (31 marzo 2023: (0,03)%)			–	–		
			Valore equo (migliaia di EUR)	% del valore patrimoniale netto		
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico			486.057	98,53		
Liquidità e liquidità a margine			76	0,02		
Strumenti liquidi equivalenti						
Partecipazione	Valuta	Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2023: 0,45%)				
21.731	EUR	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0) ³	2.189	0,44		
Totale in strumenti liquidi equivalenti			2.189	0,44		
Altre attività e passività			4.990	1,01		
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili			493.312	100,00		
Analisi del totale attività				% del totale attività		
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale				97,97		
Organismi di investimento collettivo				0,44		
Strumenti finanziari derivati negoziati in un mercato regolamentato [*]				–		
Altre attività				1,59		
Totale attività				100,00		

¹ Il titolo è perpetuo, senza una data di scadenza predeterminata. La data indicata, se applicabile, è la data di richiamo successiva.

² Una parte correlata al Fondo.

^{*} Gli investimenti inferiori a 0,005% delle attività totali sono arrotondati a zero.

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Valore dell'esposizione	Sui guadagni Migliaia di EUR	Sulle perdite Migliaia di EUR
Contratti future	2.328	-

BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI				
Titoli di Stato (31 marzo 2023: 99,05%)				
Austria (31 marzo 2023: 3,48%)				
20.000	EUR	Austria Government Bond, 1.65%, 21/10/2024	20	0,19
20.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/04/2025	19	0,18
15.000	EUR	Austria Government Bond, 1.20%, 20/10/2025	14	0,14
10.000	EUR	Austria Government Bond, 4.85%, 15/03/2026	10	0,10
15.000	EUR	Austria Government Bond, 0.75%, 20/10/2026	14	0,14
8.000	EUR	Austria Government Bond, 0.50%, 20/04/2027	7	0,07
50.000	EUR	Austria Government Bond, 6.25%, 15/07/2027	55	0,54
20.000	EUR	Austria Government Bond, 0.75%, 20/02/2028	18	0,17
1.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/10/2028	1	0,01
19.000	EUR	Austria Government Bond, 0.50%, 20/02/2029	17	0,16
50.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/02/2030	41	0,40
13.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/02/2031	10	0,10
7.000	EUR	Austria Government Bond, 0.90%, 20/02/2032	6	0,06
20.000	EUR	Austria Government Bond, 2.90%, 20/02/2033	19	0,19
21.000	EUR	Austria Government Bond, 2.40%, 23/05/2034	19	0,19
21.000	EUR	Austria Government Bond, 0.25%, 20/10/2036	14	0,13
13.000	EUR	Austria Government Bond, 4.15%, 15/03/2037	14	0,13
11.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/10/2040	6	0,06
12.000	EUR	Austria Government Bond, 3.15%, 20/06/2044	11	0,11
17.000	EUR	Austria Government Bond, 1.50%, 20/02/2047	11	0,11
6.000	EUR	Austria Government Bond, 1.85%, 23/05/2049	4	0,04
11.000	EUR	Austria Government Bond, 0.75%, 20/03/2051	6	0,05
6.000	EUR	Austria Government Bond, 3.15%, 20/10/2053	5	0,05
7.000	EUR	Austria Government Bond, 3.80%, 26/01/2062	7	0,07
4.000	EUR	Austria Government Bond, 0.70%, 20/04/2071	2	0,01
3.000	EUR	Austria Government Bond, 1.50%, 02/11/2086	2	0,01
10.000	EUR	Austria Government Bond, 2.10%, 20/09/2117	6	0,06
9.000	EUR	Austria Government Bond, 0.85%, 30/06/2120	3	0,03
Austria - Totale			361	3,50
Belgio (31 marzo 2023: 5,37%)				
10.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.50%, 22/10/2024	10	0,09
34.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.80%, 22/06/2025	33	0,32
27.000	EUR	Belgium Government Bond, 4.50%, 28/03/2026	28	0,27
21.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.00%, 22/06/2026	20	0,19
10.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.80%, 22/06/2027	9	0,09
7.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.00%, 22/10/2027	6	0,06
77.000	EUR	Belgium Government Bond, 5.50%, 28/03/2028	85	0,82
10.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.80%, 22/06/2028	9	0,09
24.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.90%, 22/06/2029	21	0,21
21.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.10%, 22/06/2030	17	0,17
11.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.00%, 22/06/2031	9	0,09
32.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.00%, 22/10/2031	25	0,24
23.000	EUR	Belgium Government Bond, 4.00%, 28/03/2032	24	0,23
25.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.35%, 22/06/2032	19	0,19
14.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.25%, 22/04/2033	12	0,11
21.000	EUR	Belgium Government Bond, 3.00%, 22/06/2033	20	0,20
12.000	EUR	Belgium Government Bond, 3.00%, 22/06/2034	11	0,11
30.000	EUR	Belgium Government Bond, 5.00%, 28/03/2035	34	0,33
19.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.45%, 22/06/2037	14	0,14
20.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.90%, 22/06/2038	16	0,15
3.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.40%, 22/06/2040	2	0,02
28.000	EUR	Belgium Government Bond, 4.25%, 28/03/2041	29	0,29
12.000	EUR	Belgium Government Bond, 3.45%, 22/06/2043	11	0,11
20.000	EUR	Belgium Government Bond, 3.75%, 22/06/2045	20	0,19
7.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.60%, 22/06/2047	5	0,04
25.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.70%, 22/06/2050	16	0,15

BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Belgio (continua)				
10.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.40%, 22/06/2053	6	0,05
14.000	EUR	Belgium Government Bond, 3.30%, 22/06/2054	12	0,12
17.000	EUR	Belgium Government Bond, 2.25%, 22/06/2057	12	0,11
6.000	EUR	Belgium Government Bond, 2.15%, 22/06/2066	4	0,04
15.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.65%, 22/06/2071	5	0,05
Belgio - Totale			544	5,27
Croazia (31 marzo 2023: 0,36%)			-	-
Cipro (31 marzo 2023: 0,12%)				
15.000	EUR	Cyprus Government Bond, 2.38%, 25/09/2028	14	0,14
5.000	EUR	Cyprus Government Bond, 2.75%, 03/05/2049	4	0,03
Cipro - Totale			18	0,17
Estonia (31 marzo 2023: 0,04%)				
6.000	EUR	Estonia Government Bond, 0.13%, 10/06/2030	5	0,05
Estonia - Totale			5	0,05
Finlandia (31 marzo 2023: 1,49%)				
25.000	EUR	Finland Government Bond, 4.00%, 04/07/2025	25	0,24
5.000	EUR	Finland Government Bond, 0.88%, 15/09/2025	5	0,05
18.000	EUR	Finland Government Bond, 0.00%, 15/09/2026	16	0,16
5.000	EUR	Finland Government Bond, 0.50%, 15/09/2027	4	0,04
10.000	EUR	Finland Government Bond, 2.75%, 04/07/2028	10	0,09
5.000	EUR	Finland Government Bond, 0.50%, 15/09/2028	4	0,04
17.000	EUR	Finland Government Bond, 0.50%, 15/09/2029	15	0,14
15.000	EUR	Finland Government Bond, 0.75%, 15/04/2031	12	0,12
18.000	EUR	Finland Government Bond, 0.13%, 15/09/2031	14	0,14
12.000	EUR	Finland Government Bond, 1.50%, 15/09/2032	10	0,10
15.000	EUR	Finland Government Bond, 1.13%, 15/04/2034	12	0,12
10.000	EUR	Finland Government Bond, 2.75%, 15/04/2038	9	0,09
1.000	EUR	Finland Government Bond, 0.25%, 15/09/2040	1	0,01
16.000	EUR	Finland Government Bond, 2.63%, 04/07/2042	14	0,13
3.000	EUR	Finland Government Bond, 0.50%, 15/04/2043	2	0,02
10.000	EUR	Finland Government Bond, 1.38%, 15/04/2047	7	0,06
4.000	EUR	Finland Government Bond, 0.13%, 15/04/2052	2	0,02
Finlandia - Totale			162	1,57
Francia (31 marzo 2023: 23,63%)				
44.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.75%, 25/11/2024	43	0,42
44.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2025	42	0,41
72.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/03/2025	68	0,66
67.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2025	64	0,62
118.000	EUR	France Government Bond OAT, 6.00%, 25/10/2025	124	1,20
46.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.00%, 25/11/2025	44	0,43
61.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2026	57	0,55
32.000	EUR	France Government Bond OAT, 3.50%, 25/04/2026	32	0,31
78.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2026	73	0,71
30.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.50%, 24/09/2026	29	0,28
100.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.25%, 25/11/2026	91	0,89
20.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2027	18	0,17
82.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.00%, 25/05/2027	76	0,74
112.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.75%, 25/10/2027	110	1,07
37.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/02/2028	33	0,32

BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Francia (continua)				
101.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2028	91	0,88
83.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/11/2028	74	0,71
19.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.75%, 25/02/2029	19	0,18
86.000	EUR	France Government Bond OAT, 5.50%, 25/04/2029	96	0,93
128.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2029	111	1,07
30.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/11/2029	25	0,24
80.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.50%, 25/05/2030	77	0,74
47.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/11/2030	38	0,36
94.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2031	83	0,81
137.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/11/2031	106	1,02
76.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/05/2032	57	0,56
70.000	EUR	France Government Bond OAT, 5.75%, 25/10/2032	83	0,81
97.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.00%, 25/11/2032	87	0,84
55.000	EUR	France Government Bond OAT, 3.00%, 25/05/2033	53	0,52
61.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.25%, 25/05/2034	49	0,48
26.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.75%, 25/04/2035	29	0,28
44.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.25%, 25/05/2036	34	0,33
5.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.25%, 25/05/2038	4	0,04
54.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.00%, 25/10/2038	56	0,54
57.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.75%, 25/06/2039	44	0,43
48.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2040	29	0,28
68.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.50%, 25/04/2041	75	0,72
25.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.50%, 25/05/2043	21	0,20
23.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/06/2044	12	0,12
38.000	EUR	France Government Bond OAT, 3.25%, 25/05/2045	35	0,34
44.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.00%, 25/05/2048	31	0,30
52.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2050	32	0,31
81.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2052	38	0,37
11.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2053	5	0,05
27.000	EUR	France Government Bond OAT, 3.00%, 25/05/2054	23	0,22
44.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.00%, 25/04/2055	45	0,44
25.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.00%, 25/04/2060	26	0,25
30.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.75%, 25/05/2066	17	0,17
16.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2072	5	0,05
Francia - Totale			2.514	24,37
Germania (31 marzo 2023: 18,67%)				
36.000	EUR	Bundesobligation, 0.00%, 11/04/2025	34	0,33
56.000	EUR	Bundesobligation, 0.00%, 10/10/2025	53	0,51
41.000	EUR	Bundesobligation, 0.00%, 10/10/2025	39	0,37
10.000	EUR	Bundesobligation, 0.00%, 16/04/2027	9	0,09
26.000	EUR	Bundesobligation, 1.30%, 15/10/2027	25	0,24
39.000	EUR	Bundesobligation, 2.20%, 13/04/2028	38	0,37
78.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.50%, 15/02/2025	75	0,73
66.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.00%, 15/08/2025	63	0,61
47.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/02/2027	43	0,42
229.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.50%, 04/07/2027	258	2,50
46.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.50%, 15/08/2027	42	0,41
40.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.63%, 04/01/2028	45	0,43
40.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.50%, 15/02/2028	36	0,35
30.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.75%, 04/07/2028	33	0,32
44.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/08/2028	39	0,38
41.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/11/2028	36	0,35
50.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2029	43	0,41
92.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.10%, 15/11/2029	89	0,86
22.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.25%, 04/01/2030	26	0,26
20.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/02/2030	17	0,16

BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Germania (continua)				
24.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2030	20	0,19
5.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2030	4	0,04
56.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.50%, 04/01/2031	66	0,64
22.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/02/2031	18	0,18
48.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2031	39	0,38
23.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2031	19	0,18
104.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/02/2032	83	0,80
44.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.70%, 15/08/2032	40	0,39
53.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.30%, 15/02/2033	51	0,49
9.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.60%, 15/08/2033	9	0,09
38.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.75%, 04/07/2034	45	0,43
56.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/05/2035	40	0,39
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/05/2036	7	0,07
48.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.00%, 04/01/2037	53	0,52
28.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.00%, 15/05/2038	21	0,21
52.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.25%, 04/07/2039	60	0,58
14.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.75%, 04/07/2040	17	0,17
32.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 3.25%, 04/07/2042	33	0,32
46.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.50%, 04/07/2044	42	0,41
50.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.50%, 15/08/2046	46	0,44
59.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.25%, 15/08/2048	41	0,40
59.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2050	27	0,26
14.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2050	6	0,06
35.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2052	15	0,15
11.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.80%, 15/08/2053	8	0,08
37.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.80%, 15/08/2053	28	0,27
40.000	EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.50%, 13/03/2025	40	0,38
36.000	EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.80%, 12/06/2025	36	0,35
Germania - Totale			1.957	18,97
Irlanda (31 marzo 2023: 1,73%)				
10.000	EUR	Ireland Government Bond, 5.40%, 13/03/2025	10	0,10
19.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.00%, 15/05/2026	18	0,17
18.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.20%, 15/05/2027	16	0,16
15.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.90%, 15/05/2028	14	0,13
10.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.10%, 15/05/2029	9	0,09
10.000	EUR	Ireland Government Bond, 2.40%, 15/05/2030	10	0,09
18.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.20%, 18/10/2030	15	0,14
15.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.35%, 18/03/2031	13	0,13
13.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.00%, 18/10/2031	10	0,10
7.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.35%, 18/10/2032	5	0,05
15.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.30%, 15/05/2033	13	0,12
10.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.70%, 15/05/2037	8	0,08
6.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.55%, 22/04/2041	4	0,04
10.000	EUR	Ireland Government Bond, 3.00%, 18/10/2043	9	0,09
14.000	EUR	Ireland Government Bond, 2.00%, 18/02/2045	10	0,10
14.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.50%, 15/05/2050	9	0,09
Irlanda - Totale			173	1,68
Italia (31 marzo 2023: 21,66%)				
31.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.45%, 15/11/2024	30	0,29
25.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.50%, 01/12/2024	25	0,24
20.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.35%, 01/02/2025	19	0,19
50.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.00%, 01/03/2025	51	0,49
50.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.40%, 28/03/2025	50	0,48
49.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.45%, 15/05/2025	47	0,46

BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Italia (continua)				
30.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.50%, 01/06/2025	29	0,28
40.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.85%, 01/07/2025	39	0,37
52.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.20%, 15/08/2025	49	0,48
10.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.60%, 29/09/2025	10	0,10
31.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.50%, 15/11/2025	30	0,29
19.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.00%, 01/12/2025	18	0,18
40.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.50%, 01/02/2026	37	0,36
40.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.00%, 01/04/2026	36	0,35
21.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.60%, 01/06/2026	20	0,19
13.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.10%, 15/07/2026	12	0,12
20.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.00%, 01/08/2026	18	0,17
16.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 7.25%, 01/11/2026	17	0,17
55.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.25%, 01/12/2026	51	0,49
55.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.85%, 15/01/2027	50	0,48
20.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.10%, 01/04/2027	18	0,18
30.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.20%, 01/06/2027	28	0,27
80.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.05%, 01/08/2027	75	0,72
24.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 15/09/2027	21	0,21
90.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.50%, 01/11/2027	98	0,95
17.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.00%, 01/02/2028	16	0,15
22.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.25%, 15/03/2028	19	0,18
17.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.50%, 15/07/2028	14	0,14
24.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.80%, 01/08/2028	24	0,23
41.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.75%, 01/09/2028	42	0,41
34.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.80%, 01/12/2028	32	0,31
26.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.45%, 15/02/2029	21	0,21
60.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.80%, 15/06/2029	56	0,54
33.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.00%, 01/08/2029	31	0,30
65.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.25%, 01/11/2029	69	0,66
11.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.85%, 15/12/2029	11	0,10
27.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.50%, 01/03/2030	26	0,25
25.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.35%, 01/04/2030	21	0,20
38.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.70%, 15/06/2030	37	0,35
73.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 01/08/2030	58	0,57
20.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.65%, 01/12/2030	17	0,16
33.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.90%, 01/04/2031	26	0,25
60.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.00%, 01/05/2031	66	0,64
41.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.60%, 01/08/2031	31	0,30
29.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 01/12/2031	22	0,21
14.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.65%, 01/03/2032	11	0,11
20.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 01/06/2032	15	0,14
25.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.50%, 01/12/2032	21	0,20
40.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.75%, 01/02/2033	43	0,42
30.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.40%, 01/05/2033	29	0,29
30.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.45%, 01/09/2033	25	0,24
60.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.35%, 01/11/2033	58	0,57
51.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.00%, 01/08/2034	52	0,50
16.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.35%, 01/03/2035	14	0,14
9.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.00%, 30/04/2035	8	0,08
16.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.45%, 01/03/2036	11	0,11
15.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.25%, 01/09/2036	11	0,11
54.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.00%, 01/02/2037	50	0,48
60.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 01/03/2037	37	0,36
20.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.25%, 01/03/2038	17	0,16
30.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.95%, 01/09/2038	24	0,23
26.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.00%, 01/08/2039	26	0,25
17.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.10%, 01/03/2040	13	0,13
33.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.00%, 01/09/2040	33	0,32

BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Italia (continua)				
10.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.80%, 01/03/2041	6	0,06
3.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.45%, 01/09/2043	3	0,03
40.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.75%, 01/09/2044	38	0,37
34.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.50%, 30/04/2045	19	0,18
36.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.25%, 01/09/2046	27	0,27
31.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.70%, 01/03/2047	21	0,21
40.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.45%, 01/03/2048	31	0,30
9.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.85%, 01/09/2049	7	0,07
13.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.45%, 01/09/2050	8	0,08
22.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.70%, 01/09/2051	11	0,11
15.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.15%, 01/09/2052	9	0,08
19.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.50%, 01/10/2053	17	0,17
16.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.80%, 01/03/2067	10	0,10
8.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.15%, 01/03/2072	4	0,04
Italia - Totale			2.226	21,58
Lettonia (31 marzo 2023: 0,10%)			-	-
Lituania (31 marzo 2023: 0,12%)				
20.000	EUR	Lithuania Government Bond, 0.95%, 26/05/2027	18	0,18
9.000	EUR	Lithuania Government Bond, 1.63%, 19/06/2049	5	0,05
Lituania - Totale			23	0,23
Lussemburgo (31 marzo 2023: 0,28%)				
15.000	EUR	Luxembourg Government Bond, 0.00%, 13/11/2026	14	0,13
20.000	EUR	Luxembourg Government Bond, 0.63%, 01/02/2027	18	0,18
5.000	EUR	State of the Grand-Duchy of Luxembourg, 3.25%, 02/03/2043	5	0,04
Lussemburgo - Totale			37	0,35
Paesi Bassi (31 marzo 2023: 4,42%)				
22.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.25%, 15/07/2025	21	0,20
12.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.50%, 15/07/2026	11	0,11
46.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/01/2027	42	0,40
42.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.75%, 15/07/2027	39	0,37
30.000	EUR	Netherlands Government Bond, 5.50%, 15/01/2028	33	0,32
24.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.75%, 15/07/2028	22	0,21
29.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/01/2029	25	0,24
14.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.25%, 15/07/2029	12	0,12
29.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/07/2030	24	0,23
13.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/07/2031	10	0,10
33.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.50%, 15/07/2032	26	0,26
16.000	EUR	Netherlands Government Bond, 2.50%, 15/01/2033	15	0,15
14.000	EUR	Netherlands Government Bond, 2.50%, 15/07/2033	13	0,13
37.000	EUR	Netherlands Government Bond, 4.00%, 15/01/2037	40	0,39
5.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/01/2038	3	0,03
25.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.50%, 15/01/2040	16	0,16
30.000	EUR	Netherlands Government Bond, 3.75%, 15/01/2042	32	0,31
31.000	EUR	Netherlands Government Bond, 2.75%, 15/01/2047	28	0,27
28.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/01/2052	12	0,11
13.000	EUR	Netherlands Government Bond, 2.00%, 15/01/2054	10	0,09
Paesi Bassi - Totale			434	4,20
Portogallo (31 marzo 2023: 2,03%)				
29.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.88%, 15/10/2025	29	0,28

BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Portogallo (continua)				
17.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.88%, 21/07/2026	17	0,16
8.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4.13%, 14/04/2027	8	0,08
10.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.70%, 15/10/2027	9	0,09
32.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.13%, 17/10/2028	31	0,30
20.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.95%, 15/06/2029	19	0,18
10.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 3.88%, 15/02/2030	10	0,10
26.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.48%, 18/10/2030	21	0,21
5.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.30%, 17/10/2031	4	0,04
17.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.25%, 18/04/2034	15	0,14
22.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.90%, 12/10/2035	16	0,15
16.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4.10%, 15/04/2037	16	0,16
5.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.15%, 11/04/2042	3	0,03
11.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4.10%, 15/02/2045	11	0,11
7.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.00%, 12/04/2052	3	0,03
Portogallo - Totale			212	2,06
Slovacchia (31 marzo 2023: 0,71%)				
29.000	EUR	Slovakia Government Bond, 3.38%, 15/11/2024	29	0,28
5.000	EUR	Slovakia Government Bond, 0.75%, 09/04/2030	4	0,04
6.000	EUR	Slovakia Government Bond, 1.00%, 09/10/2030	5	0,05
10.000	EUR	Slovakia Government Bond, 1.63%, 21/01/2031	9	0,08
9.000	EUR	Slovakia Government Bond, 1.00%, 14/05/2032	7	0,07
3.000	EUR	Slovakia Government Bond, 4.00%, 19/10/2032	3	0,03
25.000	EUR	Slovakia Government Bond, 1.88%, 09/03/2037	19	0,18
10.000	EUR	Slovakia Government Bond, 2.00%, 17/10/2047	6	0,06
Slovacchia - Totale			82	0,79
Slovenia (31 marzo 2023: 0,44%)				
10.000	EUR	Slovenia Government Bond, 5.13%, 30/03/2026	10	0,10
10.000	EUR	Slovenia Government Bond, 1.25%, 22/03/2027	9	0,09
13.000	EUR	Slovenia Government Bond, 0.88%, 15/07/2030	11	0,11
20.000	EUR	Slovenia Government Bond, 2.25%, 03/03/2032	18	0,17
6.000	EUR	Slovenia Government Bond, 1.50%, 25/03/2035	5	0,05
4.000	EUR	Slovenia Government Bond, 1.75%, 03/11/2040	3	0,03
3.000	EUR	Slovenia Government Bond, 1.18%, 13/02/2062	1	0,01
Slovenia - Totale			57	0,56
Spagna (31 marzo 2023: 14,40%)				
59.000	EUR	Spain Government Bond, 2.75%, 31/10/2024	58	0,57
22.000	EUR	Spain Government Bond, 0.00%, 31/01/2025	21	0,20
20.000	EUR	Spain Government Bond, 1.60%, 30/04/2025	19	0,19
25.000	EUR	Spain Government Bond, 4.65%, 30/07/2025	26	0,25
11.000	EUR	Spain Government Bond, 2.15%, 31/10/2025	11	0,10
86.000	EUR	Spain Government Bond, 0.00%, 31/01/2026	79	0,77
55.000	EUR	Spain Government Bond, 1.95%, 30/04/2026	53	0,51
60.000	EUR	Spain Government Bond, 2.80%, 31/05/2026	59	0,57
48.000	EUR	Spain Government Bond, 5.90%, 30/07/2026	51	0,49
43.000	EUR	Spain Government Bond, 1.30%, 31/10/2026	40	0,39
24.000	EUR	Spain Government Bond, 0.00%, 31/01/2027	22	0,21
23.000	EUR	Spain Government Bond, 1.50%, 30/04/2027	22	0,21
20.000	EUR	Spain Government Bond, 0.80%, 30/07/2027	18	0,18
20.000	EUR	Spain Government Bond, 0.00%, 31/01/2028	17	0,17
26.000	EUR	Spain Government Bond, 1.40%, 30/04/2028	24	0,23
18.000	EUR	Spain Government Bond, 1.40%, 30/07/2028	16	0,16
28.000	EUR	Spain Government Bond, 5.15%, 31/10/2028	30	0,29

BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Spagna (continua)				
150.000	EUR	Spain Government Bond, 6.00%, 31/01/2029	168	1,63
28.000	EUR	Spain Government Bond, 1.45%, 30/04/2029	25	0,24
17.000	EUR	Spain Government Bond, 0.80%, 30/07/2029	15	0,14
30.000	EUR	Spain Government Bond, 0.60%, 31/10/2029	25	0,24
60.000	EUR	Spain Government Bond, 0.50%, 30/04/2030	49	0,48
55.000	EUR	Spain Government Bond, 1.95%, 30/07/2030	50	0,48
20.000	EUR	Spain Government Bond, 1.25%, 31/10/2030	17	0,16
35.000	EUR	Spain Government Bond, 0.10%, 30/04/2031	27	0,26
30.000	EUR	Spain Government Bond, 0.50%, 31/10/2031	23	0,23
30.000	EUR	Spain Government Bond, 0.70%, 30/04/2032	23	0,23
25.000	EUR	Spain Government Bond, 5.75%, 30/07/2032	29	0,28
41.000	EUR	Spain Government Bond, 2.55%, 31/10/2032	37	0,36
25.000	EUR	Spain Government Bond, 3.15%, 30/04/2033	24	0,23
24.000	EUR	Spain Government Bond, 2.35%, 30/07/2033	21	0,20
39.000	EUR	Spain Government Bond, 3.55%, 31/10/2033	38	0,37
63.000	EUR	Spain Government Bond, 1.85%, 30/07/2035	50	0,49
24.000	EUR	Spain Government Bond, 4.20%, 31/01/2037	24	0,23
18.000	EUR	Spain Government Bond, 0.85%, 30/07/2037	12	0,11
19.000	EUR	Spain Government Bond, 3.90%, 30/07/2039	18	0,18
32.000	EUR	Spain Government Bond, 4.90%, 30/07/2040	34	0,33
30.000	EUR	Spain Government Bond, 1.20%, 31/10/2040	19	0,18
25.000	EUR	Spain Government Bond, 4.70%, 30/07/2041	26	0,25
9.000	EUR	Spain Government Bond, 1.00%, 30/07/2042	5	0,05
20.000	EUR	Spain Government Bond, 3.45%, 30/07/2043	18	0,17
38.000	EUR	Spain Government Bond, 5.15%, 31/10/2044	42	0,41
16.000	EUR	Spain Government Bond, 2.90%, 31/10/2046	13	0,12
30.000	EUR	Spain Government Bond, 2.70%, 31/10/2048	22	0,22
39.000	EUR	Spain Government Bond, 1.00%, 31/10/2050	18	0,18
23.000	EUR	Spain Government Bond, 1.90%, 31/10/2052	14	0,13
19.000	EUR	Spain Government Bond, 3.45%, 30/07/2066	15	0,15
17.000	EUR	Spain Government Bond, 1.45%, 31/10/2071	7	0,07
Spagna - Totale			1.474	14,29
Totale investimenti in titoli di Stato			10.279	99,64
Totale investimenti in obbligazioni			10.279	99,64
			Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico			10.279	99,64
Liquidità			15	0,14
Strumenti liquidi equivalenti				
Partecipazione	Valuta	Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2023: 0,20%)		
10	EUR	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0) ¹	1	0,01
Totale in strumenti liquidi equivalenti			1	0,01
Altre attività e passività			21	0,21
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili			10.316	100,00

BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

	% del totale attività
Analisi del totale attività	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	96,72
Organismi di investimento collettivo	0,01
Altre attività	3,27
Totale attività	<u>100,00</u>

¹Una parte correlata al Fondo.

BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di GBP)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI				
Titoli di Stato (31 marzo 2023: 1,27%)				
		Regno Unito (31 marzo 2023: 1,27%)		
700.000	GBP	UK Treasury, 3.25%, 31/01/2033	638	0,64
		Regno Unito - Totale	638	0,64
Totale investimenti in titoli di Stato			638	0,64
Titoli del debito societario (31 marzo 2023: 96,83%)				
Australia (31 marzo 2023: 2,10%)				
100.000	GBP	APA Infrastructure Ltd., 4.25%, 26/11/2024	98	0,10
325.000	GBP	BHP Billiton Finance Ltd., 4.30%, 25/09/2042 ¹	262	0,26
300.000	GBP	Macquarie Group Ltd., 4.08%, 31/05/2029	270	0,27
250.000	GBP	National Australia Bank Ltd., FRN, 1.70%, 15/09/2031 ¹	213	0,21
200.000	GBP	QBE Insurance Group Ltd., FRN, 2.50%, 13/09/2038 ¹	159	0,16
100.000	GBP	Scentre Group Trust 1, REIT, 3.88%, 16/07/2026	94	0,09
200.000	GBP	Vicinity Centres Trust, REIT, 3.38%, 07/04/2026	188	0,19
375.000	GBP	Westfield America Management Ltd., REIT, 2.63%, 30/03/2029	297	0,30
100.000	GBP	Westpac Banking Corp., 2.13%, 02/05/2025 ¹	94	0,09
		Australia - Totale	1.675	1,67
Belgio (31 marzo 2023: 0,46%)				
175.000	GBP	Anheuser-Busch InBev SA, 4.00%, 24/09/2025	171	0,17
225.000	GBP	Euroclear Bank SA, 1.25%, 30/09/2024	215	0,22
		Belgio - Totale	386	0,39
Bermuda (31 marzo 2023: 0,18%)				
125.000	GBP	Hiscox Ltd., 6.00%, 22/09/2027	125	0,12
100.000	GBP	Hiscox Ltd., FRN, 6.13%, 24/11/2045	97	0,10
		Bermuda - Totale	222	0,22
Canada (31 marzo 2023: 1,57%)				
500.000	GBP	Bank of Montreal, 1.00%, 09/09/2026	438	0,44
400.000	GBP	Royal Bank of Canada, 1.13%, 15/12/2025	362	0,36
400.000	GBP	Royal Bank of Canada, 5.00%, 24/01/2028	386	0,39
200.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 2.88%, 05/04/2027	182	0,18
400.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 5.29%, 11/01/2028	391	0,39
		Canada - Totale	1.759	1,76
Isole Cayman (31 marzo 2023: 0,72%)				
91.000	GBP	South East Water Finance Ltd., 5.58%, 29/03/2029	87	0,09
94.000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd., 6.64%, 31/03/2026	93	0,09
100.000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd., 2.38%, 28/05/2028	82	0,08
250.000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd., 6.19%, 31/03/2029	248	0,25
100.000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd., 5.00%, 31/03/2041	85	0,08
200.000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd., 4.50%, 31/03/2052	146	0,15
		Isole Cayman - Totale	741	0,74
Danimarca (31 marzo 2023: 1,21%)				
500.000	GBP	Danske Bank A/S, FRN, 4.63%, 13/04/2027	484	0,48
400.000	GBP	Danske Bank A/S, FRN, 2.25%, 14/01/2028	349	0,35
200.000	GBP	Orsted A/S, 2.13%, 17/05/2027	178	0,18

BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di GBP)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Danimarca (continua)				
100.000	GBP	Orsted A/S, 4.88%, 12/01/2032	92	0,09
100.000	GBP	Orsted A/S, 2.50%, 16/05/2033	75	0,08
250.000	GBP	Orsted A/S, 5.75%, 09/04/2040	236	0,24
250.000	GBP	Orsted A/S, 5.38%, 13/09/2042 ¹	224	0,22
Danimarca - Totale			1.638	1,64
Finlandia (31 marzo 2023: 0,20%)				
300.000	GBP	Nordea Bank Abp, FRN, 1.63%, 09/12/2032 ¹	242	0,24
Finlandia - Totale			242	0,24
Francia (31 marzo 2023: 7,52%)				
500.000	GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.25%, 05/12/2025	454	0,46
400.000	GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.00%, 19/01/2026	392	0,39
300.000	GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.38%, 25/05/2028 ¹	294	0,30
600.000	GBP	BNP Paribas SA, 1.88%, 14/12/2027 ¹	508	0,51
500.000	GBP	BNP Paribas SA, 1.25%, 13/07/2031	353	0,35
300.000	GBP	BNP Paribas SA, 5.75%, 13/06/2032	290	0,29
200.000	GBP	BNP Paribas SA, 2.00%, 13/09/2036 ¹	128	0,13
400.000	GBP	BNP Paribas SA, FRN, 2.00%, 24/05/2031	349	0,35
500.000	GBP	BPCE SA, 5.25%, 16/04/2029	462	0,46
300.000	GBP	Credit Agricole SA, 4.88%, 23/10/2029	286	0,29
200.000	GBP	Credit Agricole SA, FRN, 6.38%, 14/06/2031	201	0,20
300.000	GBP	Credit Agricole SA, FRN, 1.87%, 09/12/2031	256	0,26
200.000	GBP	Electricite de France SA, 6.25%, 30/05/2028 ¹	203	0,20
200.000	GBP	Electricite de France SA, 5.88%, 18/07/2031	195	0,20
500.000	GBP	Electricite de France SA, 6.13%, 02/06/2034	484	0,49
500.000	GBP	Electricite de France SA, 5.50%, 17/10/2041	431	0,43
300.000	GBP	Electricite de France SA, 5.13%, 22/09/2050	237	0,24
100.000	GBP	Electricite de France SA, 5.63%, 25/01/2053	84	0,08
400.000	GBP	Electricite de France SA, 6.00%, 23/01/2114 ¹	331	0,33
200.000	GBP	Engie SA, 7.00%, 30/10/2028	212	0,21
200.000	GBP	Engie SA, 5.63%, 03/04/2053	183	0,18
400.000	GBP	Engie SA, 5.00%, 01/10/2060	332	0,33
100.000	GBP	Orange SA, 8.13%, 20/11/2028	112	0,11
100.000	GBP	Orange SA, 3.25%, 15/01/2032	85	0,09
100.000	GBP	Orange SA, 5.63%, 23/01/2034	100	0,10
250.000	GBP	Orange SA, 5.38%, 22/11/2050	232	0,23
200.000	GBP	Sodexo SA, 1.75%, 26/06/2028	169	0,17
300.000	GBP	TotalEnergies Capital International SA, 1.66%, 22/07/2026	274	0,27
200.000	GBP	Vinci SA, 2.25%, 15/03/2027	181	0,18
200.000	GBP	Vinci SA, 2.75%, 15/09/2034	157	0,16
Francia - Totale			7.975	7,99
Germania (31 marzo 2023: 1,58%)				
700.000	GBP	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.88%, 13/02/2026	650	0,65
400.000	GBP	Deutsche Bank AG, 2.63%, 16/12/2024	381	0,38
200.000	GBP	Deutsche Bank AG, FRN, 4.00%, 24/06/2026	190	0,19
200.000	GBP	Deutsche Bank AG, FRN, 6.13%, 12/12/2030	186	0,19
91.000	GBP	Deutsche Telekom AG, 3.13%, 06/02/2034	74	0,08
300.000	GBP	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 1.50%, 03/02/2025	282	0,28
Germania - Totale			1.763	1,77
Irlanda (31 marzo 2023: 0,26%)				
100.000	GBP	GE Capital UK Funding Unlimited Co., 5.88%, 18/01/2033	98	0,10

BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di GBP)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Irlanda (continua)				
250.000	GBP	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co., FRN, 5.13%, 23/11/2052	221	0,22
		Irlanda - Totale	319	0,32
Italia (31 marzo 2023: 0,36%)				
200.000	GBP	Intesa Sanpaolo SpA, 2.50%, 15/01/2030	158	0,16
200.000	GBP	Intesa Sanpaolo SpA, 2.63%, 11/03/2036	130	0,13
150.000	GBP	Intesa Sanpaolo SpA, FRN, 6.50%, 14/03/2029	146	0,15
		Italia - Totale	434	0,44
Giappone (31 marzo 2023: 0,14%)				
175.000	GBP	Mizuho Financial Group, Inc., 5.63%, 13/06/2028 ¹	172	0,17
		Giappone - Totale	172	0,17
Jersey (31 marzo 2023: 2,15%)				
275.000	GBP	Gatwick Funding Ltd., 4.63%, 27/03/2034	241	0,24
150.000	GBP	Gatwick Funding Ltd., 5.75%, 23/01/2037	141	0,14
100.000	GBP	Gatwick Funding Ltd., 3.13%, 28/09/2039	67	0,07
100.000	GBP	Gatwick Funding Ltd., 2.88%, 05/07/2049	56	0,06
100.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 7.13%, 14/02/2024	100	0,10
250.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 6.75%, 03/12/2026	256	0,26
100.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 7.08%, 04/08/2028	104	0,10
500.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 2.75%, 13/10/2029	419	0,42
450.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 6.45%, 10/12/2031	460	0,46
175.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 4.63%, 31/10/2046	136	0,14
300.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 2.75%, 09/08/2049	165	0,16
		Jersey - Totale	2.145	2,15
Lussemburgo (31 marzo 2023: 1,52%)				
325.000	GBP	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 2.00%, 20/10/2025	289	0,29
300.000	GBP	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 2.63%, 20/10/2028	233	0,23
350.000	GBP	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 2.00%, 17/10/2027	300	0,30
200.000	GBP	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 2.63%, 17/10/2034	134	0,13
175.000	GBP	CPI Property Group SA, REIT, 2.75%, 22/01/2028	124	0,13
200.000	GBP	Logicor Financing Sarl, REIT, 2.75%, 15/01/2030	151	0,15
250.000	GBP	Prologis International Funding II SA, REIT, 2.75%, 22/02/2032	199	0,20
175.000	GBP	Prologis International Funding II SA, REIT, 3.00%, 22/02/2042	115	0,12
		Lussemburgo - Totale	1.545	1,55
Messico (31 marzo 2023: 0,44%)				
300.000	GBP	America Movil SAB de CV, 4.95%, 22/07/2033	283	0,28
150.000	GBP	America Movil SAB de CV, 4.38%, 07/08/2041 ¹	123	0,13
		Messico - Totale	406	0,41
Paesi Bassi (31 marzo 2023: 8,20%)				
200.000	GBP	Allianz Finance II BV, 4.50%, 13/03/2043	180	0,18
500.000	GBP	Cooperatieve Rabobank UA, 1.25%, 14/01/2025	473	0,47
175.000	GBP	Cooperatieve Rabobank UA, 5.25%, 14/09/2027	169	0,17
100.000	GBP	Cooperatieve Rabobank UA, 4.63%, 23/05/2029	91	0,09
100.000	GBP	Cooperatieve Rabobank UA, 5.25%, 23/05/2041	99	0,10
200.000	GBP	Cooperatieve Rabobank UA, 5.38%, 03/08/2060	201	0,20

BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di GBP)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Paesi Bassi (continua)				
434.000	GBP	Deutsche Telekom International Finance BV, 2.25%, 13/04/2029 ¹	373	0,37
800.000	GBP	E.ON International Finance BV, 4.75%, 31/01/2034	721	0,72
600.000	GBP	E.ON International Finance BV, 6.13%, 06/07/2039	592	0,59
650.000	GBP	Enel Finance International NV, 5.63%, 14/08/2024	648	0,65
700.000	GBP	Enel Finance International NV, 5.75%, 14/09/2040	657	0,66
200.000	GBP	Holcim Sterling Finance Netherlands BV, 3.00%, 12/05/2032	159	0,16
200.000	GBP	ING Groep NV, 3.00%, 18/02/2026	187	0,19
700.000	GBP	ING Groep NV, FRN, 1.13%, 07/12/2028	577	0,58
300.000	GBP	ING Groep NV, FRN, 6.25%, 20/05/2033	286	0,28
350.000	GBP	JT International Financial Services BV, 2.75%, 28/09/2033	262	0,26
600.000	GBP	Koninklijke KPN NV, 5.75%, 17/09/2029	593	0,60
300.000	GBP	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.63%, 11/11/2024	287	0,29
100.000	GBP	Shell International Finance BV, 1.00%, 10/12/2030 ¹	75	0,08
150.000	GBP	Shell International Finance BV, 1.75%, 10/09/2052	66	0,07
500.000	GBP	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.75%, 10/09/2025	479	0,48
300.000	GBP	Volkswagen Financial Services NV, 1.13%, 05/07/2026	264	0,26
500.000	GBP	Volkswagen International Finance NV, 4.13%, 17/11/2031	429	0,43
Paesi Bassi - Totale			7.868	7,88
Norvegia (31 marzo 2023: 1,08%)				
575.000	GBP	DNB Bank ASA, FRN, 2.63%, 10/06/2026	544	0,55
127.000	GBP	Equinor ASA, 6.13%, 27/11/2028 ¹	131	0,13
250.000	GBP	Equinor ASA, 6.88%, 11/03/2031	273	0,27
Norvegia - Totale			948	0,95
Spagna (31 marzo 2023: 2,14%)				
300.000	GBP	Abertis Infraestructuras SA, 3.38%, 27/11/2026	277	0,28
200.000	GBP	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 3.10%, 15/07/2031	178	0,18
200.000	GBP	Banco Santander SA, 1.75%, 17/02/2027	173	0,17
800.000	GBP	Banco Santander SA, 5.13%, 25/01/2030	755	0,76
200.000	GBP	Banco Santander SA, FRN, 2.25%, 04/10/2032	165	0,16
500.000	GBP	CaixaBank SA, FRN, 1.50%, 03/12/2026	448	0,45
100.000	GBP	CaixaBank SA, FRN, 3.50%, 06/04/2028	90	0,09
Spagna - Totale			2.086	2,09
Svezia (31 marzo 2023: 1,02%)				
100.000	GBP	Akelius Residential Property AB, REIT, 2.38%, 15/08/2025	92	0,09
175.000	GBP	Investor AB, 5.50%, 05/05/2037	173	0,17
225.000	GBP	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 4.63%, 23/08/2032	207	0,21
225.000	GBP	Vattenfall AB, 6.88%, 15/04/2039	244	0,25
200.000	GBP	Vattenfall AB, FRN, 2.50%, 29/06/2083	160	0,16
250.000	GBP	Volvo Treasury AB, 4.75%, 15/06/2026	246	0,25
Svezia - Totale			1.122	1,13
Svizzera (31 marzo 2023: 1,10%)				
600.000	GBP	UBS Group AG, FRN, 2.13%, 12/09/2025	574	0,57
500.000	GBP	UBS Group AG, FRN, 7.00%, 30/09/2027	507	0,51
300.000	GBP	UBS Group AG, FRN, 7.38%, 07/09/2033	321	0,32
Svizzera - Totale			1.402	1,40
Regno Unito (31 marzo 2023: 45,12%)				
150.000	GBP	3i Group plc, 5.75%, 03/12/2032	148	0,15
225.000	GBP	3i Group plc, 3.75%, 05/06/2040	159	0,16

BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di GBP)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Regno Unito (continua)				
100.000	GBP	A2Dominion Housing Group Ltd., REIT, 3.50%, 15/11/2028 ¹	89	0,09
202.000	GBP	ABP Finance plc, 6.25%, 14/12/2026	203	0,20
150.000	GBP	Affinity Water Finance plc, 4.50%, 31/03/2036	129	0,13
275.000	GBP	Anglian Water Osprey Financing plc, 2.00%, 31/07/2028	210	0,21
400.000	GBP	Anglian Water Services Financing plc, 4.50%, 05/10/2027	381	0,38
121.000	GBP	Anglian Water Services Financing plc, 6.29%, 30/07/2030 ¹	123	0,12
100.000	GBP	Anglian Water Services Financing plc, 6.00%, 20/06/2039	97	0,10
132.000	GBP	Anglian Water Services Financing plc, FRN, 6.63%, 15/01/2029	136	0,14
175.000	GBP	Annington Funding plc, REIT, 2.65%, 12/07/2025	164	0,16
200.000	GBP	Annington Funding plc, REIT, 3.18%, 12/07/2029	167	0,17
175.000	GBP	Annington Funding plc, REIT, 2.31%, 06/10/2032	125	0,13
155.000	GBP	Annington Funding plc, REIT, 3.69%, 12/07/2034	119	0,12
350.000	GBP	Annington Funding plc, REIT, 3.94%, 12/07/2047	237	0,24
126.674	GBP	Arqiva Financing plc, 4.88%, 31/12/2032	118	0,12
275.000	GBP	Associated British Foods plc, 2.50%, 16/06/2034	211	0,21
200.000	GBP	Aviva plc, FRN, 6.13%, 14/11/2036	199	0,20
125.000	GBP	Aviva plc, FRN, 4.00%, 03/06/2055	94	0,09
300.000	GBP	Aviva plc, FRN, 6.88%, 20/05/2058	286	0,29
800.000	GBP	Barclays plc, 3.25%, 12/02/2027	723	0,72
300.000	GBP	Barclays plc, 3.25%, 17/01/2033	232	0,23
200.000	GBP	Barclays plc, FRN, 3.75%, 22/11/2030 ¹	184	0,18
425.000	GBP	Barclays plc, FRN, 6.37%, 31/01/2031	416	0,42
200.000	GBP	BAT International Finance plc, 6.00%, 24/11/2034	180	0,18
400.000	GBP	BAT International Finance plc, 2.25%, 09/09/2052	157	0,16
150.000	GBP	BAT International Finance plc, 4.00%, 23/11/2055	83	0,08
200.000	GBP	Bazalgette Finance plc, 2.38%, 29/11/2027	175	0,18
150.000	GBP	Bazalgette Finance plc, 2.75%, 10/03/2034 ¹	112	0,11
100.000	GBP	Berkeley Group plc (The), 2.50%, 11/08/2031	68	0,07
350.000	GBP	BG Energy Capital plc, 5.13%, 01/12/2025	348	0,35
300.000	GBP	BG Energy Capital plc, 5.00%, 04/11/2036	279	0,28
763.000	GBP	BP Capital Markets plc, FRN, 4.25%, 22/03/2027 ²	680	0,68
300.000	GBP	British Telecommunications plc, 5.75%, 07/12/2028	299	0,30
250.000	GBP	British Telecommunications plc, 3.13%, 21/11/2031	206	0,21
100.000	GBP	British Telecommunications plc, 3.63%, 21/11/2047	67	0,07
100.000	GBP	BUPA Finance plc, 5.00%, 08/12/2026	96	0,10
500.000	GBP	BUPA Finance plc, 1.75%, 14/06/2027 ¹	434	0,43
100.000	GBP	BUPA Finance plc, 4.13%, 14/06/2035	74	0,07
250.000	GBP	Cadent Finance plc, 2.13%, 22/09/2028 ¹	212	0,21
100.000	GBP	Cadent Finance plc, 5.75%, 14/03/2034	96	0,10
300.000	GBP	Cadent Finance plc, 2.25%, 10/10/2035	199	0,20
400.000	GBP	Cadent Finance plc, 2.75%, 22/09/2046	223	0,22
125.000	GBP	Cardiff University, 3.00%, 07/12/2055	79	0,08
270.000	GBP	Centrica plc, 4.38%, 13/03/2029	252	0,25
350.000	GBP	Centrica plc, 7.00%, 19/09/2033	377	0,38
125.000	GBP	Centrica plc, 4.25%, 12/09/2044	95	0,09
150.000	GBP	Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge (The), 3.75%, 17/10/2052 ¹	118	0,12
150.000	GBP	Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge (The), 2.35%, 27/06/2078	79	0,08
150.000	GBP	Channel Link Enterprises Finance plc, 3.85%, 30/06/2050	97	0,10
300.000	GBP	Compass Group plc, 2.00%, 05/09/2025 ¹	282	0,28
200.000	GBP	Compass Group plc, 4.38%, 08/09/2032	186	0,19
395.519	GBP	Connect Plus M25 Issuer plc, 2.61%, 31/03/2039	310	0,31
250.000	GBP	Diageo Finance plc, 1.75%, 12/10/2026	228	0,23
100.000	GBP	Diageo Finance plc, 2.38%, 08/06/2028	89	0,09
100.000	GBP	Diageo Finance plc, 2.75%, 08/06/2038 ¹	72	0,07
200.000	GBP	Direct Line Insurance Group plc, 4.00%, 05/06/2032	147	0,15
298.000	GBP	DWR Cymru Financing UK plc, 6.02%, 31/03/2028	301	0,30
250.000	GBP	DWR Cymru Financing UK plc, 2.38%, 31/03/2034 ¹	170	0,17

BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di GBP)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Regno Unito (continua)				
100.000	GBP	DWR Cymru Financing UK plc, 2.50%, 31/03/2036	71	0,07
91.000	GBP	Eastern Power Networks plc, 8.50%, 31/03/2025	94	0,09
300.000	GBP	Eastern Power Networks plc, 1.88%, 01/06/2035 ¹	202	0,20
100.000	GBP	Eastern Power Networks plc, 6.25%, 12/11/2036	103	0,10
100.000	GBP	Electricity North West Ltd., 8.88%, 25/03/2026	107	0,11
100.000	GBP	ENW Finance plc, 1.42%, 30/07/2030 ¹	76	0,08
150.000	GBP	ENW Finance plc, 4.89%, 24/11/2032	140	0,14
109.554	GBP	Exchequer Partnership No. 2 plc, 5.40%, 13/07/2036	108	0,11
500.000	GBP	Experian Finance plc, 0.74%, 29/10/2025	455	0,46
300.000	GBP	GlaxoSmithKline Capital plc, 5.25%, 19/12/2033	299	0,30
225.000	GBP	GlaxoSmithKline Capital plc, 5.25%, 10/04/2042	214	0,21
150.000	GBP	GlaxoSmithKline Capital plc, 4.25%, 18/12/2045 ¹	122	0,12
100.000	GBP	Grainger plc, REIT, 3.38%, 24/04/2028	87	0,09
200.000	GBP	Haleon UK Capital plc, 2.88%, 29/10/2028	178	0,18
100.000	GBP	Haleon UK Capital plc, 3.38%, 29/03/2038	76	0,08
300.000	GBP	Hammerson plc, REIT, 3.50%, 27/10/2025 ¹	279	0,28
100.000	GBP	Hammerson plc, REIT, 7.25%, 21/04/2028	95	0,10
100.000	GBP	HSBC Bank plc, 5.38%, 22/08/2033 ¹	92	0,09
61.000	GBP	HSBC Bank plc, 6.25%, 30/01/2041	58	0,06
150.000	GBP	HSBC Bank plc, 4.75%, 24/03/2046	114	0,11
272.000	GBP	HSBC Holdings plc, 5.75%, 20/12/2027	268	0,27
400.000	GBP	HSBC Holdings plc, 6.00%, 29/03/2040	354	0,35
350.000	GBP	HSBC Holdings plc, FRN, 2.26%, 13/11/2026	323	0,32
750.000	GBP	HSBC Holdings plc, FRN, 1.75%, 24/07/2027	663	0,66
250.000	GBP	HSBC Holdings plc, FRN, 3.00%, 29/05/2030	210	0,21
200.000	GBP	Hutchison Whampoa Finance UK plc, 5.63%, 24/11/2026	200	0,20
200.000	GBP	IG Group Holdings plc, 3.13%, 18/11/2028	162	0,16
200.000	GBP	Imperial Brands Finance plc, 4.88%, 07/06/2032	172	0,17
750.000	GBP	Informa plc, 3.13%, 05/07/2026	697	0,70
475.000	GBP	InterContinental Hotels Group plc, 3.75%, 14/08/2025	455	0,46
200.000	GBP	InterContinental Hotels Group plc, 3.38%, 08/10/2028	176	0,18
300.000	GBP	International Distributions Services plc, 7.38%, 14/09/2030	303	0,30
450.000	GBP	Investec plc, FRN, 2.63%, 04/01/2032	369	0,37
150.000	GBP	Just Group plc, FRN, 7.00%, 15/04/2031	146	0,15
200.000	GBP	Legal & General Group plc, FRN, 5.38%, 27/10/2045	194	0,19
200.000	GBP	Legal & General Group plc, FRN, 5.13%, 14/11/2048	185	0,19
200.000	GBP	Legal & General Group plc, FRN, 3.75%, 26/11/2049	166	0,17
200.000	GBP	Legal & General Group plc, FRN, 4.50%, 01/11/2050	170	0,17
225.000	GBP	Legal & General Group plc, FRN, 5.50%, 27/06/2064	198	0,20
150.000	GBP	Liberty Living Finance plc, REIT, 2.63%, 28/11/2024	143	0,14
250.000	GBP	Liberty Living Finance plc, REIT, 3.38%, 28/11/2029	211	0,21
552.000	GBP	Lloyds Bank plc, 6.50%, 17/09/2040	598	0,60
425.000	GBP	Lloyds Banking Group plc, 2.25%, 16/10/2024	409	0,41
500.000	GBP	Lloyds Banking Group plc, FRN, 1.99%, 15/12/2031	429	0,43
300.000	GBP	Lloyds Banking Group plc, FRN, 2.71%, 03/12/2035	223	0,22
136.000	GBP	London Merchant Securities Ltd., REIT, 6.50%, 16/03/2026	136	0,14
250.000	GBP	M&G plc, FRN, 5.63%, 20/10/2051	223	0,22
225.000	GBP	M&G plc, FRN, 5.56%, 20/07/2055	192	0,19
150.000	GBP	M&G plc, FRN, 6.34%, 19/12/2063	128	0,13
200.000	GBP	M&G plc, FRN, 6.25%, 20/10/2068 ¹	166	0,17
200.000	GBP	Manchester Airport Group Funding plc, 4.13%, 02/04/2024	198	0,20
300.000	GBP	Manchester Airport Group Funding plc, 4.75%, 31/03/2034	272	0,27
125.000	GBP	Manchester Airport Group Funding plc, 2.88%, 30/09/2044	76	0,08
150.000	GBP	Motability Operations Group plc, 3.75%, 16/07/2026	144	0,14
250.000	GBP	Motability Operations Group plc, 4.38%, 08/02/2027	242	0,24
200.000	GBP	Motability Operations Group plc, 1.75%, 03/07/2029	165	0,17
250.000	GBP	Motability Operations Group plc, 2.38%, 14/03/2032	199	0,20
350.000	GBP	Motability Operations Group plc, 3.63%, 10/03/2036	287	0,29
175.000	GBP	Motability Operations Group plc, 2.38%, 03/07/2039	116	0,12

BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di GBP)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Regno Unito (continua)				
125.000	GBP	Motability Operations Group plc, 2.13%, 18/01/2042	75	0,08
150.000	GBP	Motability Operations Group plc, 4.88%, 17/01/2043	135	0,14
225.000	GBP	National Gas Transmission plc, 1.38%, 07/02/2031	163	0,16
150.000	GBP	National Gas Transmission plc, 1.63%, 14/01/2043	72	0,07
100.000	GBP	National Grid Electricity Distribution South West plc, 5.75%, 23/03/2040	96	0,10
100.000	GBP	National Grid Electricity Distribution South West plc, 5.82%, 31/07/2041	96	0,10
425.000	GBP	National Grid Electricity Distribution West Midlands plc, 3.88%, 17/10/2024	416	0,42
500.000	GBP	National Grid Electricity Distribution West Midlands plc, 5.75%, 16/04/2032	493	0,49
179.000	GBP	National Grid Electricity Transmission plc, 2.75%, 06/02/2035	131	0,13
175.000	GBP	National Grid Electricity Transmission plc, 5.27%, 18/01/2043	157	0,16
100.000	GBP	Nationwide Building Society, 3.00%, 06/05/2026	94	0,09
250.000	GBP	Nationwide Building Society, 3.25%, 20/01/2028	227	0,23
600.000	GBP	Nats En Route plc, 1.38%, 31/03/2031	504	0,50
200.000	GBP	NatWest Group plc, FRN, 2.88%, 19/09/2026	187	0,19
300.000	GBP	NatWest Group plc, FRN, 3.13%, 28/03/2027	277	0,28
100.000	GBP	NatWest Group plc, FRN, 3.62%, 29/03/2029	89	0,09
375.000	GBP	NatWest Group plc, FRN, 3.62%, 14/08/2030	352	0,35
650.000	GBP	NatWest Group plc, FRN, 2.11%, 28/11/2031	554	0,56
250.000	GBP	NIE Finance plc, 2.50%, 27/10/2025	234	0,23
150.000	GBP	NIE Finance plc, 6.38%, 02/06/2026	152	0,15
150.000	GBP	NIE Finance plc, 5.88%, 01/12/2032	150	0,15
150.000	GBP	Northern Electric Finance plc, 5.13%, 04/05/2035	140	0,14
100.000	GBP	Northern Gas Networks Finance plc, 4.88%, 15/11/2035	88	0,09
100.000	GBP	Northern Gas Networks Finance plc, 5.63%, 23/03/2040	91	0,09
350.000	GBP	Northern Powergrid Yorkshire plc, 2.25%, 09/10/2059	167	0,17
100.000	GBP	Northumbrian Water Finance plc, 6.38%, 28/10/2034	99	0,10
300.000	GBP	Northumbrian Water Finance plc, 5.13%, 23/01/2042 ¹	257	0,26
100.000	GBP	OSB Group plc, FRN, 9.50%, 07/09/2028	101	0,10
100.000	GBP	Pension Insurance Corp. plc, 6.50%, 03/07/2024	100	0,10
150.000	GBP	Pension Insurance Corp. plc, 8.00%, 23/11/2026	154	0,15
100.000	GBP	Pension Insurance Corp. plc, 5.63%, 20/09/2030	89	0,09
100.000	GBP	Pension Insurance Corp. plc, 4.63%, 07/05/2031	83	0,08
100.000	GBP	Pension Insurance Corp. plc, 3.63%, 21/10/2032	74	0,07
175.000	GBP	Phoenix Group Holdings plc, 6.63%, 18/12/2025	175	0,17
100.000	GBP	Phoenix Group Holdings plc, 5.87%, 13/06/2029	93	0,09
100.000	GBP	Phoenix Group Holdings plc, 5.63%, 28/04/2031	88	0,09
150.000	GBP	Places For People Treasury plc, REIT, 2.88%, 17/08/2026	138	0,14
175.000	GBP	Principality Building Society, 8.63%, 12/07/2028	182	0,18
150.000	GBP	Quadgas Finance plc, 3.38%, 17/09/2029	123	0,12
200.000	GBP	Reckitt Benckiser Treasury Services plc, 1.75%, 19/05/2032	152	0,15
100.000	GBP	Reckitt Benckiser Treasury Services plc, 5.63%, 14/12/2038 ¹	101	0,10
200.000	GBP	Rentokil Initial plc, 5.00%, 27/06/2032	187	0,19
175.000	GBP	RI Finance Bonds No. 3 plc, 6.13%, 13/11/2028	168	0,17
150.000	GBP	RL Finance Bonds No. 4 plc, FRN, 4.88%, 07/10/2049	110	0,11
132.072	GBP	RMPA Services plc, 5.34%, 30/09/2038	129	0,13
375.000	GBP	Rothesay Life plc, 3.38%, 12/07/2026	343	0,34
125.000	GBP	Rothesay Life plc, FRN, 5.50%, 17/09/2029	123	0,12
200.000	GBP	Sage Group plc (The), 1.63%, 25/02/2031 ¹	151	0,15
425.000	GBP	Santander UK Group Holdings plc, 3.63%, 14/01/2026 ¹	399	0,40
250.000	GBP	Santander UK Group Holdings plc, FRN, 2.92%, 08/05/2026	235	0,24
175.000	GBP	Santander UK Group Holdings plc, FRN, 7.10%, 16/11/2027	177	0,18
250.000	GBP	Santander UK Group Holdings plc, FRN, 2.42%, 17/01/2029	211	0,21
100.000	GBP	Santander UK plc, 3.88%, 15/10/2029	91	0,09
125.000	GBP	Scotland Gas Networks plc, 3.25%, 08/03/2027	115	0,12
275.000	GBP	Scottish Widows Ltd., 7.00%, 16/06/2043	263	0,26
200.000	GBP	Segro plc, REIT, 2.38%, 11/10/2029	166	0,17
300.000	GBP	Severn Trent Utilities Finance plc, 4.88%, 24/01/2042	256	0,26
150.000	GBP	Sky Ltd., 6.00%, 21/05/2027	153	0,15
100.000	GBP	Sky Ltd., 4.00%, 26/11/2029	93	0,09

BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di GBP)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Regno Unito (continua)				
100.000	GBP	Society of Lloyd's, 4.75%, 30/10/2024	98	0,10
100.000	GBP	Society of Lloyd's, FRN, 4.88%, 07/02/2047	93	0,09
350.000	GBP	South Eastern Power Networks plc, 6.38%, 12/11/2031	364	0,36
200.000	GBP	Southern Gas Networks plc, 4.88%, 21/03/2029	192	0,19
400.000	GBP	Southern Gas Networks plc, 3.10%, 15/09/2036	285	0,29
400.000	GBP	SSE plc, 6.25%, 27/08/2038	399	0,40
100.000	GBP	Standard Chartered plc, 5.13%, 06/06/2034	88	0,09
250.000	GBP	Standard Chartered plc, 4.38%, 18/01/2038	218	0,22
450.000	GBP	Tesco Corporate Treasury Services plc, 1.88%, 02/11/2028	373	0,37
250.000	GBP	Tesco Corporate Treasury Services plc, 2.75%, 27/04/2030	206	0,21
150.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 4.00%, 19/06/2025	140	0,14
150.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 3.50%, 25/02/2028	130	0,13
100.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 2.63%, 24/01/2032	74	0,07
100.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 6.50%, 09/02/2032	93	0,09
150.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 4.38%, 03/07/2034	120	0,12
189.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 5.13%, 28/09/2037 ¹	155	0,16
400.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 2.38%, 22/04/2040	216	0,22
200.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 4.63%, 04/06/2046	142	0,14
100.000	GBP	TP ICAP Finance plc, 2.63%, 18/11/2028	77	0,08
125.000	GBP	TP ICAP Finance plc, 7.88%, 17/04/2030	122	0,12
250.000	GBP	UNITE Group plc (The), REIT, 3.50%, 15/10/2028 ¹	221	0,22
200.000	GBP	United Utilities Water Finance plc, 0.88%, 28/10/2029	151	0,15
225.000	GBP	United Utilities Water Finance plc, 2.00%, 03/07/2033	162	0,16
83.000	GBP	United Utilities Water Ltd., 5.63%, 20/12/2027 ¹	82	0,08
100.000	GBP	United Utilities Water Ltd., 5.00%, 28/02/2035 ¹	91	0,09
150.000	GBP	University of Liverpool, 3.38%, 25/06/2055	104	0,10
350.000	GBP	University of Oxford, 2.54%, 08/12/2117 ¹	167	0,17
170.000	GBP	University of Southampton, 2.25%, 11/04/2057 ¹	87	0,09
123.620	GBP	UPP Bond 1 Issuer plc, REIT, 4.90%, 28/02/2040	112	0,11
200.000	GBP	Utmost Group plc, 4.00%, 15/12/2031	146	0,15
250.000	GBP	Virgin Money UK plc, FRN, 3.13%, 22/06/2025	242	0,24
500.000	GBP	Virgin Money UK plc, FRN, 4.00%, 25/09/2026	468	0,47
100.000	GBP	Virgin Money UK plc, FRN, 7.63%, 23/08/2029	102	0,10
400.000	GBP	Vodafone Group plc, 3.38%, 08/08/2049	247	0,25
225.000	GBP	Vodafone Group plc, 5.13%, 02/12/2052 ¹	184	0,18
100.000	GBP	Vodafone Group plc, 3.00%, 12/08/2056	54	0,05
225.000	GBP	Wales & West Utilities Finance plc, 5.75%, 29/03/2030 ¹	223	0,22
150.000	GBP	Wales & West Utilities Finance plc, 1.88%, 28/05/2041	84	0,08
100.000	GBP	Weir Group plc (The), 6.88%, 14/06/2028	101	0,10
200.000	GBP	Wellcome Trust Ltd. (The), 4.00%, 09/05/2059	161	0,16
500.000	GBP	Wellcome Trust Ltd. (The), 1.50%, 14/07/2071	179	0,18
200.000	GBP	Wellcome Trust Ltd. (The), 2.52%, 07/02/2118	96	0,10
182.000	GBP	Wessex Water Services Finance plc, 5.38%, 10/03/2028	176	0,18
350.000	GBP	Wessex Water Services Finance plc, 1.50%, 17/09/2029	269	0,27
100.000	GBP	Wessex Water Services Finance plc, 5.75%, 14/10/2033	95	0,10
340.000	GBP	Whitbread Group plc, 3.38%, 16/10/2025	321	0,32
250.000	GBP	Whitbread Group plc, 3.00%, 31/05/2031	196	0,20
375.000	GBP	Yorkshire Building Society, 3.50%, 21/04/2026	353	0,35
100.000	GBP	Yorkshire Building Society, FRN, 3.38%, 13/09/2028	86	0,09
275.000	GBP	Yorkshire Building Society, FRN, 6.38%, 15/11/2028	269	0,27
200.000	GBP	Yorkshire Water Finance plc, 1.75%, 26/11/2026	175	0,18
150.000	GBP	Yorkshire Water Finance plc, 6.38%, 19/08/2039	147	0,15
175.000	GBP	Yorkshire Water Finance plc, 2.75%, 18/04/2041	107	0,11
200.000	GBP	Yorkshire Water Services Finance Ltd., FRN, 5.50%, 28/05/2037	184	0,18
Regno Unito - Totale			44.704	44,79
Stati Uniti (31 marzo 2023: 17,76%)				
500.000	GBP	American Honda Finance Corp., 1.50%, 19/10/2027	432	0,43

BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di GBP)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Stati Uniti (continua)				
200.000	GBP	American Honda Finance Corp., 5.60%, 06/09/2030	200	0,20
400.000	GBP	AT&T, Inc., 2.90%, 04/12/2026 ¹	366	0,37
150.000	GBP	AT&T, Inc., 5.50%, 15/03/2027	148	0,15
350.000	GBP	AT&T, Inc., 4.25%, 01/06/2043 ¹	263	0,26
600.000	GBP	AT&T, Inc., 4.88%, 01/06/2044 ¹	485	0,49
350.000	GBP	Athene Global Funding, 1.75%, 24/11/2027	289	0,29
800.000	GBP	Bank of America Corp., 7.00%, 31/07/2028	844	0,85
625.000	GBP	Berkshire Hathaway Finance Corp., 2.38%, 19/06/2039 ¹	420	0,42
200.000	GBP	Brown-Forman Corp., 2.60%, 07/07/2028	179	0,18
100.000	GBP	Cargill, Inc., 5.38%, 02/03/2037	96	0,10
525.000	GBP	Citigroup, Inc., 1.75%, 23/10/2026	470	0,47
200.000	GBP	Citigroup, Inc., 4.50%, 03/03/2031	178	0,18
150.000	GBP	Citigroup, Inc., 6.80%, 25/06/2038	164	0,16
200.000	GBP	Comcast Corp., 1.50%, 20/02/2029 ¹	166	0,17
100.000	GBP	Comcast Corp., 5.50%, 23/11/2029	101	0,10
200.000	GBP	Comcast Corp., 1.88%, 20/02/2036	134	0,13
100.000	GBP	Digital Stout Holding LLC, REIT, 3.30%, 19/07/2029	85	0,08
150.000	GBP	Digital Stout Holding LLC, REIT, 3.75%, 17/10/2030	126	0,13
100.000	GBP	General Electric Co., 5.25%, 07/12/2028 ¹	96	0,10
200.000	GBP	General Electric Co., 4.88%, 18/09/2037	171	0,17
650.000	GBP	General Motors Financial Co., Inc., 2.25%, 06/09/2024	627	0,63
100.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 7.13%, 07/08/2025	102	0,10
300.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 4.25%, 29/01/2026	290	0,29
350.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.50%, 07/12/2027	296	0,30
300.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.88%, 16/12/2030 ¹	230	0,23
225.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 6.88%, 18/01/2038	222	0,22
300.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN, 1.00%, 16/12/2025	282	0,28
175.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN, 3.63%, 29/10/2029	156	0,16
150.000	GBP	International Business Machines Corp., 4.88%, 06/02/2038	133	0,13
150.000	GBP	Johnson & Johnson, 5.50%, 06/11/2024	150	0,15
825.000	GBP	JPMorgan Chase & Co., FRN, 0.99%, 28/04/2026	766	0,77
100.000	GBP	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.90%, 28/04/2033	74	0,07
700.000	GBP	Kraft Heinz Foods Co., 4.13%, 01/07/2027	666	0,67
150.000	GBP	McDonald's Corp., 5.88%, 23/04/2032	153	0,15
200.000	GBP	McDonald's Corp., 2.95%, 15/03/2034	158	0,16
200.000	GBP	McDonald's Corp., 4.13%, 11/06/2054	149	0,15
550.000	GBP	McKesson Corp., 3.13%, 17/02/2029	486	0,49
150.000	GBP	Metropolitan Life Global Funding I, 3.50%, 30/09/2026	142	0,14
1.000.000	GBP	Metropolitan Life Global Funding I, 1.63%, 12/10/2028	831	0,83
500.000	GBP	Morgan Stanley, FRN, 5.79%, 18/11/2033 ¹	485	0,49
400.000	GBP	New York Life Global Funding, 1.50%, 15/07/2027	348	0,35
275.000	GBP	Pacific Life Global Funding II, 5.00%, 12/01/2028	268	0,27
150.000	GBP	PepsiCo, Inc., 3.20%, 22/07/2029	136	0,14
200.000	GBP	PepsiCo, Inc., 3.55%, 22/07/2034	171	0,17
300.000	GBP	Pfizer, Inc., 2.74%, 15/06/2043	200	0,20
150.000	GBP	Procter & Gamble Co. (The), 1.38%, 03/05/2025 ¹	142	0,14
100.000	GBP	Prologis LP, REIT, 2.25%, 30/06/2029	83	0,08
250.000	GBP	Protective Life Global Funding, 5.25%, 13/01/2028	245	0,25
100.000	GBP	Realty Income Corp., REIT, 1.88%, 14/01/2027	88	0,09
500.000	GBP	Realty Income Corp., REIT, 1.13%, 13/07/2027 ¹	418	0,42
100.000	GBP	Realty Income Corp., REIT, 1.75%, 13/07/2033	68	0,07
250.000	GBP	Time Warner Cable LLC, 5.75%, 02/06/2031	234	0,23
200.000	GBP	Time Warner Cable LLC, 5.25%, 15/07/2042	159	0,16
700.000	GBP	Verizon Communications, Inc., 3.38%, 27/10/2036 ¹	531	0,53
569.000	GBP	Walmart, Inc., 5.75%, 19/12/2030	593	0,59
375.000	GBP	Walmart, Inc., 5.63%, 27/03/2034	387	0,39
250.000	GBP	Walmart, Inc., 5.25%, 28/09/2035	249	0,25
300.000	GBP	Wells Fargo & Co., 2.00%, 28/07/2025	279	0,28
275.000	GBP	Wells Fargo & Co., 2.50%, 02/05/2029	228	0,23

BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di GBP)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Stati Uniti (continua)				
300.000	GBP	Wells Fargo & Co., 3.50%, 12/09/2029	261	0,26
450.000	GBP	Wells Fargo & Co., 4.63%, 02/11/2035	399	0,40
200.000	GBP	Wells Fargo & Co., 4.88%, 29/11/2035	169	0,17
100.000	GBP	Welltower OP LLC, REIT, 4.80%, 20/11/2028 ¹	94	0,09
300.000	GBP	Welltower OP LLC, REIT, 4.50%, 01/12/2034 ¹	249	0,25
Stati Uniti - Totale			17.810	17,85
Totale investimenti in titoli di debito societario			97.362	97,55
Totale investimenti in obbligazioni			98.000	98,19
			Valore equo (migliaia di GBP)	% del Valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico			98.000	98,19
Liquidità			5	0,01
Strumenti liquidi equivalenti				
Partecipazione	Valuta	Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2023: 0,58%)		
6.038	GBP	BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Dis) Azioni ³	604	0,60
Totale in strumenti liquidi equivalenti			604	0,60
Altre attività e passività			1.200	1,20
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili			99.809	100,00
				% del totale attività
Analisi del totale attività				
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale				97,40
Organismi di investimento collettivo				0,60
Altre attività				2,00
Totale attività				100,00

¹ Titolo parzialmente o completamente in prestito.

² Il titolo è perpetuo, senza una data di scadenza predeterminata. La data indicata, se applicabile, è la data di richiamo successiva.

³ Una parte correlata al Fondo.

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI				
Titoli del debito societario (31 marzo 2023: 96,41%)				
Australia (31 marzo 2023: 2,12%)				
300.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 2.00%, 22/03/2027	276	0,37
400.000	EUR	Brambles Finance Ltd., 2.38%, 12/06/2024	395	0,52
500.000	EUR	Goodman Australia Finance Pty. Ltd., REIT, 1.38%, 27/09/2025	469	0,62
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 1.88%, 16/09/2024	98	0,13
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 2.00%, 28/08/2025	96	0,13
300.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 1.75%, 29/03/2028	272	0,36
Australia - Totale			1.606	2,13
Austria (31 marzo 2023: 1,22%)				
200.000	EUR	ams-OSRAM AG, 6.00%, 31/07/2025 ¹	198	0,26
200.000	EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 4.13%, 18/01/2027	196	0,26
175.000	EUR	Sappi Papier Holding GmbH, 3.63%, 15/03/2028	154	0,21
200.000	EUR	Volksbank Wien AG, 4.75%, 15/03/2027	199	0,26
Austria - Totale			747	0,99
Belgio (31 marzo 2023: 0,73%)				
300.000	EUR	Argenta Spaarbank NV, FRN, 5.38%, 29/11/2027	303	0,40
125.000	EUR	Azelis Finance NV, 5.75%, 15/03/2028	125	0,17
300.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.13%, 14/01/2029	251	0,33
Belgio - Totale			679	0,90
Isole Vergini britanniche (31 marzo 2023: 0,58%)				
500.000	EUR	Global Switch Holdings Ltd., 1.50%, 31/01/2024	494	0,65
Isole Vergini britanniche - Totale			494	0,65
Danimarca (31 marzo 2023: 0,95%)				
250.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 3.50%, 26/11/2026	246	0,33
275.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 4.00%, 12/01/2027	272	0,36
200.000	EUR	H Lundbeck A/S, 0.88%, 14/10/2027	174	0,23
500.000	EUR	Jyske Bank A/S, FRN, 0.25%, 17/02/2028 ¹	432	0,57
100.000	EUR	Vestas Wind Systems A/S, 4.13%, 15/06/2026	100	0,13
Danimarca - Totale			1.224	1,62
Finlandia (31 marzo 2023: 1,19%)				
450.000	EUR	Nordea Bank Abp, 4.13%, 05/05/2028	447	0,59
350.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.38%, 26/02/2024	345	0,46
200.000	EUR	SBB Treasury OYJ, REIT, FRN, 4.29%, 08/02/2024	192	0,25
Finlandia - Totale			984	1,30
Francia (31 marzo 2023: 11,70%)				
100.000	EUR	Accor SA, FRN, 2.63%, 30/01/2025 ²	95	0,12
300.000	EUR	Altice France SA, 2.50%, 15/01/2025 ¹	285	0,38
200.000	EUR	Altice France SA, 5.88%, 01/02/2027	173	0,23
300.000	EUR	Arval Service Lease SA, 0.00%, 01/10/2025	275	0,36
100.000	EUR	Arval Service Lease SA, 4.75%, 22/05/2027	101	0,13
150.000	EUR	Banijay Entertainment SASU, 7.00%, 01/05/2029	149	0,20
500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.13%, 13/03/2029	496	0,66
125.000	EUR	Banque Stellantis France SACA, 0.63%, 21/06/2024	122	0,16
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 15/07/2025	194	0,26
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.13%, 23/01/2027	189	0,25
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 30/05/2028	174	0,23

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Francia (continua)				
200.000	EUR	BPCE SA, 0.38%, 05/10/2023	200	0,27
400.000	EUR	BPCE SA, FRN, 1.63%, 02/03/2029	352	0,47
200.000	EUR	Capgemini SE, 1.00%, 18/10/2024	194	0,26
400.000	EUR	Cerba Healthcare SACA, 3.50%, 31/05/2028	333	0,44
400.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 1.00%, 22/04/2026	379	0,50
200.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 0.63%, 12/01/2028 ¹	176	0,23
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.88%, 05/10/2023	100	0,13
300.000	EUR	Edenred, 3.63%, 13/12/2026	297	0,39
100.000	EUR	Elis SA, 4.13%, 24/05/2027	98	0,13
200.000	EUR	ELO SACA, 2.38%, 25/04/2025	193	0,26
200.000	EUR	Engie SA, FRN, 1.63%, 08/04/2025 ²	187	0,25
200.000	EUR	Forvia SE, 2.38%, 15/06/2027	176	0,23
500.000	EUR	Getlink SE, 3.50%, 30/10/2025	488	0,65
		Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement, 0.13%, 16/09/2025	206	0,27
225.000	EUR	HSBC Continental Europe SA, 0.25%, 17/05/2024 ¹	98	0,13
100.000	EUR	JCDecaux SE, 5.00%, 11/01/2029	200	0,27
200.000	EUR	Loxam SAS, 4.50%, 15/02/2027	190	0,25
125.000	EUR	Mobilux Finance SAS, 4.25%, 15/07/2028	108	0,14
300.000	EUR	Orange SA, FRN, 2.38%, 15/01/2025 ²	286	0,38
150.000	EUR	Paprec Holding SA, 3.50%, 01/07/2028	135	0,18
100.000	EUR	Picard Groupe SAS, 3.88%, 01/07/2026	93	0,12
100.000	EUR	Praemia Healthcare SACA, REIT, 5.50%, 19/09/2028	100	0,13
200.000	EUR	RCI Banque SA, 1.63%, 11/04/2025	192	0,26
300.000	EUR	RCI Banque SA, 4.13%, 01/12/2025	298	0,40
275.000	EUR	Rexel SA, 2.13%, 15/06/2028	242	0,32
200.000	EUR	Schneider Electric SE, 3.38%, 06/04/2025	198	0,26
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 1.00%, 24/11/2030	181	0,24
300.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 1.75%, 04/04/2024 ²	294	0,39
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.63%, 04/05/2027 ¹	174	0,23
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, FRN, 7.25%, 03/07/2028 ²	90	0,12
200.000	EUR	Vallourec SA, 8.50%, 30/06/2026	200	0,27
200.000	EUR	Verallia SA, 1.63%, 14/05/2028 ¹	176	0,23
500.000	EUR	Vivendi SE, 0.63%, 11/06/2025 ¹	471	0,62
		Francia - Totale	9.358	12,40
Germania (31 marzo 2023: 8,21%)				
400.000	EUR	Aareal Bank AG, 4.50%, 25/07/2025 ¹	396	0,52
175.000	EUR	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4.38%, 15/01/2028	160	0,21
175.000	EUR	Covestro AG, 0.88%, 03/02/2026 ¹	164	0,22
150.000	EUR	Ctec II GmbH, 5.25%, 15/02/2030	125	0,17
500.000	EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.00%, 17/12/2027 ¹	452	0,60
400.000	EUR	Deutsche Lufthansa AG, 2.00%, 14/07/2024 ¹	391	0,52
200.000	EUR	Deutsche Lufthansa AG, 2.88%, 16/05/2027	182	0,24
200.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.25%, 17/01/2025	188	0,25
125.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 5.00%, 05/02/2027 ¹	128	0,17
75.000	EUR	E.ON SE, 1.00%, 07/10/2025	71	0,09
225.000	EUR	E.ON SE, 3.75%, 01/03/2029	222	0,29
200.000	EUR	Evonik Industries AG, 2.25%, 25/09/2027	186	0,25
175.000	EUR	Gruenthal GmbH, 3.63%, 15/11/2026	167	0,22
300.000	EUR	Gruenthal GmbH, 6.75%, 15/05/2030	305	0,40
200.000	EUR	Hella GmbH & Co. KGaA, 0.50%, 26/01/2027	177	0,23
300.000	EUR	Hornbach Baumarkt AG, 3.25%, 25/10/2026 ¹	287	0,38
400.000	EUR	Infineon Technologies AG, FRN, 3.63%, 01/01/2028 ²	369	0,49
500.000	EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.38%, 28/02/2028 ¹	422	0,56
400.000	EUR	Merck KGaA, FRN, 1.63%, 25/06/2079	384	0,51
100.000	EUR	Merck KGaA, FRN, 1.63%, 09/09/2080	90	0,12
525.000	EUR	Nidda Healthcare Holding GmbH, 7.50%, 21/08/2026	530	0,70

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Germania (continua)				
100.000	EUR	Novelis Sheet Ingot GmbH, 3.38%, 15/04/2029	87	0,12
300.000	EUR	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH, 1.75%, 05/07/2025 ¹	286	0,38
300.000	EUR	thyssenkrupp AG, 2.88%, 22/02/2024	298	0,40
175.000	EUR	TK Elevator Midco GmbH, 4.38%, 15/07/2027	159	0,21
175.000	EUR	TUI Cruises GmbH, 6.50%, 15/05/2026	166	0,22
100.000	EUR	ZF Finance GmbH, 3.00%, 21/09/2025	96	0,13
400.000	EUR	ZF Finance GmbH, 2.75%, 25/05/2027 ¹	358	0,48
Germania - Totale			6.846	9,08
Grecia (31 marzo 2023: 0,94%)				
225.000	EUR	Mytilineos SA, 2.25%, 30/10/2026 ¹	213	0,28
225.000	EUR	National Bank of Greece SA, FRN, 7.25%, 22/11/2027	236	0,31
175.000	EUR	National Bank of Greece SA, FRN, 8.00%, 03/01/2034	177	0,23
350.000	EUR	Piraeus Bank SA, FRN, 8.25%, 28/01/2027	365	0,49
Grecia - Totale			991	1,31
Ungheria (31 marzo 2023: 0,36%)				
			-	-
Islanda (31 marzo 2023: 0,89%)				
575.000	EUR	Arion Banki HF, 0.38%, 14/07/2025	531	0,70
300.000	EUR	Islandsbanki HF, 7.38%, 17/05/2026	310	0,41
Islanda - Totale			841	1,11
Irlanda (31 marzo 2023: 2,57%)				
200.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 1.00%, 25/11/2025	192	0,26
175.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 1.88%, 05/06/2026	167	0,22
125.000	EUR	CA Auto Bank SPA, 0.00%, 16/04/2024	123	0,16
275.000	EUR	CRH SMW Finance DAC, 4.00%, 11/07/2027	274	0,36
225.000	EUR	Dell Bank International DAC, 0.50%, 27/10/2026	201	0,27
300.000	EUR	Hammerson Ireland Finance DAC, REIT, 1.75%, 03/06/2027	256	0,34
600.000	EUR	James Hardie International Finance DAC, 3.63%, 01/10/2026 ¹	578	0,77
400.000	EUR	Linde plc, 0.00%, 30/09/2026	358	0,47
Irlanda - Totale			2.149	2,85
Isola di Man (31 marzo 2023: 0,16%)				
100.000	EUR	Playtech plc, 4.25%, 07/03/2026	97	0,13
Isola di Man - Totale			97	0,13
Italia (31 marzo 2023: 8,21%)				
175.000	EUR	ACEA SpA, 1.50%, 08/06/2027	160	0,21
100.000	EUR	AMCO - Asset Management Co. SpA, 4.63%, 06/02/2027	99	0,13
125.000	EUR	ASTM SpA, 1.00%, 25/11/2026	112	0,15
100.000	EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 5.88%, 09/06/2024	101	0,13
400.000	EUR	Azzurra Aeroporti SpA, 2.13%, 30/05/2024 ¹	392	0,52
300.000	EUR	Banca Popolare di Sondrio SPA, FRN, 5.50%, 26/09/2028	298	0,40
100.000	EUR	Banco BPM SpA, 2.50%, 21/06/2024	99	0,13
100.000	EUR	Banco BPM SpA, 1.75%, 28/01/2025	96	0,13
250.000	EUR	Banco BPM SpA, FRN, 6.00%, 21/01/2028	252	0,33
275.000	EUR	Banco BPM SpA, FRN, 6.00%, 14/06/2028	275	0,36
175.000	EUR	BPER Banca, 1.88%, 07/07/2025	167	0,22
225.000	EUR	BPER Banca, FRN, 1.38%, 31/03/2027 ¹	209	0,28
150.000	EUR	doValue SpA, 3.38%, 31/07/2026	130	0,17
225.000	EUR	Enel SpA, FRN, 3.50%, 24/02/2025 ²	218	0,29

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Italia (continua)				
200.000	EUR	Enel SpA, FRN, 2.25%, 10/12/2026 ²	176	0,23
300.000	EUR	Eni SpA, 1.63%, 17/05/2028	272	0,36
400.000	EUR	Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1.88%, 08/07/2026 ¹	374	0,50
200.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.50%, 10/04/2024	197	0,26
325.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.00%, 04/07/2024	317	0,42
275.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, FRN, 4.50%, 17/03/2025	275	0,37
225.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, FRN, 5.00%, 08/03/2028	225	0,30
400.000	EUR	Lottomatica SpA, FRN, 7.92%, 01/06/2028	405	0,54
400.000	EUR	Mundys SpA, 1.63%, 03/02/2025	384	0,51
100.000	EUR	Snam SpA, 1.25%, 28/08/2025	95	0,13
400.000	EUR	Telecom Italia SpA, 6.88%, 15/02/2028 ¹	403	0,54
200.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, FRN, 2.38%, 09/11/2027 ²	173	0,23
400.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 4.45%, 16/02/2029	386	0,51
200.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 2.73%, 15/01/2032	176	0,23
100.000	EUR	Unipol Gruppo SpA, 3.00%, 18/03/2025	98	0,13
100.000	EUR	Webuild SpA, 3.88%, 28/07/2026	93	0,12
Italia - Totale			6.657	8,83
Giappone (31 marzo 2023: 2,02%)				
300.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 1.02%, 11/10/2023	300	0,40
200.000	EUR	Nidec Corp., 0.05%, 30/03/2026	182	0,24
300.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.08%, 13/12/2025	276	0,36
300.000	EUR	ORIX Corp., 1.92%, 20/04/2026 ¹	284	0,38
300.000	EUR	ORIX Corp., 4.48%, 01/06/2028	302	0,40
200.000	EUR	SoftBank Group Corp., 2.13%, 06/07/2024	195	0,26
200.000	EUR	SoftBank Group Corp., 2.88%, 06/01/2027	176	0,23
100.000	EUR	SoftBank Group Corp., 5.00%, 15/04/2028	92	0,12
Giappone - Totale			1.807	2,39
Jersey (31 marzo 2023: 0,27%)				
18.981	EUR	Adient Global Holdings Ltd., 3.50%, 15/08/2024	19	0,03
225.000	EUR	Kane Bidco Ltd., 5.00%, 15/02/2027	213	0,28
Jersey - Totale			232	0,31
Lussemburgo (31 marzo 2023: 5,06%)				
175.000	EUR	Altice Financing SA, 2.25%, 15/01/2025	173	0,23
100.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, FRN, 3.38%, 23/09/2024 ²	45	0,06
100.000	EUR	BK LC Lux Finco1 Sarl, 5.25%, 30/04/2029 ¹	98	0,13
250.000	EUR	Cirsa Finance International Sarl, 7.88%, 31/07/2028	252	0,33
125.000	EUR	Cullinan Holdco Scsp, 4.63%, 15/10/2026	92	0,12
325.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.20%, 18/03/2026	297	0,39
275.000	EUR	Herens Midco Sarl, 5.25%, 15/05/2029	158	0,21
250.000	EUR	Highland Holdings Sarl, 0.00%, 12/11/2023	249	0,33
250.000	EUR	Highland Holdings Sarl, 0.32%, 15/12/2026	223	0,30
100.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 2.38%, 09/04/2025	97	0,13
200.000	EUR	InPost SA, 2.25%, 15/07/2027	172	0,23
150.000	EUR	Logicor Financing Sarl, REIT, 0.63%, 17/11/2025	136	0,18
200.000	EUR	Logicor Financing Sarl, REIT, 1.63%, 15/07/2027	172	0,23
125.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.25%, 02/07/2025	117	0,16
100.000	EUR	Picard Bondco SA, 5.38%, 01/07/2027	91	0,12
300.000	EUR	Rossini Sarl, FRN, 7.59%, 30/10/2025	300	0,40
100.000	EUR	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl, 5.63%, 15/12/2026	93	0,12
275.000	EUR	Segro Capital Sarl, REIT, 1.25%, 23/03/2026	255	0,34
200.000	EUR	SES SA, 3.50%, 14/01/2029	187	0,25
200.000	EUR	SIG Combibloc PurchaseCo Sarl, 2.13%, 18/06/2025 ¹	192	0,26

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Lussemburgo (continua)				
200.000	EUR	SIX Finance Luxembourg SA, 0.00%, 02/12/2025	183	0,24
100.000	EUR	Stena International SA, 3.75%, 01/02/2025	99	0,13
300.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 4.00%, 16/09/2025	297	0,39
Lussemburgo - Totale			3.978	5,28
Paesi Bassi (31 marzo 2023: 14,26%)				
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras Finance BV, FRN, 3.25%, 24/11/2025 ²	183	0,24
500.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.38%, 20/10/2028	497	0,66
175.000	EUR	Achmea BV, 3.63%, 29/11/2025	173	0,23
200.000	EUR	Aegon Bank NV, 0.63%, 21/06/2024	195	0,26
225.000	EUR	Alcon Finance BV, 2.38%, 31/05/2028	209	0,28
200.000	EUR	Argentum Netherlands BV for Givaudan SA, 1.13%, 17/09/2025	189	0,25
400.000	EUR	Ashland Services BV, 2.00%, 30/01/2028	340	0,45
400.000	EUR	ASML Holding NV, 3.50%, 06/12/2025	398	0,53
100.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 2.75%, 23/09/2025	98	0,13
275.000	EUR	Conti-Gummi Finance BV, 2.13%, 27/11/2023	274	0,36
150.000	EUR	Conti-Gummi Finance BV, 1.13%, 25/09/2024 ¹	146	0,19
400.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 4.23%, 25/04/2029	395	0,52
400.000	EUR	CTP NV, REIT, 0.63%, 27/09/2026	341	0,45
300.000	EUR	Danfoss Finance I BV, 0.13%, 28/04/2026 ¹	270	0,36
175.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 0.63%, 15/07/2025	162	0,22
225.000	EUR	Haleon Netherlands Capital BV, 1.25%, 29/03/2026	210	0,28
100.000	EUR	Heineken NV, 2.25%, 30/03/2030	91	0,12
200.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.87%, 28/01/2026 ²	181	0,24
350.000	EUR	IMCD NV, 2.13%, 31/03/2027	320	0,43
225.000	EUR	IMCD NV, 4.88%, 18/09/2028	223	0,30
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 2.13%, 23/05/2026	193	0,26
300.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 4.88%, 14/11/2027	303	0,40
375.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.00%, 16/01/2026	341	0,45
100.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 3.50%, 04/04/2028	98	0,13
175.000	EUR	Koninklijke FrieslandCampina NV, FRN, 2.85%, 10/09/2025 ²	158	0,21
110.000	EUR	Koninklijke KPN NV, FRN, 6.00%, 21/09/2027 ^{1/2}	112	0,15
200.000	EUR	PACCAR Financial Europe BV, 3.25%, 29/11/2025	197	0,26
300.000	EUR	Phoenix PIB Dutch Finance BV, 2.38%, 05/08/2025 ¹	287	0,38
400.000	EUR	Prosus NV, 1.21%, 19/01/2026 ¹	365	0,48
300.000	EUR	RELX Finance BV, 1.50%, 13/05/2027	277	0,37
100.000	EUR	Repsol International Finance BV, FRN, 3.75%, 11/03/2026 ^{1/2}	94	0,13
200.000	EUR	Repsol International Finance BV, FRN, 2.50%, 22/12/2026 ²	177	0,23
150.000	EUR	Saipem Finance International BV, 2.63%, 07/01/2025	146	0,19
500.000	EUR	Samvardhana Moterson Automotive Systems Group BV, 1.80%, 06/07/2024	485	0,64
425.000	EUR	Signify NV, 2.00%, 11/05/2024	419	0,56
300.000	EUR	Sika Capital BV, 3.75%, 03/11/2026	298	0,40
200.000	EUR	Stellantis NV, 3.75%, 29/03/2024	200	0,26
200.000	EUR	Stellantis NV, 2.00%, 20/03/2025	194	0,26
100.000	EUR	Stellantis NV, 3.88%, 05/01/2026 ¹	100	0,13
200.000	EUR	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 3.75%, 09/05/2027 ¹	182	0,24
175.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.00%, 18/11/2025	161	0,21
100.000	EUR	Trivium Packaging Finance BV, FRN, 7.53%, 15/08/2026	99	0,13
250.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 0.75%, 28/02/2026	233	0,31
450.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.75%, 16/11/2028	410	0,54
125.000	EUR	United Group BV, FRN, 7.05%, 15/02/2026	124	0,16
350.000	EUR	Wolters Kluwer NV, 3.00%, 23/09/2026	342	0,45
Paesi Bassi - Totale			10.890	14,43

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Nuova Zelanda (31 marzo 2023: 0,35%)				
100.000	EUR	ASB Bank Ltd., 4.50%, 16/03/2027	101	0,13
200.000	EUR	Westpac Securities NZ Ltd., 0.30%, 25/06/2024	194	0,26
Nuova Zelanda - Totale			295	0,39
Norvegia (31 marzo 2023: 0,26%)				
125.000	EUR	Adevinta ASA, 2.63%, 15/11/2025	123	0,16
400.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 4.00%, 14/03/2029	398	0,53
100.000	EUR	Norsk Hydro ASA, 1.13%, 11/04/2025	95	0,13
Norvegia - Totale			616	0,82
Panama (31 marzo 2023: 0,19%)				
			-	-
Portogallo (31 marzo 2023: 0,37%)				
100.000	EUR	Banco Comercial Portugues SA, FRN, 8.50%, 25/10/2025	103	0,14
300.000	EUR	Banco Comercial Portugues SA, FRN, 4.00%, 17/05/2032 ¹	257	0,34
Portogallo - Totale			360	0,48
Singapore (31 marzo 2023: 0,48%)				
			-	-
Corea del Sud (31 marzo 2023: 0,32%)				
175.000	EUR	POSCO, 0.50%, 17/01/2024	173	0,23
Corea del Sud - Totale			173	0,23
Spagna (31 marzo 2023: 4,36%)				
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 0.63%, 15/07/2025	94	0,12
125.000	EUR	Almirall SA, 2.13%, 30/09/2026	117	0,15
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.75%, 26/11/2025	190	0,25
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 2.58%, 22/02/2029	297	0,39
300.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 5.13%, 10/11/2028	302	0,40
300.000	EUR	Banco Santander SA, 2.50%, 18/03/2025	291	0,39
300.000	EUR	Banco Santander SA, 0.20%, 11/02/2028	253	0,34
100.000	EUR	CaixaBank SA, 2.38%, 01/02/2024	99	0,13
300.000	EUR	CaixaBank SA, 0.88%, 25/03/2024	295	0,39
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 2.25%, 17/04/2030	189	0,25
100.000	EUR	Cellnex Finance Co. SA, 2.25%, 12/04/2026	95	0,13
100.000	EUR	Cellnex Telecom SA, 2.88%, 18/04/2025	98	0,13
325.000	EUR	eDreams ODIGEO SA, 5.50%, 15/07/2027 ¹	306	0,40
400.000	EUR	International Consolidated Airlines Group SA, 3.75%, 25/03/2029 ¹	348	0,46
300.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.38%, 17/01/2025	286	0,38
200.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 4.13%, 05/05/2028	198	0,26
200.000	EUR	Unicaja Banco SA, FRN, 4.50%, 30/06/2025	200	0,27
100.000	EUR	Unicaja Banco SA, FRN, 6.50%, 11/09/2028	99	0,13
200.000	EUR	Werfenlife SA, 0.50%, 28/10/2026	178	0,24
Spagna - Totale			3.935	5,21
Svezia (31 marzo 2023: 3,34%)				
125.000	EUR	Dometic Group AB, 2.00%, 29/09/2028	101	0,13
500.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.25%, 24/11/2025	492	0,65
225.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.13%, 29/06/2027	226	0,30
400.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 1.00%, 15/04/2025	382	0,51
200.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.75%, 05/05/2026 ¹	198	0,26
300.000	EUR	Swedbank AB, 0.20%, 12/01/2028	251	0,33
475.000	EUR	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1.13%, 08/02/2027	421	0,56

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Svezia (continua)				
100.000	EUR	Volvo Car AB, 2.13%, 02/04/2024	99	0,13
100.000	EUR	Volvo Car AB, 2.00%, 24/01/2025	97	0,13
100.000	EUR	Volvo Treasury AB, 0.13%, 17/09/2024	96	0,13
425.000	EUR	Volvo Treasury AB, 1.63%, 26/05/2025 ¹	408	0,54
225.000	EUR	Volvo Treasury AB, 3.63%, 25/05/2027	222	0,30
Svezia - Totale			2.993	3,97
Svizzera (31 marzo 2023: 0,00%)				
300.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 0.25%, 05/11/2028	249	0,33
Svizzera - Totale			249	0,33
Regno Unito (31 marzo 2023: 6,07%)				
450.000	EUR	3i Group plc, 4.88%, 14/06/2029	439	0,58
200.000	EUR	Barclays plc, FRN, 3.38%, 02/04/2025	199	0,26
200.000	EUR	Barclays plc, FRN, 1.38%, 24/01/2026	192	0,26
300.000	EUR	Canary Wharf Group Investment Holdings plc, REIT, 1.75%, 07/04/2026 ¹	216	0,29
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.75%, 27/03/2026	95	0,13
300.000	EUR	EC Finance plc, 3.00%, 15/10/2026	280	0,37
325.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 3.02%, 15/06/2027	312	0,41
300.000	EUR	Informa plc, 1.25%, 22/04/2028	261	0,35
200.000	EUR	Jaguar Land Rover Automotive plc, 2.20%, 15/01/2024	198	0,26
200.000	EUR	Jaguar Land Rover Automotive plc, 4.50%, 15/01/2026 ¹	192	0,26
150.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 3.50%, 01/04/2026	147	0,20
225.000	EUR	Mitsubishi HC Capital UK plc, 0.25%, 03/02/2025	213	0,28
175.000	EUR	National Grid Electricity Transmission plc, 0.19%, 20/01/2025	166	0,22
225.000	EUR	National Grid plc, 2.18%, 30/06/2026	213	0,28
400.000	EUR	NatWest Markets plc, 4.25%, 13/01/2028	398	0,53
200.000	EUR	Nomad Foods Bondco plc, 2.50%, 24/06/2028	174	0,23
200.000	EUR	OTE plc, 0.88%, 24/09/2026	184	0,24
550.000	EUR	Rolls-Royce plc, 4.63%, 16/02/2026 ¹	544	0,72
500.000	EUR	Sage Group plc (The), 3.82%, 15/02/2028	494	0,65
175.000	EUR	SIG plc, 5.25%, 30/11/2026	147	0,20
100.000	EUR	TI Automotive Finance plc, 3.75%, 15/04/2029	82	0,11
200.000	EUR	Victoria plc, 3.75%, 15/03/2028 ¹	147	0,19
Regno Unito - Totale			5.293	7,02
Stati Uniti (31 marzo 2023: 19,23%)				
150.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 0.40%, 15/02/2027	132	0,17
175.000	EUR	Athene Global Funding, 1.24%, 08/04/2024	172	0,23
200.000	EUR	Autoliv, Inc., 4.25%, 15/03/2028	198	0,26
375.000	EUR	Avantor Funding, Inc., 2.63%, 01/11/2025 ¹	359	0,48
250.000	EUR	Baxter International, Inc., 0.40%, 15/05/2024	244	0,32
100.000	EUR	Becton Dickinson and Co., 0.03%, 13/08/2025	93	0,12
400.000	EUR	Belden, Inc., 3.38%, 15/07/2027 ¹	373	0,50
175.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 0.00%, 12/03/2025	165	0,22
675.000	EUR	Berry Global, Inc., 1.00%, 15/01/2025 ¹	646	0,86
300.000	EUR	Blackstone Private Credit Fund, 1.75%, 30/11/2026 ¹	261	0,35
300.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 4.00%, 15/11/2026	301	0,40
200.000	EUR	Capital One Financial Corp., 0.80%, 12/06/2024	195	0,26
100.000	EUR	Catalent Pharma Solutions, Inc., 2.38%, 01/03/2028	84	0,11
300.000	EUR	Citigroup, Inc., 0.75%, 26/10/2023	299	0,40
100.000	EUR	Citigroup, Inc., 2.38%, 22/05/2024	99	0,13
200.000	EUR	Comcast Corp., 0.00%, 14/09/2026	178	0,24
600.000	EUR	Digital Euro Finco LLC, REIT, 2.63%, 15/04/2024 ¹	592	0,78
400.000	EUR	Eli Lilly & Co., 1.63%, 02/06/2026 ¹	379	0,50

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Stati Uniti (continua)				
200.000	EUR	Emerald Debt Merger Sub LLC, 6.38%, 15/12/2030	200	0,26
100.000	EUR	Encore Capital Group, Inc., 4.88%, 15/10/2025	98	0,13
125.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 1.74%, 19/07/2024	122	0,16
300.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 6.13%, 15/05/2028 ¹	309	0,41
200.000	EUR	General Mills, Inc., 0.13%, 15/11/2025	185	0,24
200.000	EUR	General Mills, Inc., 0.45%, 15/01/2026	185	0,24
200.000	EUR	General Mills, Inc., 3.91%, 13/04/2029 ¹	197	0,26
100.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.38%, 15/05/2024	98	0,13
150.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.13%, 19/08/2024	145	0,19
300.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.63%, 27/07/2026	282	0,37
400.000	EUR	Harley-Davidson Financial Services, Inc., 0.90%, 19/11/2024	385	0,51
150.000	EUR	Harley-Davidson Financial Services, Inc., 5.13%, 05/04/2026 ¹	152	0,20
125.000	EUR	IQVIA, Inc., 1.75%, 15/03/2026	117	0,15
500.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.64%, 18/05/2028	455	0,60
100.000	EUR	Levi Strauss & Co., 3.38%, 15/03/2027	94	0,13
300.000	EUR	Mastercard, Inc., 2.10%, 01/12/2027	284	0,38
300.000	EUR	McKesson Corp., 1.50%, 17/11/2025	285	0,38
200.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.38%, 09/04/2024	196	0,26
100.000	EUR	Morgan Stanley, 1.75%, 11/03/2024	99	0,13
125.000	EUR	National Grid North America, Inc., 0.41%, 20/01/2026	115	0,15
175.000	EUR	Netflix, Inc., 3.00%, 15/06/2025	172	0,23
100.000	EUR	Netflix, Inc., 3.63%, 15/05/2027	98	0,13
175.000	EUR	Organon & Co., 2.88%, 30/04/2028	151	0,20
125.000	EUR	PPG Industries, Inc., 1.88%, 01/06/2025	120	0,16
175.000	EUR	Primo Water Holdings, Inc., 3.88%, 31/10/2028	158	0,21
300.000	EUR	Prologis LP, REIT, 3.00%, 02/06/2026 ¹	291	0,39
300.000	EUR	Silgan Holdings, Inc., 3.25%, 15/03/2025	293	0,39
100.000	EUR	Silgan Holdings, Inc., 2.25%, 01/06/2028	85	0,11
200.000	EUR	Standard Industries, Inc., 2.25%, 21/11/2026	177	0,24
Stati Uniti - Totale			10.318	13,67
Totale investimenti in titoli di debito societario			73.812	97,83
Titoli sovranazionali (31 marzo 2023: 0,38%)				
200.000	EUR	Clarios Global LP, 4.38%, 15/05/2026 ¹	193	0,26
Totale investimenti in titoli sovranazionali			193	0,26
Totale investimenti in obbligazioni			74.005	98,09

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto		
Contratti di cambio a termine³						
Classe Z CHF coperta ad accumulazione						
Buy EUR 506,311; Sell CHF 489,200	J.P. Morgan	13 ottobre 2023	1	-		
Totale utili non realizzati (31 marzo 2023: 0,00%)			1	-		
Totale utili non realizzati su contratti di cambio a termine (31 marzo 2023: 0,00%)			1	-		
Contratti di cambio a termine³						
Classe D CHF coperta ad accumulazione						
Buy CHF 1,406,894; Sell EUR 1,474,248	J.P. Morgan	13 ottobre 2023	(21)	(0,03)		
Totale perdite non realizzate (31 marzo 2023: (0,02)%)			(21)	(0,03)		
Classe Z CHF coperta ad accumulazione						
Buy CHF 6,372,788; Sell EUR 6,677,879	J.P. Morgan	13 ottobre 2023	(94)	(0,12)		
Totale perdite non realizzate (31 marzo 2023: (0,13)%)			(94)	(0,12)		
Totale perdite non realizzate su contratti di cambio a termine (31 marzo 2023: (0,15)%)			(115)	(0,15)		
Numero di contratti	Valuta	Importo	Descrizione	Data di scadenza	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Contratti future						
Germania (31 marzo 2023: 0,00%)						
22	EUR	2.200.000	Euro-Bobl	7 dicembre 2023	(27)	(0,04)
Germania - Totale					(27)	(0,04)
Totale perdite non realizzate su contratti future (31 marzo 2023: 0,00%)					(27)	(0,04)
					Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico					74.006	98,09
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico					(142)	(0,19)
Liquidità e liquidità a margine					(36)	(0,05)
Strumenti liquidi equivalenti						
Partecipazione	Valuta	Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2023: 3,11%) BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0) ⁴				
10.091	EUR				1.016	1,35
Totale in strumenti liquidi equivalenti					1.016	1,35
Altre attività e passività					601	0,80
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili					75.445	100,00

Analisi del totale attività	% del totale attività
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	97,12
Organismi di investimento collettivo	1,33
Strumenti finanziari derivati OTC*	-
Altre attività	1,55
Totale attività	100,00

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

¹ Titolo parzialmente o completamente in prestito.

² Il titolo è perpetuo, senza una data di scadenza predeterminata. La data indicata, se applicabile, è la data di richiamo successiva.

³ I contratti di cambio a termine sottoscritti con una controparte che ha la stessa divisa di acquisto, divisa di vendita e data di scadenza saranno presentati su base aggregata. Non esiste alcuna compensazione di posizioni attive e passive.

⁴ Una parte correlata al Fondo.

* Gli investimenti inferiori a 0,005% delle attività totali sono arrotondati a zero.

Valore dell'esposizione	Sui guadagni Migliaia di EUR	Sulle perdite Migliaia di EUR
Contratti di cambio a termine	505	8.032
Contratti future	–	2.547

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI				
Titoli di Stato (31 marzo 2023: 98,00%)				
Australia (31 marzo 2023: 7,51%)				
1.325.000	AUD	Australia Government Bond, 0.25%, 21/11/2024	772	0,82
320.000	AUD	Australia Government Bond, 3.25%, 21/04/2025	192	0,20
767.000	AUD	Australia Government Bond, 0.25%, 21/11/2025 ¹	431	0,46
1.484.000	AUD	Australia Government Bond, 4.75%, 21/04/2027	924	0,98
595.000	AUD	Australia Government Bond, 2.75%, 21/11/2027	344	0,37
620.000	AUD	Australia Government Bond, 2.75%, 21/11/2028	354	0,38
630.000	AUD	Australia Government Bond, 3.25%, 21/04/2029	367	0,39
660.000	AUD	Australia Government Bond, 2.75%, 21/11/2029	371	0,39
180.000	AUD	Australia Government Bond, 2.50%, 21/05/2030	99	0,11
295.000	AUD	Australia Government Bond, 1.00%, 21/12/2030	143	0,15
315.000	AUD	Australia Government Bond, 1.50%, 21/06/2031	156	0,17
335.000	AUD	Australia Government Bond, 1.00%, 21/11/2031	157	0,17
328.000	AUD	Australia Government Bond, 1.25%, 21/05/2032	155	0,16
250.000	AUD	Australia Government Bond, 1.75%, 21/11/2032	122	0,13
973.000	AUD	Australia Government Bond, 4.50%, 21/04/2033	595	0,63
310.000	AUD	Australia Government Bond, 3.00%, 21/11/2033	166	0,18
730.000	AUD	Australia Government Bond, 3.25%, 21/06/2039	373	0,40
260.000	AUD	Australia Government Bond, 2.75%, 21/05/2041	120	0,13
241.000	AUD	Australia Government Bond, 3.00%, 21/03/2047	109	0,12
712.000	AUD	Australia Government Bond, 1.75%, 21/06/2051	230	0,24
Australia - Totale			6.180	6,58
Austria (31 marzo 2023: 2,60%)				
233.000	EUR	Austria Government Bond, 1.65%, 21/10/2024	228	0,24
199.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/04/2025	189	0,20
180.000	EUR	Austria Government Bond, 1.20%, 20/10/2025	173	0,18
250.000	EUR	Austria Government Bond, 0.75%, 20/10/2026	233	0,25
121.000	EUR	Austria Government Bond, 0.75%, 20/02/2028	109	0,12
112.000	EUR	Austria Government Bond, 0.50%, 20/02/2029	97	0,10
90.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/02/2030	73	0,08
303.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/02/2031	238	0,25
76.000	EUR	Austria Government Bond, 2.90%, 20/02/2033	73	0,08
50.000	EUR	Austria Government Bond, 0.25%, 20/10/2036	33	0,03
182.000	EUR	Austria Government Bond, 4.15%, 15/03/2037	192	0,20
72.000	EUR	Austria Government Bond, 3.15%, 20/06/2044	67	0,07
90.000	EUR	Austria Government Bond, 1.50%, 20/02/2047	60	0,06
36.000	EUR	Austria Government Bond, 1.85%, 23/05/2049	25	0,03
159.000	EUR	Austria Government Bond, 0.75%, 20/03/2051	81	0,09
90.000	EUR	Austria Government Bond, 3.80%, 26/01/2062	93	0,10
92.000	EUR	Austria Government Bond, 0.70%, 20/04/2071	34	0,04
70.000	EUR	Austria Government Bond, 1.50%, 02/11/2086 ¹	35	0,04
54.000	EUR	Austria Government Bond, 2.10%, 20/09/2117	34	0,04
8.000	EUR	Austria Government Bond, 0.85%, 30/06/2120	3	-
Austria - Totale			2.070	2,20
Belgio (31 marzo 2023: 1,62%)				
			-	-
Canada (31 marzo 2023: 5,00%)				
383.000	CAD	Canada Government Bond, 1.50%, 01/09/2024	259	0,28
770.000	CAD	Canada Government Bond, 3.75%, 01/05/2025	528	0,56
370.000	CAD	Canada Government Bond, 0.50%, 01/09/2025	238	0,25
170.000	CAD	Canada Government Bond, 0.25%, 01/03/2026	107	0,11
790.000	CAD	Canada Government Bond, 3.00%, 01/04/2026	531	0,57
260.000	CAD	Canada Government Bond, 1.50%, 01/06/2026	168	0,17
102.000	CAD	Canada Government Bond, 8.00%, 01/06/2027	80	0,09
320.000	CAD	Canada Government Bond, 3.50%, 01/03/2028	216	0,23

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Canada (continua)				
281.000	CAD	Canada Government Bond, 2.25%, 01/06/2029	178	0,19
490.000	CAD	Canada Government Bond, 2.25%, 01/12/2029	309	0,33
301.000	CAD	Canada Government Bond, 1.25%, 01/06/2030	176	0,19
244.000	CAD	Canada Government Bond, 0.50%, 01/12/2030	133	0,14
398.000	CAD	Canada Government Bond, 1.50%, 01/06/2031	231	0,25
31.000	CAD	Canada Government Bond, 1.50%, 01/12/2031	18	0,02
327.000	CAD	Canada Government Bond, 2.00%, 01/06/2032	194	0,21
380.000	CAD	Canada Government Bond, 2.75%, 01/06/2033	239	0,25
115.000	CAD	Canada Government Bond, 5.75%, 01/06/2033	91	0,10
200.000	CAD	Canada Government Bond, 3.25%, 01/12/2033	131	0,14
90.000	CAD	Canada Government Bond, 5.00%, 01/06/2037	69	0,07
219.000	CAD	Canada Government Bond, 4.00%, 01/06/2041	153	0,16
40.000	CAD	Canada Government Bond, 3.50%, 01/12/2045	26	0,03
218.000	CAD	Canada Government Bond, 2.75%, 01/12/2048	125	0,13
402.000	CAD	Canada Government Bond, 2.00%, 01/12/2051	193	0,20
275.000	CAD	Canada Government Bond, 1.75%, 01/12/2053	121	0,13
110.000	CAD	Canada Government Bond, 2.75%, 01/12/2055	62	0,07
69.000	CAD	Canada Government Bond, 2.75%, 01/12/2064	38	0,04
Canada - Totale			4.614	4,91
Cina (31 marzo 2023: 6,21%)				
9.460.000	CNY	China Government Bond, 1.99%, 09/04/2025	1.219	1,30
9.800.000	CNY	China Government Bond, 2.69%, 12/08/2026	1.281	1,36
14.100.000	CNY	China Government Bond, 2.50%, 25/07/2027	1.826	1,94
5.200.000	CNY	China Government Bond, 2.80%, 24/03/2029	680	0,72
10.000.000	CNY	China Government Bond, 2.68%, 21/05/2030	1.294	1,38
19.200.000	CNY	China Government Bond, 2.80%, 15/11/2032	2.503	2,66
2.450.000	CNY	China Government Bond, 4.09%, 27/04/2035	361	0,39
1.320.000	CNY	China Government Bond, 3.52%, 25/04/2046	185	0,20
1.900.000	CNY	China Government Bond, 3.72%, 12/04/2051	276	0,29
5.200.000	CNY	China Government Bond, 3.32%, 15/04/2052	710	0,76
4.290.000	CNY	China Government Bond, 4.33%, 10/11/2061	711	0,76
200.000	CNY	China Government Bond, 3.40%, 15/07/2072	28	0,03
100.000	CNY	China Government Bond, 3.27%, 25/03/2073	13	0,01
Cina - Totale			11.087	11,80
Cipro (31 marzo 2023: 0,01%)				
20.000	EUR	Cyprus Government Bond, 2.25%, 16/04/2050	13	0,01
Cipro - Totale			13	0,01
Repubblica ceca (31 marzo 2023: 0,75%)				
2.560.000	CZK	Czech Government Bond, 1.25%, 14/02/2025	99	0,11
3.220.000	CZK	Czech Government Bond, 0.25%, 10/02/2027	114	0,12
4.960.000	CZK	Czech Government Bond, 2.75%, 23/07/2029	183	0,20
1.830.000	CZK	Czech Government Bond, 0.05%, 29/11/2029	57	0,06
1.600.000	CZK	Czech Government Bond, 1.20%, 13/03/2031	51	0,05
3.980.000	CZK	Czech Government Bond, 1.75%, 23/06/2032	130	0,14
1.740.000	CZK	Czech Government Bond, 4.20%, 04/12/2036	68	0,07
Repubblica Ceca - Totale			702	0,75
Danimarca (31 marzo 2023: 1,05%)				
1.218.000	DKK	Denmark Government Bond, 0.00%, 15/11/2024	157	0,17
1.951.000	DKK	Denmark Government Bond, 0.50%, 15/11/2027	237	0,25
657.000	DKK	Denmark Government Bond, 0.50%, 15/11/2029	76	0,08
1.720.000	DKK	Denmark Government Bond, 0.00%, 15/11/2031	182	0,20

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Danimarca (continua)				
1.801.000	DKK	Denmark Government Bond, 4.50%, 15/11/2039	282	0,30
775.000	DKK	Denmark Government Bond, 0.25%, 15/11/2052	48	0,05
Danimarca - Totale			982	1,05
Finlandia (31 marzo 2023: 1,10%)				
320.000	EUR	Finland Government Bond, 0.00%, 15/09/2024 ¹	309	0,33
384.000	EUR	Finland Government Bond, 2.75%, 04/07/2028	377	0,40
70.000	EUR	Finland Government Bond, 0.00%, 15/09/2030	56	0,06
88.000	EUR	Finland Government Bond, 1.13%, 15/04/2034 ¹	70	0,08
128.000	EUR	Finland Government Bond, 0.13%, 15/04/2036	84	0,09
80.000	EUR	Finland Government Bond, 0.25%, 15/09/2040	46	0,05
47.000	EUR	Finland Government Bond, 2.63%, 04/07/2042	41	0,04
40.000	EUR	Finland Government Bond, 0.50%, 15/04/2043	23	0,02
104.000	EUR	Finland Government Bond, 1.38%, 15/04/2047	68	0,07
91.000	EUR	Finland Government Bond, 0.13%, 15/04/2052	37	0,04
Finlandia - Totale			1.111	1,18
Francia (31 marzo 2023: 6,95%)				
453.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2025	432	0,46
110.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.00%, 25/11/2025	105	0,11
270.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2026	250	0,27
400.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.50%, 24/09/2026	392	0,42
436.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/11/2028	387	0,41
104.000	EUR	France Government Bond OAT, 5.50%, 25/04/2029	117	0,12
631.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2029	546	0,58
176.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2031 ¹	156	0,17
330.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/11/2031 ¹	254	0,27
394.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/05/2032 ¹	298	0,32
170.000	EUR	France Government Bond OAT, 5.75%, 25/10/2032	202	0,21
215.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.25%, 25/05/2034	173	0,18
272.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.25%, 25/05/2038	198	0,21
110.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.75%, 25/06/2039	85	0,09
65.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.50%, 25/04/2041	71	0,08
170.000	EUR	France Government Bond OAT, 3.25%, 25/05/2045	157	0,17
80.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2050	49	0,05
293.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2053	135	0,14
Francia - Totale			4.007	4,26
Germania (31 marzo 2023: 9,10%)				
350.000	EUR	Bundesobligation, 0.00%, 10/04/2026 ¹	325	0,35
358.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.00%, 15/08/2025 ¹	344	0,37
1.310.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.50%, 04/07/2027	1.476	1,57
478.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/08/2028 ¹	425	0,45
270.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2029 ¹	231	0,25
330.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.10%, 15/11/2029	318	0,34
250.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/02/2030 ¹	211	0,22
380.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.50%, 04/01/2031	448	0,48
167.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/02/2031 ¹	137	0,15
102.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2031 ¹	82	0,09
158.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/02/2032 ¹	126	0,13
220.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.30%, 15/02/2033	211	0,23
250.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.75%, 04/07/2034	293	0,31
110.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/05/2036	76	0,08
517.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.00%, 04/01/2037	576	0,61
90.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.00%, 15/05/2038	69	0,07

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Germania (continua)				
303.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 3.25%, 04/07/2042	313	0,33
218.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.50%, 04/07/2044	201	0,21
344.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.25%, 15/08/2048	241	0,26
198.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2050	91	0,10
181.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2052	78	0,08
170.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.80%, 15/08/2053	130	0,14
300.000	EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.20%, 12/12/2024 ¹	296	0,31
420.000	EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.80%, 12/06/2025 ¹	417	0,44
Germania - Totale			7.115	7,57
Hong Kong (31 marzo 2023: 0,06%)				
500.000	HKD	Hong Kong Government Bond, 1.97%, 17/01/2029	55	0,06
Hong Kong - Totale			55	0,06
Indonesia (31 marzo 2023: 0,00%)				
4.150.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 5.50%, 15/04/2026	249	0,26
3.906.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 5.13%, 15/04/2027	229	0,24
3.201.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 6.38%, 15/08/2028	194	0,21
1.334.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 7.00%, 15/09/2030	83	0,09
1.817.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 6.50%, 15/02/2031	109	0,12
4.720.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 6.38%, 15/04/2032	282	0,30
5.794.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 7.00%, 15/02/2033	357	0,38
2.165.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 7.13%, 15/06/2038	134	0,14
3.001.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 7.50%, 15/04/2040	192	0,20
2.072.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 7.13%, 15/06/2043	128	0,14
Indonesia - Totale			1.957	2,08
Irlanda (31 marzo 2023: 1,35%)				
130.000	EUR	Ireland Government Bond, 5.40%, 13/03/2025	134	0,14
27.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.00%, 15/05/2026	25	0,03
340.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.20%, 15/05/2027	306	0,33
160.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.90%, 15/05/2028	145	0,15
90.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.10%, 15/05/2029	80	0,09
70.000	EUR	Ireland Government Bond, 2.40%, 15/05/2030	67	0,07
23.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.00%, 18/10/2031	18	0,02
20.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.30%, 15/05/2033	17	0,02
36.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.40%, 15/05/2035	26	0,03
180.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.70%, 15/05/2037	144	0,15
196.000	EUR	Ireland Government Bond, 2.00%, 18/02/2045	148	0,16
139.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.50%, 15/05/2050	88	0,09
Irlanda - Totale			1.198	1,28
Israele (31 marzo 2023: 0,61%)				
730.000	ILS	Israel Government Bond, 0.40%, 31/10/2024	173	0,18
740.000	ILS	Israel Government Bond, 0.50%, 27/02/2026	167	0,18
491.000	ILS	Israel Government Bond, 2.00%, 31/03/2027	114	0,12
350.000	ILS	Israel Government Bond, 3.75%, 28/02/2029	85	0,09
306.000	ILS	Israel Government Bond, 1.00%, 31/03/2030	62	0,07
356.000	ILS	Israel Government Bond, 1.30%, 30/04/2032	70	0,08
376.000	ILS	Israel Government Bond, 1.50%, 31/05/2037	66	0,07
193.000	ILS	Israel Government Bond, 5.50%, 31/01/2042	56	0,06
303.000	ILS	Israel Government Bond, 3.75%, 31/03/2047	68	0,07
320.000	ILS	Israel Government Bond, 2.80%, 29/11/2052	57	0,06
Israele - Totale			918	0,98

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Italia (31 marzo 2023: 3,09%)				
123.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.00%, 15/12/2024 ¹	117	0,12
230.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.40%, 28/03/2025	228	0,24
285.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.50%, 01/03/2026	289	0,31
87.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.00%, 01/08/2026	78	0,08
337.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.65%, 01/12/2027	319	0,34
215.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.00%, 01/02/2028	198	0,21
69.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.75%, 01/09/2028	71	0,08
86.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.00%, 01/08/2029	80	0,09
456.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.50%, 01/03/2030	436	0,46
436.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 01/06/2032 ¹	325	0,35
94.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.50%, 01/12/2032 ¹	79	0,08
261.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.35%, 01/03/2035	228	0,24
90.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 01/03/2037	56	0,06
109.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.25%, 01/03/2038	90	0,10
140.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.95%, 01/09/2038	111	0,12
28.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.80%, 01/03/2041	18	0,02
166.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.50%, 30/04/2045	91	0,10
Italia - Totale			2.814	3,00
Giappone (31 marzo 2023: 8,60%)				
49.300.000	JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.10%, 20/09/2025	312	0,33
31.750.000	JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.10%, 20/12/2025	201	0,21
4.300.000	JPY	Japan Government Forty Year Bond, 2.20%, 20/03/2051	31	0,03
5.550.000	JPY	Japan Government Forty Year Bond, 2.00%, 20/03/2052	38	0,04
14.500.000	JPY	Japan Government Forty Year Bond, 0.80%, 20/03/2058	71	0,08
11.750.000	JPY	Japan Government Forty Year Bond, 0.50%, 20/03/2060	50	0,05
4.100.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.40%, 20/09/2025	26	0,03
27.550.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.10%, 20/03/2026	174	0,19
40.200.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.10%, 20/09/2027	253	0,27
21.500.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.10%, 20/06/2028	135	0,14
55.500.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.10%, 20/03/2029	346	0,37
6.400.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.10%, 20/09/2029	40	0,04
4.000.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.10%, 20/06/2030	25	0,03
11.850.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.10%, 20/12/2031	72	0,08
25.900.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.20%, 20/06/2032	157	0,17
43.200.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.20%, 20/09/2032	262	0,28
30.050.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.50%, 20/03/2033	186	0,20
6.450.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.40%, 20/06/2033	39	0,04
7.850.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.50%, 20/09/2036	59	0,06
29.900.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.30%, 20/12/2036	219	0,23
7.900.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.30%, 20/03/2039	58	0,06
16.050.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.30%, 20/03/2040	117	0,12
2.000.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.00%, 20/09/2040	14	0,02
29.250.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.00%, 20/09/2041	204	0,22
25.150.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.50%, 20/03/2045	159	0,17
3.550.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.60%, 20/06/2045	23	0,02
18.850.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.80%, 20/03/2046	103	0,11
10.450.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.50%, 20/09/2046	53	0,06
7.250.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.60%, 20/12/2046	38	0,04
13.000.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.80%, 20/03/2047	70	0,08
6.050.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.80%, 20/12/2047	32	0,03
10.550.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.70%, 20/12/2048	55	0,06
10.100.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.60%, 20/09/2050	50	0,05
20.200.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.70%, 20/06/2051	101	0,11
11.750.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.70%, 20/09/2051	59	0,06
7.050.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.00%, 20/03/2052	38	0,04
4.500.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.30%, 20/06/2052	26	0,03

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Giappone (continua)				
12.050.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.40%, 20/03/2053	72	0,08
65.000.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.10%, 20/12/2026	437	0,47
33.150.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.10%, 20/03/2027	224	0,24
13.600.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.10%, 20/09/2029	95	0,10
31.850.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.90%, 20/09/2030	221	0,23
43.500.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.00%, 20/03/2031	304	0,32
6.850.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.80%, 20/09/2031	47	0,05
46.850.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.70%, 20/12/2031	322	0,34
6.500.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.70%, 20/09/2032	45	0,05
15.100.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.70%, 20/09/2033	104	0,11
10.150.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.60%, 20/12/2033	69	0,07
18.550.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.40%, 20/09/2034	124	0,13
17.750.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.40%, 20/03/2036	105	0,11
12.350.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.20%, 20/06/2036	71	0,08
1.700.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.60%, 20/06/2037	10	0,01
12.950.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.60%, 20/12/2037	77	0,08
28.950.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.50%, 20/12/2038	166	0,18
14.150.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.30%, 20/06/2039	78	0,08
15.000.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.40%, 20/06/2040	82	0,09
12.550.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.90%, 20/06/2042	73	0,08
29.200.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.10%, 20/09/2042	176	0,19
90.500.000	JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.01%, 01/10/2024	573	0,61
34.700.000	JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.01%, 01/12/2024	220	0,23
72.150.000	JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.01%, 01/08/2025	457	0,49
Giappone - Totale			8.048	8,57
Lettonia (31 marzo 2023: 0,08%)				
100.000	EUR	Latvia Government Bond, 0.00%, 17/03/2031	75	0,08
Lettonia - Totale			75	0,08
Lituania (31 marzo 2023: 0,05%)				
56.000	EUR	Lithuania Government Bond, 0.75%, 06/05/2030	45	0,05
Lituania - Totale			45	0,05
Lussemburgo (31 marzo 2023: 0,03%)				
36.000	EUR	State of the Grand-Duchy of Luxembourg, 0.00%, 24/03/2031	28	0,03
Lussemburgo - Totale			28	0,03
Malesia (31 marzo 2023: 0,00%)				
1.140.000	MYR	Malaysia Government Bond, 3.66%, 15/10/2024	230	0,24
550.000	MYR	Malaysia Government Bond, 3.73%, 31/03/2026	111	0,12
1.250.000	MYR	Malaysia Government Bond, 3.42%, 30/09/2027	248	0,26
1.250.000	MYR	Malaysia Government Bond, 3.89%, 15/08/2029	251	0,27
1.950.000	MYR	Malaysia Government Bond, 4.19%, 07/10/2032	397	0,42
1.350.000	MYR	Malaysia Government Bond, 4.66%, 31/03/2038	287	0,31
550.000	MYR	Malaysia Government Bond, 4.29%, 14/08/2043	110	0,12
420.000	MYR	Malaysia Government Bond, 4.92%, 06/07/2048	90	0,10
220.000	MYR	Malaysia Government Bond, 4.07%, 15/06/2050	41	0,04
270.000	MYR	Malaysia Government Bond, 5.36%, 15/05/2052	62	0,06
Malesia - Totale			1.827	1,94
Paesi Bassi (31 marzo 2023: 3,30%)				
64.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.25%, 15/07/2025	61	0,06
774.496	EUR	Netherlands Government Bond, 0.50%, 15/07/2026	722	0,77

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Paesi Bassi (continua)				
177.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.75%, 15/07/2027	163	0,17
306.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.75%, 15/07/2028	276	0,29
441.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.25%, 15/07/2029	377	0,40
160.000	EUR	Netherlands Government Bond, 2.50%, 15/01/2030	155	0,16
315.000	EUR	Netherlands Government Bond, 2.50%, 15/01/2033	299	0,32
83.000	EUR	Netherlands Government Bond, 4.00%, 15/01/2037	89	0,10
192.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/01/2038	121	0,13
90.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.50%, 15/01/2040	59	0,06
272.000	EUR	Netherlands Government Bond, 3.75%, 15/01/2042	289	0,31
303.000	EUR	Netherlands Government Bond, 2.75%, 15/01/2047 ¹	278	0,30
188.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/01/2052	78	0,08
70.000	EUR	Netherlands Government Bond, 2.00%, 15/01/2054	53	0,06
Paesi Bassi - Totale			3.020	3,21
Nuova Zelanda (31 marzo 2023: 1,04%)				
440.000	NZD	New Zealand Government Bond, 2.75%, 15/04/2025	239	0,26
279.000	NZD	New Zealand Government Bond, 4.50%, 15/04/2027	154	0,16
180.000	NZD	New Zealand Government Bond, 0.25%, 15/05/2028	81	0,09
245.000	NZD	New Zealand Government Bond, 3.00%, 20/04/2029	124	0,13
160.000	NZD	New Zealand Government Bond, 1.50%, 15/05/2031	69	0,07
220.000	NZD	New Zealand Government Bond, 3.50%, 14/04/2033	108	0,12
210.000	NZD	New Zealand Government Bond, 2.75%, 15/04/2037	89	0,09
218.000	NZD	New Zealand Government Bond, 1.75%, 15/05/2041	72	0,08
83.000	NZD	New Zealand Government Bond, 2.75%, 15/05/2051	29	0,03
Nuova Zelanda - Totale			965	1,03
Norvegia (31 marzo 2023: 0,59%)				
1.709.000	NOK	Norway Government Bond, 1.75%, 13/03/2025	147	0,15
982.000	NOK	Norway Government Bond, 1.50%, 19/02/2026	82	0,09
775.000	NOK	Norway Government Bond, 2.00%, 26/04/2028	63	0,07
869.000	NOK	Norway Government Bond, 1.38%, 19/08/2030	65	0,07
705.000	NOK	Norway Government Bond, 1.25%, 17/09/2031	51	0,05
357.000	NOK	Norway Government Bond, 2.13%, 18/05/2032	27	0,03
680.000	NOK	Norway Government Bond, 3.00%, 15/08/2033	56	0,06
410.000	NOK	Norway Government Bond, 3.50%, 06/10/2042 ¹	35	0,04
Norvegia - Totale			526	0,56
Romania (31 marzo 2023: 0,00%)				
1.080.000	RON	Romania Government Bond, 7.20%, 28/10/2026	221	0,23
510.000	RON	Romania Government Bond, 8.00%, 29/04/2030	108	0,12
390.000	RON	Romania Government Bond, 8.25%, 29/09/2032	85	0,09
Romania - Totale			414	0,44
Singapore (31 marzo 2023: 1,51%)				
320.000	SGD	Singapore Government Bond, 3.00%, 01/09/2024	220	0,23
508.000	SGD	Singapore Government Bond, 3.50%, 01/03/2027	352	0,37
90.000	SGD	Singapore Government Bond, 2.63%, 01/05/2028	60	0,06
514.000	SGD	Singapore Government Bond, 2.88%, 01/09/2030	344	0,37
131.000	SGD	Singapore Government Bond, 2.63%, 01/08/2032	85	0,09
257.000	SGD	Singapore Government Bond, 2.25%, 01/08/2036	158	0,17
180.000	SGD	Singapore Government Bond, 2.38%, 01/07/2039	111	0,12
54.000	SGD	Singapore Government Bond, 2.75%, 01/04/2042	35	0,04
150.000	SGD	Singapore Government Bond, 2.75%, 01/03/2046	97	0,10
100.000	SGD	Singapore Government Bond, 1.88%, 01/03/2050	53	0,06
48.000	SGD	Singapore Government Bond, 1.88%, 01/10/2051	26	0,03

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Singapore (continua)				
30.000	SGD	Singapore Government Bond, 3.00%, 01/08/2072	21	0,02
		Singapore - Totale	1.562	1,66
Slovacchia (31 marzo 2023: 0,19%)				
223.000	EUR	Slovakia Government Bond, 0.75%, 09/04/2030	184	0,20
		Slovacchia - Totale	184	0,20
Slovenia (31 marzo 2023: 0,12%)				
60.000	EUR	Slovenia Government Bond, 1.19%, 14/03/2029	53	0,06
80.000	EUR	Slovenia Government Bond, 3.63%, 11/03/2033	80	0,08
		Slovenia - Totale	133	0,14
Corea del Sud (31 marzo 2023: 8,04%)				
345.260.000	KRW	Korea Treasury Bond, 3.00%, 10/09/2024	240	0,26
387.570.000	KRW	Korea Treasury Bond, 1.50%, 10/03/2025	263	0,28
242.100.000	KRW	Korea Treasury Bond, 3.38%, 10/03/2025	169	0,18
444.180.000	KRW	Korea Treasury Bond, 2.25%, 10/06/2025	303	0,32
371.690.000	KRW	Korea Treasury Bond, 2.25%, 10/12/2025	251	0,27
503.850.000	KRW	Korea Treasury Bond, 4.25%, 10/12/2025	355	0,38
489.640.000	KRW	Korea Treasury Bond, 3.13%, 10/06/2026	336	0,36
201.800.000	KRW	Korea Treasury Bond, 2.38%, 10/03/2027	134	0,14
949.690.000	KRW	Korea Treasury Bond, 2.13%, 10/06/2027	625	0,67
328.450.000	KRW	Korea Treasury Bond, 3.13%, 10/09/2027	223	0,24
120.000.000	KRW	Korea Treasury Bond, 5.50%, 10/03/2028	89	0,10
557.260.000	KRW	Korea Treasury Bond, 2.38%, 10/12/2028	362	0,38
441.210.000	KRW	Korea Treasury Bond, 1.38%, 10/06/2030	263	0,28
191.140.000	KRW	Korea Treasury Bond, 4.75%, 10/12/2030	140	0,15
562.370.000	KRW	Korea Treasury Bond, 2.00%, 10/06/2031	343	0,37
498.040.000	KRW	Korea Treasury Bond, 4.00%, 10/12/2031	349	0,37
160.170.000	KRW	Korea Treasury Bond, 4.25%, 10/12/2032	114	0,12
134.650.000	KRW	Korea Treasury Bond, 3.25%, 10/06/2033	88	0,09
154.570.000	KRW	Korea Treasury Bond, 3.75%, 10/12/2033	105	0,11
477.160.000	KRW	Korea Treasury Bond, 2.63%, 10/09/2035	290	0,31
67.780.000	KRW	Korea Treasury Bond, 2.38%, 10/09/2038	39	0,04
375.980.000	KRW	Korea Treasury Bond, 1.13%, 10/09/2039	175	0,19
111.760.000	KRW	Korea Treasury Bond, 3.25%, 10/09/2042	71	0,08
626.530.000	KRW	Korea Treasury Bond, 3.00%, 10/12/2042	385	0,41
43.510.000	KRW	Korea Treasury Bond, 2.00%, 10/03/2046	22	0,02
57.650.000	KRW	Korea Treasury Bond, 2.13%, 10/03/2047	29	0,03
288.320.000	KRW	Korea Treasury Bond, 2.63%, 10/03/2048	160	0,17
526.910.000	KRW	Korea Treasury Bond, 2.00%, 10/03/2049	255	0,27
451.810.000	KRW	Korea Treasury Bond, 1.50%, 10/03/2050	191	0,20
518.740.000	KRW	Korea Treasury Bond, 1.88%, 10/03/2051	239	0,25
110.940.000	KRW	Korea Treasury Bond, 2.50%, 10/03/2052	59	0,06
296.550.000	KRW	Korea Treasury Bond, 3.13%, 10/09/2052	180	0,19
240.530.000	KRW	Korea Treasury Bond, 3.25%, 10/03/2053	149	0,16
329.770.000	KRW	Korea Treasury Bond, 2.00%, 10/09/2068	139	0,15
523.990.000	KRW	Korea Treasury Bond, 1.63%, 10/09/2070	190	0,20
		Corea del Sud - Totale	7.325	7,80
Spagna (31 marzo 2023: 3,29%)				
180.000	EUR	Spain Government Bond, 0.00%, 31/05/2025	170	0,18
210.000	EUR	Spain Government Bond, 0.00%, 31/01/2026	194	0,21
150.000	EUR	Spain Government Bond, 0.00%, 31/01/2027	134	0,14
109.000	EUR	Spain Government Bond, 0.80%, 30/07/2027	99	0,11

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Spagna (continua)				
120.000	EUR	Spain Government Bond, 0.00%, 31/01/2028	103	0,11
60.000	EUR	Spain Government Bond, 5.15%, 31/10/2028	65	0,07
250.000	EUR	Spain Government Bond, 1.45%, 30/04/2029 ¹	224	0,24
280.000	EUR	Spain Government Bond, 0.60%, 31/10/2029	235	0,25
170.000	EUR	Spain Government Bond, 0.50%, 30/04/2030	140	0,15
160.000	EUR	Spain Government Bond, 2.55%, 31/10/2032	145	0,15
360.000	EUR	Spain Government Bond, 3.15%, 30/04/2033	340	0,36
230.000	EUR	Spain Government Bond, 0.85%, 30/07/2037	151	0,16
40.000	EUR	Spain Government Bond, 1.00%, 30/07/2042	23	0,02
70.000	EUR	Spain Government Bond, 3.45%, 30/07/2043	61	0,07
50.000	EUR	Spain Government Bond, 2.90%, 31/10/2046	39	0,04
Spagna - Totale			2.123	2,26
Svezia (31 marzo 2023: 0,71%)				
2.560.000	SEK	Sweden Government Bond, 2.50%, 12/05/2025	219	0,23
1.810.000	SEK	Sweden Government Bond, 1.00%, 12/11/2026	147	0,16
940.000	SEK	Sweden Government Bond, 0.75%, 12/05/2028	74	0,08
650.000	SEK	Sweden Government Bond, 0.75%, 12/11/2029	50	0,05
1.375.000	SEK	Sweden Government Bond, 3.50%, 30/03/2039	127	0,14
160.000	SEK	Sweden Government Bond, 0.50%, 24/11/2045	8	0,01
450.000	SEK	Sweden Government Bond, 1.38%, 23/06/2071	22	0,02
Svezia - Totale			647	0,69
Svizzera (31 marzo 2023: 1,23%)				
160.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.50%, 24/07/2025	166	0,18
40.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 3.25%, 27/06/2027	44	0,05
58.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 4.00%, 08/04/2028	68	0,07
220.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.00%, 22/06/2029	214	0,23
25.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.50%, 27/05/2030	25	0,03
46.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 2.25%, 22/06/2031	52	0,05
74.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.50%, 27/06/2032 ¹	73	0,08
138.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 2.50%, 08/03/2036	166	0,18
155.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.50%, 30/04/2042	171	0,18
30.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.50%, 28/06/2045	27	0,03
68.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.50%, 24/05/2055	60	0,06
98.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 2.00%, 25/06/2064	137	0,14
Svizzera - Totale			1.203	1,28
Tailandia (31 marzo 2023: 1,66%)				
10.636.000	THB	Thailand Government Bond, 1.45%, 17/12/2024	272	0,29
7.000.000	THB	Thailand Government Bond, 0.95%, 17/06/2025	177	0,19
12.808.000	THB	Thailand Government Bond, 1.60%, 17/12/2029	308	0,33
1.670.000	THB	Thailand Government Bond, 3.35%, 17/06/2033	44	0,05
3.700.000	THB	Thailand Government Bond, 1.60%, 17/06/2035	80	0,08
8.721.000	THB	Thailand Government Bond, 3.40%, 17/06/2036	227	0,24
866.000	THB	Thailand Government Bond, 2.00%, 17/06/2042	18	0,02
5.230.000	THB	Thailand Government Bond, 4.68%, 29/06/2044	156	0,16
1.650.000	THB	Thailand Government Bond, 2.88%, 17/06/2046	37	0,04
3.851.000	THB	Thailand Government Bond, 4.85%, 17/06/2061	119	0,13
1.870.000	THB	Thailand Government Bond, 4.00%, 17/06/2066	50	0,05
Tailandia - Totale			1.488	1,58
Regno Unito (31 marzo 2023: 8,97%)				
523.000	GBP	UK Treasury, 2.75%, 07/09/2024 ¹	590	0,63
340.000	GBP	UK Treasury, 0.63%, 07/06/2025 ¹	367	0,39

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Regno Unito (continua)				
954.000	GBP	UK Treasury, 0.13%, 30/01/2026 ¹	996	1,06
570.000	GBP	UK Treasury, 4.13%, 29/01/2027 ¹	648	0,69
435.000	GBP	UK Treasury, 1.63%, 22/10/2028 ¹	442	0,47
117.000	GBP	UK Treasury, 6.00%, 07/12/2028	145	0,16
361.000	GBP	UK Treasury, 0.50%, 31/01/2029	340	0,36
100.000	GBP	UK Treasury, 0.88%, 22/10/2029 ¹	95	0,10
548.000	GBP	UK Treasury, 0.38%, 22/10/2030 ¹	483	0,51
200.000	GBP	UK Treasury, 1.00%, 31/01/2032	177	0,19
315.000	GBP	UK Treasury, 4.25%, 07/06/2032 ¹	361	0,39
325.000	GBP	UK Treasury, 3.25%, 31/01/2033	341	0,36
613.000	GBP	UK Treasury, 0.63%, 31/07/2035	455	0,48
111.000	GBP	UK Treasury, 1.75%, 07/09/2037	90	0,10
294.000	GBP	UK Treasury, 3.75%, 29/01/2038	305	0,33
229.000	GBP	UK Treasury, 1.13%, 31/01/2039	161	0,17
341.000	GBP	UK Treasury, 1.25%, 22/10/2041	227	0,24
415.000	GBP	UK Treasury, 4.50%, 07/12/2042	460	0,49
295.000	GBP	UK Treasury, 0.88%, 31/01/2046	157	0,17
83.000	GBP	UK Treasury, 1.50%, 22/07/2047	50	0,05
352.000	GBP	UK Treasury, 1.75%, 22/01/2049	224	0,24
120.000	GBP	UK Treasury, 4.25%, 07/12/2049	125	0,13
30.000	GBP	UK Treasury, 0.63%, 22/10/2050	13	0,01
204.000	GBP	UK Treasury, 1.25%, 31/07/2051	107	0,11
361.000	GBP	UK Treasury, 3.75%, 22/10/2053	343	0,37
233.000	GBP	UK Treasury, 4.25%, 07/12/2055	243	0,26
212.000	GBP	UK Treasury, 1.75%, 22/07/2057	122	0,13
28.000	GBP	UK Treasury, 4.00%, 22/01/2060	28	0,03
136.000	GBP	UK Treasury, 0.50%, 22/10/2061	43	0,05
140.000	GBP	UK Treasury, 4.00%, 22/10/2063	140	0,15
107.000	GBP	UK Treasury, 3.50%, 22/07/2068	96	0,10
100.000	GBP	UK Treasury, 1.13%, 22/10/2073 ¹	39	0,04
Regno Unito - Totale			8.413	8,96
Stati Uniti (31 marzo 2023: 11,58%)				
682.000	USD	US Treasury, 2.25%, 15/11/2024	622	0,66
523.000	USD	US Treasury, 2.88%, 15/06/2025	476	0,51
420.000	USD	US Treasury, 3.00%, 15/07/2025	382	0,41
613.000	USD	US Treasury, 2.25%, 15/11/2025	547	0,58
130.000	USD	US Treasury, 1.63%, 15/02/2026	114	0,12
119.000	USD	US Treasury, 0.88%, 30/09/2026	100	0,11
299.000	USD	US Treasury, 1.63%, 30/09/2026	258	0,27
789.000	USD	US Treasury, 1.25%, 30/11/2026	669	0,71
110.000	USD	US Treasury, 2.25%, 15/02/2027	96	0,10
384.000	USD	US Treasury, 1.13%, 28/02/2027	322	0,34
420.000	USD	US Treasury, 2.50%, 31/03/2027	369	0,39
160.000	USD	US Treasury, 3.13%, 31/08/2027	143	0,15
433.000	USD	US Treasury, 1.25%, 31/03/2028	353	0,38
90.000	USD	US Treasury, 4.00%, 30/06/2028	83	0,09
220.000	USD	US Treasury, 3.13%, 15/11/2028	194	0,21
260.000	USD	US Treasury, 1.38%, 31/12/2028	209	0,22
282.000	USD	US Treasury, 2.63%, 15/02/2029	241	0,26
650.000	USD	US Treasury, 1.88%, 28/02/2029	533	0,57
250.000	USD	US Treasury, 2.88%, 30/04/2029	216	0,23
120.000	USD	US Treasury, 3.88%, 31/12/2029	109	0,12
303.000	USD	US Treasury, 0.63%, 15/08/2030	220	0,23
275.000	USD	US Treasury, 0.88%, 15/11/2030	202	0,21
47.000	USD	US Treasury, 5.38%, 15/02/2031	47	0,05
160.000	USD	US Treasury, 1.38%, 15/11/2031	118	0,13

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBLIGAZIONI (continua)				
Titoli di Stato (continua)				
Stati Uniti (continua)				
440.000	USD	US Treasury, 1.88%, 15/02/2032	338	0,36
130.000	USD	US Treasury, 3.50%, 15/02/2033	113	0,12
130.000	USD	US Treasury, 3.38%, 15/05/2033	111	0,12
90.000	USD	US Treasury, 3.88%, 15/08/2033	80	0,08
90.000	USD	US Treasury, 3.50%, 15/02/2039	73	0,08
517.500	USD	US Treasury, 1.88%, 15/02/2041	315	0,34
43.000	USD	US Treasury, 4.75%, 15/02/2041	40	0,04
12.000	USD	US Treasury, 4.38%, 15/05/2041	11	0,01
128.000	USD	US Treasury, 3.13%, 15/11/2041	95	0,10
90.000	USD	US Treasury, 4.00%, 15/11/2042	75	0,08
160.000	USD	US Treasury, 3.38%, 15/05/2044	121	0,13
269.000	USD	US Treasury, 3.00%, 15/05/2045	189	0,20
70.000	USD	US Treasury, 2.88%, 15/11/2046	47	0,05
150.000	USD	US Treasury, 3.00%, 15/02/2047	104	0,11
70.000	USD	US Treasury, 3.00%, 15/05/2047	48	0,05
247.000	USD	US Treasury, 1.25%, 15/05/2050	110	0,12
398.000	USD	US Treasury, 1.38%, 15/08/2050	184	0,19
275.000	USD	US Treasury, 2.00%, 15/08/2051	150	0,16
120.000	USD	US Treasury, 1.88%, 15/11/2051	63	0,07
140.000	USD	US Treasury, 3.63%, 15/02/2053	109	0,12
Stati Uniti - Totale			8.999	9,58
Totale investimenti in titoli di Stato			91.848	97,77
Totale investimenti in obbligazioni			91.848	97,77

Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Contratti di cambio a termine²				
Buy CAD 30,000; Sell USD 22,184 ³	Morgan Stanley	03/10/2023	–	–
Buy CNY 1,460,000; Sell USD 200,252 ³	J.P. Morgan	10/10/2023	–	–
Buy SEK 180,000; Sell USD 16,462 ³	Morgan Stanley	03/10/2023	–	–
Buy USD 3,115,854; Sell AUD 4,800,000	RBC	03/10/2023	17	0,02
Buy USD 3,115,269; Sell AUD 4,802,782	Citibank	03/10/2023	15	0,02
Buy USD 25,927; Sell AUD 40,000 ³	Toronto-Dominion Bank	03/10/2023	–	–
Buy USD 3,437,347; Sell AUD 5,295,000	Credit Lyonnais	02/11/2023	57	0,06
Buy USD 3,438,752; Sell AUD 5,297,782	Morgan Stanley	02/11/2023	57	0,06
Buy USD 2,559,200; Sell CAD 3,440,000	BNP Paribas	02/11/2023	39	0,04
Buy USD 2,555,898; Sell CAD 3,436,000	State Street	02/11/2023	39	0,04
Buy USD 1,424,603; Sell CHF 1,252,000	J.P. Morgan	03/10/2023	53	0,06
Buy USD 1,379,127; Sell CHF 1,252,000	Morgan Stanley	02/11/2023	12	0,01
Buy USD 36,403; Sell CLP 32,462,000 ³	UBS	20/12/2023	–	–
Buy USD 12,095,630; Sell CNY 87,861,000	J.P. Morgan	10/10/2023	32	0,04
Buy USD 841,897; Sell CZK 18,685,000	UBS	03/10/2023	28	0,03
Buy USD 813,047; Sell CZK 18,685,000	Standard Chartered	02/11/2023	11	0,01
Buy USD 1,126,106; Sell DKK 7,706,000	Morgan Stanley	03/10/2023	30	0,03
Buy USD 1,098,610; Sell DKK 7,706,000	Toronto-Dominion Bank	02/11/2023	11	0,01
Buy USD 315,176; Sell EUR 290,000	Morgan Stanley	03/10/2023	8	0,01
Buy USD 149,324; Sell EUR 140,000	Barclays	03/10/2023	1	–
Buy USD 1,017,646; Sell EUR 960,000	BNP Paribas	02/11/2023	8	0,01
Buy USD 4,774,820; Sell GBP 3,755,000	BNY Mellon	03/10/2023	181	0,19
Buy USD 4,769,505; Sell GBP 3,751,000	Citibank	03/10/2023	181	0,19
Buy USD 50,730; Sell GBP 40,000	Morgan Stanley	03/10/2023	2	–
Buy USD 4,571,842; Sell GBP 3,735,000	BNY Mellon	02/11/2023	42	0,05
Buy USD 4,566,638; Sell GBP 3,731,000	State Street	02/11/2023	41	0,04
Buy USD 96,358; Sell HKD 754,000 ³	State Street	02/11/2023	–	–

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Contratti di cambio a termine²(continua)				
Buy USD 20,959; Sell HUF 7,371,000	J.P. Morgan	03/10/2023	1	–
Buy USD 19,880; Sell HUF 7,371,000 ³	Toronto-Dominion Bank	02/11/2023	–	–
Buy USD 2,254,782; Sell IDR 34,715,748,000	Deutsche Bank	20/12/2023	14	0,02
Buy USD 902,079; Sell ILS 3,425,000	Bank of America	03/10/2023	2	–
Buy USD 145,039; Sell ILS 550,000	Barclays	03/10/2023	1	–
Buy USD 1,042,139; Sell ILS 3,975,000	Toronto-Dominion Bank	02/11/2023	6	0,01
Buy USD 4,476,033; Sell JPY 649,690,000	State Street	03/10/2023	116	0,12
Buy USD 4,474,433; Sell JPY 649,695,000	J.P. Morgan	03/10/2023	114	0,12
Buy USD 40,959; Sell JPY 6,020,000	Standard Chartered	03/10/2023	1	–
Buy USD 4,365,689; Sell JPY 647,135,000	BNP Paribas	02/11/2023	24	0,03
Buy USD 4,365,364; Sell JPY 647,130,000	Nomura	02/11/2023	23	0,03
Buy USD 8,239,416; Sell KRW 10,883,279,812	Citibank	20/12/2023	112	0,12
Buy USD 75,319; Sell MXN 1,267,000	BNY Mellon	03/10/2023	2	–
Buy USD 30,967; Sell MXN 530,000 ³	Morgan Stanley	03/10/2023	–	–
Buy USD 71,654; Sell MXN 1,257,000	Citibank	03/11/2023	1	–
Buy USD 2,024,065; Sell MYR 9,420,000	Morgan Stanley	20/12/2023	2	–
Buy USD 621,818; Sell NOK 6,589,000	Toronto-Dominion Bank	02/11/2023	12	0,01
Buy USD 1,097,138; Sell NZD 1,819,000	Citibank	02/11/2023	13	0,01
Buy USD 44,727; Sell PLN 184,000	Barclays	03/10/2023	2	–
Buy USD 42,085; Sell PLN 184,000 ³	Nomura	02/11/2023	–	–
Buy USD 499,568; Sell RON 2,271,000	J.P. Morgan	03/10/2023	15	0,02
Buy USD 484,304; Sell RON 2,271,000	Citibank	02/11/2023	5	0,01
Buy USD 761,899; Sell SEK 8,241,000	Societe Generale	02/11/2023	13	0,01
Buy USD 1,664,645; Sell SGD 2,247,000	Bank of America	03/10/2023	17	0,02
Buy USD 95,691; Sell SGD 130,000 ³	State Street	03/10/2023	–	–
Buy USD 1,747,544; Sell SGD 2,377,000	Societe Generale	02/11/2023	14	0,02
Buy USD 1,709,662; Sell THB 59,692,000	UBS	03/10/2023	66	0,07
Buy USD 1,642,480; Sell THB 59,692,000	Credit Lyonnais	02/11/2023	21	0,02
Totale utili non realizzati su contratti di cambio a termine (31 marzo 2023: 1,43%)			1.462	1,56

Contratti di cambio a termine²

Buy AUD 210,000; Sell USD 135,672	BNP Paribas	02/11/2023	(2)	–
Buy CAD 170,000; Sell USD 125,793	BNP Paribas	02/11/2023	(1)	–
Buy CHF 30,000; Sell USD 32,899 ³	BNP Paribas	02/11/2023	–	–
Buy CZK 460,000; Sell USD 19,973 ³	BNP Paribas	02/11/2023	–	–
Buy DKK 330,000; Sell USD 46,927	BNP Paribas	02/11/2023	(1)	–
Buy EUR 230,000; Sell USD 247,045	BNP Paribas	03/10/2023	(3)	(0,01)
Buy EUR 240,000; Sell USD 260,777	Toronto-Dominion Bank	03/10/2023	(6)	(0,01)
Buy EUR 35,463,658; Sell USD 38,669,324	HSBC	03/10/2023	(1.060)	(1,13)
Buy EUR 35,465,000; Sell USD 38,674,015	Standard Chartered	03/10/2023	(1.063)	(1,13)
Buy EUR 140,000; Sell USD 148,407	Deutsche Bank	02/11/2023	(1)	–
Buy EUR 35,483,658; Sell USD 37,632,027	Credit Lyonnais	02/11/2023	(320)	(0,34)
Buy EUR 35,485,000; Sell USD 37,644,773	Societe Generale	02/11/2023	(331)	(0,35)
Buy GBP 80,000; Sell USD 101,386	Morgan Stanley	03/10/2023	(4)	(0,01)
Buy GBP 140,000; Sell USD 170,911	BNP Paribas	02/11/2023	(1)	–
Buy IDR 450,350,000; Sell USD 29,070 ³	J.P. Morgan	20/12/2023	–	–
Buy ILS 80,000; Sell USD 21,043 ³	BNP Paribas	02/11/2023	–	–
Buy JPY 11,140,000; Sell USD 76,864	Morgan Stanley	03/10/2023	(2)	–
Buy JPY 7,630,000; Sell USD 51,377 ³	BNP Paribas	02/11/2023	–	–
Buy KRW 56,740,000; Sell USD 42,514 ³	Bank of America	20/12/2023	–	–
Buy MXN 540,000; Sell USD 31,929	Morgan Stanley	03/10/2023	(1)	–
Buy MXN 530,000; Sell USD 30,342 ³	BNP Paribas	03/11/2023	–	–
Buy NOK 190,000; Sell USD 17,871 ³	BNP Paribas	02/11/2023	–	–
Buy NZD 30,000; Sell USD 18,026 ³	BNP Paribas	02/11/2023	–	–
Buy SGD 50,000; Sell USD 36,682 ³	BNP Paribas	02/11/2023	–	–
Buy THB 1,800,000; Sell USD 49,440	Barclays	02/11/2023	(1)	–
Buy USD 607,254; Sell AUD 950,000	RBC	03/10/2023	(6)	(0,01)
Buy USD 2,471,783; Sell CAD 3,345,000	Credit Lyonnais	03/10/2023	(2)	–
Buy USD 2,630,389; Sell CAD 3,561,000	Morgan Stanley	03/10/2023	(4)	–
Buy USD 11,996,885; Sell CNY 87,501,000	J.P. Morgan	02/11/2023	(24)	(0,03)
Buy USD 96,259; Sell HKD 754,000 ³	J.P. Morgan	04/10/2023	–	–

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Contratti di cambio a termine²(continua)				
Buy USD 618,329; Sell NOK 6,589,000	BNP Paribas	03/10/2023	(1)	–
Buy USD 1,081,026; Sell NZD 1,819,000	BNY Mellon	03/10/2023	(11)	(0,01)
Buy USD 771,946; Sell SEK 8,421,000	J.P. Morgan	03/10/2023	(3)	–
Totale perdite non realizzate su contratti di cambio a termine (31 marzo 2023: (0,70)%			(2.848)	(3,03)

	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico	93.310	99,33
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico	(2.848)	(3,03)
Liquidità	2.072	2,21
Altre attività e passività	1.406	1,49
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	93.940	100,00

	% del totale attività
Analisi del totale attività	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	91,33
Valori mobiliari negoziati su un altro mercato regolamentato	3,42
Strumenti finanziari derivati OTC	1,51
Altre attività	3,74
Totale attività	100,00

¹ Titolo parzialmente o completamente in prestito.

² I contratti di cambio a termine sottoscritti con una controparte che ha la stessa divisa di acquisto, divisa di vendita e data di scadenza saranno presentati su base aggregata. Non esiste alcuna compensazione di posizioni attive e passive.

³ Gli investimenti inferiori a EUR 500 sono stati arrotondati a zero.

Valore dell'esposizione	Sui guadagni Migliaia di EUR	Sulle perdite Migliaia di EUR
Contratti di cambio a termine	187.316	185.034

BLACKROCK DIVERSIFYING FIXED INCOME FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Parteci- pazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO				
Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2023: 56,09%)				
Irlanda (31 marzo 2023: 56,09%)				
118.138	EUR	BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe Z EUR Hedged Accumulating ¹	12.010	18,09
539.348	EUR	iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni Flexible Euro Hedged Accumulating ¹	4.783	7,20
1.165.994	EUR	iShares ESG Screened Euro Corporate Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni Flexible Euro Accumulating ¹	10.756	16,20
1.140.474	EUR	iShares ESG Screened Global Corporate Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni D EUR Hedged Accumulating ¹	9.717	14,63
Irlanda - Totale			37.266	56,12
Totale investimenti in organismi di investimento collettivo			37.266	56,12
Totale investimenti in organismi di investimento collettivo			37.266	56,12
ETF (31 marzo 2023: 43,69%)				
Irlanda (31 marzo 2023: 43,69%)				
643.467	EUR	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) ¹	3.187	4,80
102.772	EUR	iShares € High Yield Corp Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) ¹	9.159	13,79
30.011	EUR	iShares € Inflation Linked Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc) ¹	6.500	9,79
2.248.432	EUR	iShares J.P. Morgan \$ EM Corp Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) ¹	9.804	14,76
Irlanda - Totale			28.650	43,14
Totale investimenti in ETF			28.650	43,14
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico			65.916	99,26
Liquidità			10	0,02
Strumenti liquidi equivalenti				
Parteci- pazione	Valuta	Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2023: 0,20%)		
5.401	EUR	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0) ¹	544	0,82
Totale in strumenti liquidi equivalenti			544	0,82
Altre attività e passività			(66)	(0,10)
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili			66.404	100,00
Analisi del totale attività				% del totale attività
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale				43,09
Organismi di investimento collettivo				56,86
Altre attività				0,05
Totale attività				100,00

¹Una parte correlata al Fondo.

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
Azioni (31 marzo 2023: 90,91%)				
59.515	ZAR	Australia (31 marzo 2023: 0,43%) BHP Group Ltd. ¹	1.710	0,73
		Australia - Totale	1.710	0,73
46.967	USD	Bermuda (31 marzo 2023: 0,22%) Genpact Ltd.	1.700	0,73
		Bermuda - Totale	1.700	0,73
546.814	USD	Brasile (31 marzo 2023: 1,52%) Ambev SA ADR ¹	1.408	0,60
46.456	USD	Vale SA ADR	623	0,27
		Brasile - Totale	2.031	0,87
270.000	HKD	Isole Cayman (31 marzo 2023: 18,28%) 3SBio, Inc.	226	0,10
734.956	HKD	Alibaba Group Holding Ltd.	8.035	3,45
135.800	HKD	ANTA Sports Products Ltd.	1.528	0,66
102.602	HKD	Baidu, Inc. 'A'	1.747	0,75
436.000	HKD	Bosideng International Holdings Ltd.	187	0,08
1.086.000	HKD	China Lesso Group Holdings Ltd.	579	0,25
118.000	HKD	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	396	0,17
52.000	HKD	China Resources Land Ltd., REIT	207	0,09
63.000	HKD	ENN Energy Holdings Ltd.	523	0,22
566.000	HKD	Geely Automobile Holdings Ltd.	667	0,29
312.000	TWD	Gourmet Master Co. Ltd.	1.022	0,44
284.000	HKD	Greentown Service Group Co. Ltd., REIT	128	0,06
202.085	HKD	JD.com, Inc. 'A'	2.969	1,28
7.275	USD	KE Holdings, Inc., REIT ADR	113	0,05
43.500	HKD	Kuaishou Technology	349	0,15
264.480	HKD	Meituan 'B'	3.872	1,66
143.055	HKD	NetEase, Inc.	2.911	1,25
3.248	USD	PDD Holdings, Inc. ADR	319	0,14
966.000	HKD	Sino Biopharmaceutical Ltd.	348	0,15
280.000	HKD	Tencent Holdings Ltd.	10.951	4,70
28.842	HKD	Trip.com Group Ltd.	1.029	0,44
2.536.000	HKD	Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co. Ltd. ¹	1.072	0,46
1.635.400	HKD	Xiaomi Corp. 'B'	2.575	1,11
72.753	USD	XP, Inc. 'A'	1.677	0,72
70.000	HKD	Zhongsheng Group Holdings Ltd.	197	0,08
49.297	USD	ZTO Express Cayman, Inc. ADR	1.192	0,51
		Isole Cayman - Totale	44.819	19,26
2.031.248	CLP	Cile (31 marzo 2023: 0,00%) Banco de Chile	205	0,09
5.780.309	CLP	Banco Santander Chile	268	0,11
864.261	CLP	Cencosud SA	1.629	0,70
986.988	CLP	Enel Americas SA	111	0,05
49.061.941	CLP	Latam Airlines Group SA	446	0,19
5.031	CLP	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, Preference, Preference 'B'	297	0,13
		Cile - Totale	2.956	1,27
3.377.600	CNY	Cina (31 marzo 2023: 12,33%) BOE Technology Group Co. Ltd. 'A'	1.792	0,77
52.400	CNY	BYD Co. Ltd. 'A'	1.702	0,73
100	CNY	China Construction Bank Corp. 'A' ²	–	–
2.426.000	HKD	China Construction Bank Corp. 'H'	1.371	0,59

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
Azioni (continua)				
Cina (continua)				
534.000	HKD	China Life Insurance Co. Ltd. 'H'	832	0,36
714.000	HKD	China Longyuan Power Group Corp. Ltd. 'H'	621	0,27
510.000	HKD	China Merchants Bank Co. Ltd. 'H'	2.131	0,92
161.000	HKD	China Pacific Insurance Group Co. Ltd. 'H'	403	0,17
2.654.000	HKD	China Petroleum & Chemical Corp. 'H'	1.452	0,62
452.300	HKD	China Vanke Co. Ltd., REIT 'H'	499	0,22
82.700	CNY	Dong-E-E-Jiao Co. Ltd. 'A'	557	0,24
356.100	CNY	Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai 'A'	1.774	0,76
156.000	HKD	Guangzhou Automobile Group Co. Ltd. 'H'	77	0,03
55.100	CNY	Huayu Automotive Systems Co. Ltd. 'A'	142	0,06
4.219.000	HKD	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 'H'	2.033	0,87
4.300	CNY	Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'	1.062	0,46
106.000	HKD	Nongfu Spring Co. Ltd. 'H'	610	0,26
3.062.100	HKD	PetroChina Co. Ltd. 'H'	2.309	0,99
334.000	HKD	PICC Property & Casualty Co. Ltd. 'H'	428	0,18
528.500	HKD	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H'	3.025	1,30
885.100	CNY	SAIC Motor Corp. Ltd. 'A'	1.798	0,77
1.297.700	CNY	Shanghai Construction Group Co. Ltd. 'A'	491	0,21
125.469	CNY	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co. Ltd. 'A'	502	0,22
2.458.600	CNY	TCL Technology Group Corp. 'A'	1.378	0,59
62.000	HKD	Tsingtao Brewery Co. Ltd. 'H'	507	0,22
511.300	CNY	Weichai Power Co. Ltd. 'A'	880	0,38
122.000	HKD	Weichai Power Co. Ltd. 'H'	166	0,07
188.300	CNY	Yutong Bus Co. Ltd. 'A'	342	0,15
363.600	CNY	ZTE Corp. 'A'	1.631	0,70
		Cina - Totale	30.515	13,11
Grecia (31 marzo 2023: 0,97%)				
16.789	EUR	Hellenic Telecommunications Organization SA	245	0,11
35.814	EUR	OPAP SA	607	0,26
		Grecia - Totale	852	0,37
Hong Kong (31 marzo 2023: 1,83%)				
178.000	HKD	China Resources Beer Holdings Co. Ltd.	977	0,42
678.000	HKD	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	497	0,21
413.500	HKD	Sun Art Retail Group Ltd.	88	0,04
		Hong Kong - Totale	1.562	0,67
Ungheria (31 marzo 2023: 0,00%)				
9.430	HUF	OTP Bank Nyrt.	344	0,15
		Ungheria - Totale	344	0,15
India (31 marzo 2023: 12,32%)				
141.646	INR	Axis Bank Ltd.	1.771	0,76
27.836	INR	Bajaj Finance Ltd.	2.616	1,12
281.985	INR	Birlasoft Ltd.	1.643	0,71
57.084	INR	Chambal Fertilisers and Chemicals Ltd.	191	0,08
13.226	INR	Dr Reddy's Laboratories Ltd.	891	0,38
2.758	USD	Dr Reddy's Laboratories Ltd. ADR	184	0,08
80.253	INR	Firstsource Solutions Ltd.	161	0,07
102.758	INR	HDFC Bank Ltd.	1.888	0,81
27.252	USD	HDFC Bank Ltd. ADR	1.608	0,69
332.441	INR	ICICI Bank Ltd.	3.815	1,64
34.986	INR	IndusInd Bank Ltd.	602	0,26
50.901	INR	Infosys Ltd.	876	0,38
80.467	INR	Jindal Saw Ltd.	336	0,14

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
Azioni (continua)				
India (continua)				
86.845	INR	Kotak Mahindra Bank Ltd.	1.816	0,78
5.687	INR	L&T Technology Services Ltd.	314	0,13
71.137	INR	Larsen & Toubro Ltd.	2.592	1,11
54.996	INR	NCC Ltd.	103	0,04
12.250	INR	Polycab India Ltd.	788	0,34
74.680	INR	Reliance Industries Ltd.	2.107	0,90
1.030	INR	Shree Cement Ltd.	316	0,14
76.158	INR	Syngene International Ltd.	736	0,32
48.736	INR	Tata Consultancy Services Ltd.	2.070	0,89
259.745	INR	Triveni Turbine Ltd.	1.372	0,59
3.456	INR	UltraTech Cement Ltd.	344	0,15
14.103	INR	Zensar Technologies Ltd.	88	0,04
230.817	INR	Zydus Lifesciences Ltd.	1.714	0,74
		India - Totale	30.942	13,29
Indonesia (31 marzo 2023: 3,69%)				
2.909.000	IDR	Bank Central Asia Tbk. PT	1.663	0,72
507.200	IDR	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk. PT	172	0,07
12.582.600	IDR	Perusahaan Gas Negara Tbk. PT	1.122	0,48
		Indonesia - Totale	2.957	1,27
Kuwait (31 marzo 2023: 0,43%)				
47.926	KWD	Boubyan Bank KSCP	94	0,04
215.355	KWD	Kuwait Finance House KSCP	511	0,22
		Kuwait - Totale	605	0,26
Lussemburgo (31 marzo 2023: 0,00%)				
34.085	PLN	Allegro.eu SA ¹	252	0,11
		Lussemburgo - Totale	252	0,11
Malesia (31 marzo 2023: 0,13%)				
1.078.200	MYR	CIMB Group Holdings Bhd.	1.248	0,54
270.700	MYR	IHH Healthcare Bhd.	340	0,15
133.300	MYR	IOI Corp. Bhd.	113	0,05
749.800	MYR	Malayan Banking Bhd.	1.407	0,60
59.000	MYR	Petronas Dagangan Bhd.	281	0,12
2.488.100	MYR	Public Bank Bhd.	2.157	0,93
133.000	MYR	QL Resources Bhd.	154	0,06
258.300	MYR	YTL Power International Bhd.	112	0,05
		Malesia - Totale	5.812	2,50
Messico (31 marzo 2023: 1,27%)				
124.655	MXN	Alsea SAB de CV	456	0,19
145.852	MXN	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	552	0,24
		Messico - Totale	1.008	0,43
Filippine (31 marzo 2023: 0,11%)				
12	PHP	ACEN Corp. ²	-	-
5	PHP	Ayala Corp., REIT ²	-	-
		Filippine - Totale	-	-
Polonia (31 marzo 2023: 0,27%)				
6.811	PLN	Dino Polska SA	554	0,24
7.232	PLN	Jastrzebska Spolka Weglowa SA	73	0,03

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
Azioni (continua)				
Polonia (continua)				
26.490	PLN	KGHM Polska Miedz SA	679	0,29
41.589	PLN	ORLEN SA	559	0,24
72.363	PLN	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	575	0,25
204.411	PLN	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	1.937	0,83
2.516	PLN	Santander Bank Polska SA	208	0,09
		Polonia - Totale	4.585	1,97
Qatar (31 marzo 2023: 0,90%)				
97.439	QAR	Industries Qatar QSC	369	0,16
384.169	QAR	Masraf Al Rayan QSC	233	0,10
41.143	QAR	Ooredoo QPSC	119	0,05
26.087	QAR	Qatar Electricity & Water Co. QSC	127	0,05
60.096	QAR	Qatar Islamic Bank SAQ	305	0,13
230.261	QAR	Qatar National Bank QPSC	974	0,42
		Qatar - Totale	2.127	0,91
Russia (31 marzo 2023: 0,00%)³				
2.082.843	RUB	Alrosa PJSC ^{2/4}	-	-
59.018	RUB	LUKOIL PJSC ^{2/4}	-	-
3.024	RUB	MMC Norilsk Nickel PJSC ^{2/4}	-	-
43.498	RUB	Mobile TeleSystems PJSC ^{2/4}	-	-
43.510	RUB	Novatek PJSC ^{2/4}	-	-
13.465	RUB	Severstal PAO ^{2/4}	-	-
121.387	RUB	Tatneft PJSC ^{2/4}	-	-
		Russia - Totale	-	-
Arabia Saudita (31 marzo 2023: 2,98%)				
110.344	SAR	Al Rajhi Bank	2.002	0,86
1	SAR	Aldrees Petroleum and Transport Services Co. ²	-	-
1	SAR	Arabian Centres Co. Ltd., REIT ²	-	-
1	SAR	Bank Al-Jazira ²	-	-
81.574	SAR	Saudi Arabian Mining Co.	878	0,38
101.510	SAR	Saudi Basic Industries Corp.	2.239	0,96
127.270	SAR	Saudi Telecom Co.	1.279	0,55
		Totale Arabia Saudita	6.398	2,75
Sudafrica (31 marzo 2023: 1,89%)				
3.272	ZAR	Anglo American Platinum Ltd.	123	0,05
132.318	ZAR	FirstRand Ltd.	449	0,19
33.044	ZAR	Northam Platinum Holdings Ltd.	201	0,09
1	ZAR	Pepkor Holdings Ltd. ²	-	-
72.969	ZAR	Standard Bank Group Ltd.	711	0,30
43.670	ZAR	Truworths International Ltd.	177	0,08
		Sudafrica - Totale	1.661	0,71
Corea del Sud (31 marzo 2023: 9,44%)				
1.237	KRW	AfreecaTV Co. Ltd.	77	0,03
14.449	KRW	AMOREPACIFIC Group	326	0,14
65.202	KRW	Cheil Worldwide, Inc.	970	0,42
11.706	KRW	CJ Logistics Corp.	703	0,30
2.724	KRW	Com2uSCorp	90	0,04
483	KRW	Ecopro BM Co. Ltd. ¹	91	0,04
291	KRW	Ecopro Co. Ltd. ¹	194	0,08
18.260	KRW	GS Retail Co. Ltd.	320	0,14
19.248	KRW	HL Mando Co. Ltd.	599	0,26

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
Azioni (continua)				
Corea del Sud (continua)				
6.725	KRW	Hugel, Inc. ¹	624	0,27
2.972	KRW	Hyundai Mobis Co. Ltd.	530	0,23
7.638	KRW	Hyundai Motor Co.	1.082	0,46
5.022	KRW	Hyundai Steel Co.	141	0,06
5.358	KRW	Hyundai Wia Corp.	253	0,11
10.285	KRW	KB Financial Group, Inc.	422	0,18
5.420	KRW	KCC Corp. ¹	991	0,43
25.730	KRW	Kia Corp.	1.553	0,67
15.153	KRW	Korean Air Lines Co. Ltd.	244	0,10
5.058	KRW	KT Corp.	124	0,05
1.178	KRW	LG Chem Ltd.	434	0,19
272	KRW	LG Energy Solution Ltd.	96	0,04
349	KRW	LG H&H Co. Ltd.	115	0,05
3.195	KRW	Lotte Shopping Co. Ltd.	169	0,07
8.955	KRW	LX International Corp.	190	0,08
3.229	KRW	NAVER Corp.	483	0,21
2.400	KRW	POSCO Holdings, Inc.	951	0,41
900	KRW	Samsung C&T Corp.	72	0,03
178.130	KRW	Samsung Electronics Co. Ltd.	9.036	3,88
2.390	USD	Samsung Electronics Co. Ltd. GDR	3.015	1,29
1.507	KRW	Samsung SDI Co. Ltd.	572	0,25
9.792	KRW	SeAH Besteel Holdings Corp.	179	0,08
12.139	KRW	Seegene, Inc. ¹	192	0,08
12.013	KRW	SK Hynix, Inc.	1.022	0,44
1.429	KRW	S-Oil Corp.	84	0,04
		Corea del Sud - Totale	25.944	11,15
Taiwan (31 marzo 2023: 15,98%)				
23.000	TWD	Accton Technology Corp.	351	0,15
144.000	TWD	Alpha Networks, Inc.	176	0,08
13.000	TWD	ASMedia Technology, Inc.	467	0,20
45.000	TWD	Asustek Computer, Inc.	511	0,22
393.000	TWD	Cathay Financial Holding Co. Ltd.	542	0,23
419.000	TWD	Chunghwa Telecom Co. Ltd.	1.509	0,65
17.802	USD	Chunghwa Telecom Co. Ltd. ADR	640	0,27
100.000	TWD	Compal Electronics, Inc.	95	0,04
362.000	TWD	CTBC Financial Holding Co. Ltd.	275	0,12
138.000	TWD	E.Sun Financial Holding Co. Ltd.	103	0,04
392.000	TWD	Elan Microelectronics Corp.	1.618	0,70
22.000	TWD	Elite Material Co. Ltd.	292	0,13
4.000	TWD	eMemory Technology, Inc.	250	0,11
54.000	TWD	FLEXium Interconnect, Inc.	147	0,06
330.000	TWD	Getac Holdings Corp.	794	0,34
35.000	TWD	Global Mixed Mode Technology, Inc.	283	0,12
42.000	TWD	Hiwin Technologies Corp.	264	0,11
920.000	TWD	Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	2.957	1,27
1.352	USD	Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. GDR	9	-
127.000	TWD	Makalot Industrial Co. Ltd.	1.321	0,57
129.000	TWD	MediaTek, Inc.	2.939	1,26
73.000	TWD	Novatek Microelectronics Corp.	957	0,41
33.000	TWD	PharmaEngine, Inc.	89	0,04
125.000	TWD	Phison Electronics Corp.	1.769	0,76
137.000	TWD	Powertech Technology, Inc.	432	0,19
91.910	TWD	Poya International Co. Ltd.	1.376	0,59
136.000	TWD	President Chain Store Corp.	1.108	0,48
782.000	TWD	Primax Electronics Ltd.	1.679	0,72
91.000	TWD	Quanta Computer, Inc.	676	0,29
46.000	TWD	Realtek Semiconductor Corp.	563	0,24
808.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	13.078	5,62

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
Azioni (continua)				
Taiwan (continua)				
40.000	TWD	Tong Yang Industry Co. Ltd.	97	0,04
37.000	TWD	Tripod Technology Corp.	221	0,09
29.000	TWD	Visual Photonics Epitaxy Co. Ltd.	133	0,06
56.000	TWD	Wistron Corp.	176	0,08
		Taiwan - Totale	37.897	16,28
Tailandia (31 marzo 2023: 2,51%)				
614.100	THB	Bangchak Corp. PCL NVDR	694	0,30
2.611.400	THB	Bangkok Dusit Medical Services PCL NVDR	1.909	0,82
427.100	THB	PTT Exploration & Production PCL NVDR	2.009	0,86
1.668.100	THB	WHA Corp. PCL, REIT NVDR	239	0,10
		Tailandia - Totale	4.851	2,08
Turchia (31 marzo 2023: 0,60%)				
77.819	TRY	Arcelik A/S	463	0,20
95.852	TRY	Migros Ticaret A/S	1.278	0,55
		Turchia - Totale	1.741	0,75
Emirati Arabi Uniti (31 marzo 2023: 1,69%)				
187.722	AED	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	442	0,19
245.952	AED	Aldar Properties PJSC, REIT	388	0,17
804.493	AED	Dubai Islamic Bank PJSC	1.284	0,55
72.672	AED	Emaar Development PJSC, REIT	139	0,06
301.791	AED	Emaar Properties PJSC, REIT	661	0,28
182.733	AED	Emirates Telecommunications Group Co. PJSC	1.020	0,44
154.731	AED	First Abu Dhabi Bank PJSC	574	0,25
		Emirati Arabi Uniti - Totale	4.508	1,94
Regno Unito (31 marzo 2023: 0,58%)				
130.704	GBP	Hochschild Mining plc	133	0,06
		Regno Unito - Totale	133	0,06
Stati Uniti (31 marzo 2023: 0,54%)				
3.079	USD	Southern Copper Corp.	232	0,10
		Stati Uniti - Totale	232	0,10
Totale investimenti in azioni			218.142	93,72

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto	
OBBLIGAZIONI					
Titoli di Stato (31 marzo 2023: 7,79%)					
		Stati Uniti (31 marzo 2023: 7,79%)			
10.261.700	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 03/10/2023 ⁵	10.260	4,41	
		Stati Uniti - Totale	10.260	4,41	
Totale investimenti in titoli di Stato			10.260	4,41	
Totale investimenti in obbligazioni			10.260	4,41	
Partecipazione	Valuta	Controparte	Descrizione	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
Contratti per differenze					
Brasile (31 marzo 2023: 0,09%)					
132.793	USD	HSBC	Azul SA, Preference	7	-
1	USD	HSBC	Klabin SA ²	-	-
134.182	USD	HSBC	Petroleo Brasileiro SA, Preference	27	0,01
18.794	USD	HSBC	Telefonica Brasil SA	4	-
148.620	USD	HSBC	Vale SA	12	0,01
		Brasile - Totale		50	0,02
Cina (31 marzo 2023: 0,05%)					
				-	-
Arabia Saudita (31 marzo 2023: 0,00%)					
115.840	USD	Goldman Sachs	Saudi Arabian Oil Co.	28	0,01
		Totale Arabia Saudita		28	0,01
Corea del Sud (31 marzo 2023: 0,00%)					
(2.390)	USD	Goldman Sachs	Samsung Electronics Co. Ltd. GDR	7	0,01
		Corea del Sud - Totale		7	0,01
Totale utili non realizzati su contratti per differenze (31 marzo 2023: 0,14%)			85	0,04	
Brasile (31 marzo 2023: (0,16)%					
108.284	USD	Merrill Lynch	Ambev SA	(16)	(0,01)
152.996	USD	HSBC	Ambev SA	(21)	(0,01)
36.034	USD	HSBC	Banco Bradesco SA, Preference ²	-	-
230.309	USD	Merrill Lynch	Braskem SA, Preference 'A'	(97)	(0,04)
141.450	USD	HSBC	Braskem SA, Preference 'A'	(107)	(0,05)
560.803	USD	HSBC	Cielo SA	(9)	-
1.898.246	USD	Merrill Lynch	Cielo SA	(66)	(0,03)
1.137.791	USD	Merrill Lynch	Cogna Educacao SA	(43)	(0,02)
1.875.557	USD	HSBC	Cogna Educacao SA	(68)	(0,03)
48.286	USD	Merrill Lynch	Gerdau SA, Preference	(24)	(0,01)
189.682	USD	Merrill Lynch	Minerva SA	(29)	(0,01)
49.857	USD	Merrill Lynch	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA, REIT	(14)	(0,01)
60.939	USD	Merrill Lynch	Odontoprev SA	(3)	-
180.609	USD	Merrill Lynch	Petroleo Brasileiro SA, Preference	(12)	(0,01)
14.845	USD	Merrill Lynch	Porto Seguro SA	(4)	-
49.323	USD	HSBC	Porto Seguro SA	(7)	-
278.001	USD	Merrill Lynch	Qualicorp Consultoria e Corretora de Seguros SA	(8)	-
49.509	USD	Merrill Lynch	Vale SA	(41)	(0,02)
23.109	USD	Merrill Lynch	WEG SA	(5)	-
		Brasile - Totale		(574)	(0,25)

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Controparte	Descrizione		Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto	
Contratti per differenze (continua)							
2.800	USD	Goldman Sachs	Cina (31 marzo 2023: (0,03)% BYD Co. Ltd. 'A' Cina - Totale		(3)	-	
						(577)	(0,25)
Totale perdite non realizzate su contratti per differenze (31 marzo 2023: (0,19)%							
Numero di contratti	Valuta	Importo	Descrizione	Data di scadenza	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto	
Contratti future							
Stati Uniti (31 marzo 2023: 0,08%)						-	-
Totale utili non realizzati su contratti future (31 marzo 2023: 0,08%)						-	-
Stati Uniti (31 marzo 2023: 0,00%)							
81	USD	4.050	MSCI Emerging Markets Index	15 dicembre 2023	(143)	(0,06)	
Stati Uniti - Totale						(143)	(0,06)
Totale perdite non realizzate su contratti future (31 marzo 2023: 0,00%)						(143)	(0,06)
					Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto	
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico					228.487	98,17	
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico					(720)	(0,31)	
Liquidità, liquidità a margine e garanzia liquida					4.770	2,05	
Altre attività e passività					219	0,09	
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili					232.756	100,00	

	% del totale attività
Analisi del totale attività	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	91,53
Valori mobiliari negoziati su un altro mercato regolamentato	4,31
Strumenti finanziari derivati OTC	0,04
Altre attività	4,12
Totale attività	100,00

¹ Titolo parzialmente o completamente in prestito.

² Gli investimenti inferiori a USD 500 sono stati arrotondati a zero.

³ Percentuale del valore patrimoniale netto dell'anno precedente arrotondata allo 0,00%.

⁴ Questi titoli sono stati valutati in consultazione con il Gestore. Questi titoli sono stati stimati in base al valore equo, valutati in termini di eventi societari o sospesi alla fine del periodo e stimati in base all'ultimo prezzo negoziato.

⁵ I tassi sono tassi di sconto o una serie di tassi di sconto a fine periodo.

Valore dell'esposizione	Sui guadagni Migliaia di USD	Sulle perdite Migliaia di USD
Contratti per differenze	85	577
Contratti future	-	3.870

BLACKROCK GLOBAL EQUITY SELECTION FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO				
Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2023: 68,40%)				
Irlanda (31 marzo 2023: 21,46%)				
20.212	EUR	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Classe X EUR Accumulating ¹	2.901	10,29
11.943	USD	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating ¹	1.698	6,02
12.539	USD	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating ¹	1.969	6,98
Irlanda - Totale			6.568	23,29
Lussemburgo (31 marzo 2023: 46,94%)				
67.857	EUR	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Class X2 EUR ¹	3.250	11,53
38.155	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR ¹	545	1,93
139.697	EUR	BlackRock Global Funds - European Special Situations Fund - Classe X2 EUR ¹	2.469	8,76
14.067	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund - Classe X2 USD ¹	278	0,99
49.914	USD	BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Opportunities Fund - Classe X2 USD ¹	538	1,91
4.458	EUR	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Classe X2 EUR ¹	803	2,85
4.266	USD	BlackRock Global Funds - US Basic Value Fund - Classe X2 USD ¹	597	2,12
7.933	EUR	BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Classe X2 EUR ¹	273	0,97
56.671	USD	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Classe X2 USD ¹	1.135	4,03
13.862	USD	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Classe X2 USD ¹	1.042	3,69
2.154	USD	BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Classe X2 USD ¹	174	0,62
21.965	USD	BlackRock Global Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 USD ¹	257	0,91
61.359	USD	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD ¹	1.405	4,98
Lussemburgo - Totale			12.766	45,29
Totale investimenti in organismi di investimento collettivo			19.334	68,58
Totale investimenti in organismi di investimento collettivo			19.334	68,58
Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
ETF (31 marzo 2023: 31,85%)				
Irlanda (31 marzo 2023: 31,85%)				
34.092	GBP	iShares Core FTSE 100 UCITS ETF - Classe di Azioni GBP (Acc) ^{1/2}	292	1,03
366.173	EUR	iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc) ¹	2.810	9,97
101.456	EUR	iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	583	2,07
235.152	EUR	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	1.104	3,92
101.824	EUR	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	572	2,03
7.448	EUR	iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) ¹	282	1,00
454.560	EUR	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	3.336	11,83
Irlanda - Totale			8.979	31,85
Totale investimenti in ETF			8.979	31,85

BLACKROCK GLOBAL EQUITY SELECTION FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico	28.313	100,43
Liquidità	24	0,08
Altre attività e passività	(145)	(0,51)
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	28.192	100,00

	% del totale attività
Analisi del totale attività	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	31,68
Organismi di investimento collettivo	68,20
Altre attività	0,12
Totale attività	100,00

¹Una parte correlata al Fondo.

²Titolo parzialmente o completamente in prestito.

BLACKROCK MULTI ASSET BALANCED SELECTION

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO				
Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2023: 65,29%)				
Irlanda (31 marzo 2023: 19,05%)				
14.760	EUR	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Classe X EUR Accumulating ¹	2.118	6,49
19.208	EUR	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating ¹	1.978	6,06
6.947	USD	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating ¹	988	3,03
5.211	USD	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating ¹	818	2,51
2.926	EUR	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating ¹	343	1,05
		Irlanda - Totale	6.245	19,14
Lussemburgo (31 marzo 2023: 46,24%)				
85.349	USD	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD Hedged ¹	822	2,52
45.003	EUR	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Class X2 EUR ¹	2.156	6,61
38.358	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR ¹	548	1,68
75.552	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 EUR ¹	498	1,53
76.757	EUR	BlackRock Global Funds - Global Inflation Linked Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged ¹	1.149	3,52
81.580	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe X2 USD ¹	828	2,54
32.246	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund - Classe X2 USD ¹	340	1,04
16.784	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund - Classe X2 USD ¹	332	1,02
58.240	USD	BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Opportunities Fund - Classe X2 USD ¹	628	1,92
3.547	EUR	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Classe X2 EUR ¹	639	1,96
3.554	USD	BlackRock Global Funds - US Basic Value Fund - Classe X2 USD ¹	497	1,52
153.316	USD	BlackRock Global Funds - US Dollar Bond Fund - Classe X2 USD ¹	1.478	4,53
4.230	EUR	BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Classe X2 EUR ¹	145	0,45
25.925	USD	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Classe X2 USD ¹	519	1,59
6.737	USD	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Classe X2 USD ¹	506	1,55
1.087	USD	BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Classe X2 USD ¹	88	0,27
11.850	USD	BlackRock Global Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 USD ¹	139	0,42
29.040	USD	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD ¹	665	2,04
2.200	USD	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Classe X2 USD ¹	329	1,01
24.202	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 EUR ¹	2.199	6,74
13.788	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR ¹	1.281	3,92
		Lussemburgo - Totale	15.786	48,38
Totale investimenti in organismi di investimento collettivo			22.031	67,52
Totale investimenti in organismi di investimento collettivo			22.031	67,52
Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
ETF (31 marzo 2023: 33,06%)				
Irlanda (31 marzo 2023: 33,06%)				
571.949	EUR	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) ¹	2.261	6,93
268.384	EUR	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) ¹	1.329	4,07

BLACKROCK MULTI ASSET BALANCED SELECTION FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
ETF (continua)				
Irlanda (31 marzo 2023: 33,06%) (continua)				
176.746	EUR	iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) ^{1/2}	836	2,56
47.905	EUR	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) ¹	148	0,45
4.169	USD	iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ^{1/2}	494	1,51
8.465	USD	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) ¹	1.347	4,13
60.212	EUR	iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) ¹	304	0,93
139.603	EUR	iShares Core UK Gilts UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) ¹	665	2,04
39.085	EUR	iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc) ¹	300	0,92
170.804	EUR	iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	982	3,01
198.659	EUR	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) ^{1/2}	836	2,56
35.919	EUR	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	169	0,52
30.188	EUR	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ^{1/2}	170	0,52
3.610	EUR	iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) ¹	136	0,42
111.236	EUR	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	816	2,50
Irlanda - Totale			10.793	33,07

Totale investimenti in ETF

Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
Contratti di cambio a termine³				
Buy USD 6,616,676; Sell EUR 6,249,009	Morgan Stanley	5 ottobre 2023	54	0,16
Buy USD 201,207; Sell EUR 187,962	Barclays	5 ottobre 2023	2	0,01
Buy USD 240,920; Sell EUR 227,287 ⁴	J.P. Morgan	5 ottobre 2023	-	-
Totale utili non realizzati su contratti di cambio a termine (31 marzo 2023: 0,28%)			56	0,17

Contratti di cambio a termine³

Buy EUR 6,494,628; Sell USD 7,058,803	State Street	5 ottobre 2023	(172)	(0,53)
Buy EUR 6,240,769; Sell USD 6,616,676	Morgan Stanley	6 novembre 2023	(53)	(0,16)
Totale perdite non realizzate su contratti di cambio a termine (31 marzo 2023: 0,00%)			(225)	(0,69)

	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico	32.880	100,76
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico	(225)	(0,69)
Liquidità	83	0,26
Altre attività e passività	(105)	(0,33)
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	32.633	100,00

Analisi del totale attività

Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	32,61
Organismi di investimento collettivo	66,57
Strumenti finanziari derivati OTC	0,17
Altre attività	0,65
Totale attività	100,00

% del totale attività

BLACKROCK MULTI ASSET BALANCED SELECTION FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

¹Una parte correlata al Fondo.

²Titolo parzialmente o completamente in prestito.

³I contratti di cambio a termine sottoscritti con una controparte che ha la stessa divisa di acquisto, divisa di vendita e data di scadenza saranno presentati su base aggregata. Non esiste alcuna compensazione di posizioni attive e passive.

⁴Gli investimenti inferiori a EUR 500 sono stati arrotondati a zero.

Valore dell'esposizione	Sui guadagni Migliaia di EUR	Sulle perdite Migliaia di EUR
Contratti di cambio a termine	6.667	12.917

BLACKROCK MULTI ASSET CONSERVATIVE SELECTION FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di USD)	% del Valore patrimoniale netto
ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO				
Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2023: 54,67%)				
Irlanda (31 marzo 2023: 8,92%)				
3.842	EUR	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Classe X EUR Accumulating ¹	551	0,63
24.588	USD	Blackrock Funds I ICAV - BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund - Classe X USD Accumulating ¹	2.427	2,78
23.473	EUR	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating ¹	2.417	2,77
11.413	USD	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating ¹	1.623	1,86
33.458	EUR	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating ¹	3.921	4,48
		Irlanda - Totale	10.939	12,52
Lussemburgo (31 marzo 2023: 45,75%)				
219.074	USD	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD Hedged ¹	2.111	2,42
9.485	EUR	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Class X2 EUR ¹	454	0,52
375.885	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 EUR ¹	2.477	2,83
267.763	EUR	BlackRock Global Funds - Global Inflation Linked Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged ¹	4.008	4,59
161.024	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe X2 USD ¹	1.633	1,87
41.353	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund - Classe X2 USD ¹	436	0,50
32.399	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund - Classe X2 USD ¹	641	0,73
450.375	EUR	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR ¹	4.436	5,08
148.006	USD	BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Opportunities Fund - Classe X2 USD ¹	1.596	1,83
2.225	EUR	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Classe X2 EUR ¹	401	0,46
9.152	EUR	BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Classe X2 EUR ¹	315	0,36
70.324	USD	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Classe X2 USD ¹	1.409	1,61
17.522	USD	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Classe X2 USD ¹	1.317	1,51
3.368	USD	BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Classe X2 USD ¹	273	0,31
27.396	USD	BlackRock Global Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 USD ¹	321	0,37
82.496	USD	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD ¹	1.889	2,16
19.216	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Classe X2 EUR ¹	2.057	2,35
66.112	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 EUR ¹	6.007	6,87
27.638	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR ¹	2.567	2,94
22.847	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR ¹	3.219	3,68
		Lussemburgo - Totale	37.567	42,99
Totale investimenti in organismi di investimento collettivo			48.506	55,51
Totale investimenti in organismi di investimento collettivo			48.506	55,51

BLACKROCK MULTI ASSET CONSERVATIVE SELECTION FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
ETF (31 marzo 2023: 42,70%)				
Germania (31 marzo 2023: 0,91%)				
32.982	EUR	iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF (DE) ¹	868	0,99
Germania - Totale			868	0,99
Irlanda (31 marzo 2023: 41,79%)				
1.289.598	EUR	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) ¹	5.097	5,83
698.467	EUR	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) ¹	3.459	3,96
378.695	EUR	iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) ¹	1.791	2,05
		iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) ¹	366	0,42
118.786	EUR	iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	3.892	4,45
32.841	USD	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) ^{1/2}	3.371	3,86
21.189	USD	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) ¹	436	0,50
109.168	EUR	iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) ¹	1.356	1,55
268.341	EUR	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) ¹	1.103	1,26
207.101	EUR	iShares Core UK Gilts UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) ¹	1.763	2,02
370.155	EUR	iShares Edge MSCI USA Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	2.327	2,66
373.947	EUR	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) ^{1/2}	3.873	4,43
920.332	EUR	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	2.026	2,32
431.378	EUR	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	605	0,69
107.529	EUR	iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) ¹	388	0,45
10.274	EUR	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹	5.363	6,14
730.869	EUR	Irlanda - Totale	37.216	42,59
Totale investimenti in ETF			38.084	43,58
Materie prime negoziate in borsa (31 marzo 2023: 1,10%)				
Irlanda (31 marzo 2023: 1,10%)				
25.267	USD	iShares Physical Gold ETC ¹	861	0,98
Irlanda - Totale			861	0,98
Totale investimenti in materie prime negoziate in borsa			861	0,98
Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Contratti di cambio a termine³				
Buy USD 22,751,673; Sell EUR 21,487,438	Morgan Stanley	05/10/2023	186	0,21
Buy USD 490,975; Sell EUR 460,225	Barclays	05/10/2023	3	0,01
Totale utili non realizzati su contratti di cambio a termine (31 marzo 2023: 0,46%)			189	0,22
Contratti di cambio a termine³				
Buy EUR 21,879,557; Sell USD 23,780,190	State Street	05/10/2023	(579)	(0,67)
Buy EUR 21,459,105; Sell USD 22,751,673	Morgan Stanley	06/11/2023	(183)	(0,21)
Buy USD 537,542; Sell EUR 509,438	Barclays	05/10/2023	(2)	-
Totale perdite non realizzate su contratti di cambio a termine (31 marzo 2023: 0,00%)			(764)	(0,88)

BLACKROCK MULTI ASSET CONSERVATIVE SELECTION FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico	87.640	100,29
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico	(764)	(0,88)
Liquidità	799	0,91
Altre attività e passività	(288)	(0,32)
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	87.387	100,00

	% del totale attività
Analisi del totale attività	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	44,02
Organismi di investimento collettivo	54,83
Strumenti finanziari derivati OTC	0,21
Altre attività	0,94
Totale attività	100,00

¹Una parte correlata al Fondo.

²Titolo parzialmente o completamente in prestito.

³I contratti di cambio a termine sottoscritti con una controparte che ha la stessa divisa di acquisto, divisa di vendita e data di scadenza saranno presentati su base aggregata. Non esiste alcuna compensazione di posizioni attive e passive.

Valore dell'esposizione	Sui guadagni Migliaia di EUR	Sulle perdite Migliaia di EUR
Contratti di cambio a termine	21.953	44.458

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di USD)
Azioni (31 marzo 2023: 79,93%)			
		Bermuda (31 marzo 2023: 0,06%)	-
		Brasile (31 marzo 2023: 0,89%)	-
14.000	HKD	Isole Cayman (31 marzo 2023: 22,45%)	2
890.500	HKD	CIFI Ever Sunshine Services Group Ltd., REIT ¹	86
		Shimao Group Holdings Ltd., REIT ¹	86
		Isole Cayman - Totale	88
		Cile (31 marzo 2023: 0,20%)	-
		Cina (31 marzo 2023: 8,97%)	-
		Grecia (31 marzo 2023: 1,52%)	-
		Hong Kong (31 marzo 2023: 0,86%)	-
		India (31 marzo 2023: 0,23%)	-
		Indonesia (31 marzo 2023: 3,42%)	-
		Malesia (31 marzo 2023: 1,13%)	-
		Messico (31 marzo 2023: 1,54%)	-
		Polonia (31 marzo 2023: 1,10%)	-
		Qatar (31 marzo 2023: 0,73%)	-
814.343	RUB	Russia (31 marzo 2023: 0,00%)¹	-
382.920	RUB	Alrosa PJSC ^{2/3}	-
		Mobile TeleSystems PJSC ^{2/3}	-
		Russia - Totale	-

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Parteci- pazione	Valuta	Investimenti	
Azioni (continua)			
		Arabia Saudita (31 marzo 2023: 2,80%)	-
		Sudafrica (31 marzo 2023: 1,27%)	-
		Corea del Sud (31 marzo 2023: 10,26%)	-
		Taiwan (31 marzo 2023: 16,99%)	-
		Tailandia (31 marzo 2023: 2,68%)	-
		Turchia (31 marzo 2023: 0,61%)	-
		Emirati Arabi Uniti (31 marzo 2023: 1,05%)	-
		Regno Unito (31 marzo 2023: 0,13%)	-
		Stati Uniti (31 marzo 2023: 1,04%)	-
Totale investimenti in azioni			88
			Valore equo (migliaia di USD)
OBBLIGAZIONI			
Titoli di Stato (31 marzo 2023: 17,47%)			
		Stati Uniti (31 marzo 2023: 17,47%)	-
Totale investimenti in titoli di Stato			-
Totale investimenti in obbligazioni			-
			Valore equo Migliaia di USD
Contratti per differenze			
		Brasile (31 marzo 2023: 0,25%)	-
		Cina (31 marzo 2023: 0,05%)	-
Totale utili non realizzati su contratti per differenze (31 marzo 2023: 0,30%)			-
		Brasile (31 marzo 2023: (0,10)%)	-
		Cina (31 marzo 2023: (0,05)%)	-
Totale perdite non realizzate su contratti per differenze (31 marzo 2023: (0,15)%)			-

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Numero di contratti	Valuta	Importo	Descrizione	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di USD
Contratti future					
Germania (31 marzo 2023: 0,18%)					-
Stati Uniti (31 marzo 2023: 0,01%)					-
Totale utili non realizzati su contratti future (31 marzo 2023: 0,19%)					<u>-</u>
					Valore equo (migliaia di USD)
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico					88
Liquidità e garanzia liquida					252
Altre attività e passività					<u>(340)</u>
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili					<u>-</u>
					% del totale attività
Analisi del totale attività					
Valori mobiliari negoziati su un altro mercato regolamentato					20,26
Altre attività					<u>79,74</u>
Totale attività					<u>100,00</u>

¹ Percentuale del valore patrimoniale netto dell'anno precedente arrotondata allo 0,00%.

² Gli investimenti inferiori a USD 500 sono stati arrotondati a zero.

³ Questi titoli sono stati valutati in consultazione con il Gestore. Questi titoli sono stati stimati in base al valore equo, valutati in termini di eventi societari o sospesi alla fine del periodo e stimati in base all'ultimo prezzo negoziato.

FR MULTI-ASSET FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO				
Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2023: 55,03%)				
Irlanda (31 marzo 2023: 27,89%)				
43.776	USD	BlackRock Funds I ICAV - BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund - Classe X USD Accumulating ¹	4.321	1,49
97.774	EUR	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating ¹	10.068	3,48
90.930	USD	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating ¹	12.930	4,47
179.249	USD	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating ¹	28.146	9,73
191.291	EUR	BlackRock Sustainable Equity Factor Plus Fund - Classe X EUR Accumulating ¹	20.051	6,93
60.284	EUR	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating ¹	7.064	2,44
810.164	EUR	iShares Green Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni Flexible EUR Hedged Accumulating ¹	7.293	2,52
		Irlanda - Totale	89.873	31,06
Lussemburgo (31 marzo 2023: 27,14%)				
1.008.606	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR ¹	14.403	4,98
31.813	EUR	BlackRock Global Funds - European Fund - Classe X2 EUR ¹	6.680	2,31
590.894	EUR	BlackRock Global Funds - Global Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged ¹	7.818	2,70
508.822	EUR	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe di Azioni X2 EUR Hedged ¹	4.167	1,44
452.788	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 USD ¹	4.268	1,48
801.667	EUR	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR ¹	7.896	2,73
35.420	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Classe X2 EUR ¹	3.792	1,31
85.369	USD	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Real Asset Securities Fund - Classe X2 USD ¹	9.481	3,28
42.735	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR ¹	3.969	1,37
39.105	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR ¹	5.510	1,90
		Lussemburgo - Totale	67.984	23,50
Totale investimenti in organismi di investimento collettivo			157.857	54,56
Totale investimenti in organismi di investimento collettivo			157.857	54,56
ETF (31 marzo 2023: 42,48%)				
Irlanda (31 marzo 2023: 42,48%)				
883.037	EUR	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) ¹	3.492	1,21
975.445	EUR	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) ¹	4.832	1,67
3.765.796	EUR	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) ¹	11.598	4,01
965.265	EUR	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) ¹	3.890	1,34
28.631	EUR	iShares € Govt Bond 15-30yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) ¹	4.652	1,61
282.410	EUR	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) ¹	1.127	0,39
10.600	EUR	iShares € Inflation Linked Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc) ¹	2.297	0,79
1.227.698	EUR	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) ¹	6.547	2,26
19.009	EUR	iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) ¹	2.805	0,97

FR MULTI-ASSET FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti		Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
ETF (continua)					
664.050	EUR	Irlanda (31 marzo 2023: 42,48%) (continua) iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹		4.344	1,50
3.662.454	EUR	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) ^{1/}		15.428	5,33
1.128.608	EUR	iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc) ¹		7.276	2,52
838.235	EUR	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹		4.714	1,63
3.002.325	EUR	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹		22.061	7,63
1.289.522	USD	iShares MSCI USA Value Factor ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹		5.794	2,00
460.193	EUR	iShares MSCI World ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹		3.071	1,06
1.449.088	EUR	iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) ¹		6.784	2,35
1.537.747	EUR	iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) ¹		6.343	2,19
		Irlanda - Totale		117.055	40,46
Totale investimenti in ETF				117.055	40,46
Descrizione	Controparte	Data di scadenza		Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Contratti di cambio a termine:					
Buy AUD 2,220,682; Sell EUR 1,339,662	NatWest Markets	11 gennaio 2024		12	-
Buy CAD 4,357,442; Sell EUR 3,018,760	Bank of America	4 ottobre 2023		25	0,01
Buy EUR 1,528,305; Sell CAD 2,180,000	BNP Paribas	4 ottobre 2023		5	-
Buy EUR 1,526,315; Sell CAD 2,177,442	Barclays	4 ottobre 2023		5	-
Buy EUR 3,442,637; Sell GBP 2,973,295	Standard Chartered	4 ottobre 2023		15	0,01
Buy EUR 5,213,515; Sell JPY 811,929,853	Standard Chartered	4 ottobre 2023		74	0,03
Buy EUR 596,202; Sell JPY 92,072,768	Bank of America	4 ottobre 2023		13	-
Buy EUR 494,742; Sell JPY 77,268,107	State Street	4 ottobre 2023		6	-
Buy EUR 2,633,737; Sell JPY 408,915,000	BNP Paribas	11 gennaio 2024		14	0,01
Buy EUR 2,632,933; Sell JPY 408,910,274	Barclays	11 gennaio 2024		13	-
Buy EUR 14,029,801; Sell USD 14,860,000	Barclays	11 gennaio 2024		65	0,02
Buy EUR 14,029,456; Sell USD 14,860,000	Toronto-Dominion Bank	11 gennaio 2024		65	0,02
Buy EUR 14,026,437; Sell USD 14,860,000	BNP Paribas	11 gennaio 2024		62	0,02
Buy EUR 14,020,720; Sell USD 14,860,000	Morgan Stanley	11 gennaio 2024		56	0,02
Buy EUR 14,025,526; Sell USD 14,867,254	NatWest Markets	11 gennaio 2024		54	0,02
Buy GBP 1,488,295; Sell EUR 1,713,638	Barclays	4 ottobre 2023		2	-
Buy GBP 1,485,000; Sell EUR 1,710,469	BNP Paribas	4 ottobre 2023		1	-
Buy USD 3,611,829; Sell EUR 3,247,358	HSBC	4 ottobre 2023		164	0,06
Buy USD 2,752,149; Sell EUR 2,500,889	Goldman Sachs	4 ottobre 2023		98	0,04
Buy USD 1,683,135; Sell EUR 1,548,615	State Street	4 ottobre 2023		41	0,01
Buy USD 2,965,486; Sell EUR 2,787,145	State Street	11 gennaio 2024		24	0,01
Totale utili non realizzati (31 marzo 2023: 0,81%)				814	0,28
Istituzionale ad accumulazione coperta in SEK					
Buy SEK 2,204,862,245; Sell EUR 185,507,422	J.P. Morgan	13 ottobre 2023		6.176	2,14
Totale utili non realizzati (31 marzo 2023: 0,82%)				6.176	2,14
Istituzionale ad accumulazione coperta in USD					
Buy USD 70,162,875; Sell EUR 65,398,265	J.P. Morgan	13 ottobre 2023		844	0,29
Totale utili non realizzati (31 marzo 2023: 0,00%)				844	0,29
Totale utili non realizzati su contratti di cambio a termine (31 marzo 2023: 1,63%)				7.834	2,71

FR MULTI-ASSET FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Contratti di cambio a termine²

Buy AUD 2,220,682; Sell EUR 1,353,706 ³	RBC	4 ottobre 2023	–	–
Buy CAD 2,177,442; Sell EUR 1,521,303	Barclays	11 gennaio 2024	(5)	–
Buy CAD 2,180,000; Sell EUR 1,523,318	BNP Paribas	11 gennaio 2024	(5)	–
Buy EUR 1,341,468; Sell AUD 2,220,682	NatWest Markets	4 ottobre 2023	(12)	–
Buy EUR 1,703,415; Sell GBP 1,485,000	BNP Paribas	11 gennaio 2024	(1)	–
Buy EUR 1,706,604; Sell GBP 1,488,295	Barclays	11 gennaio 2024	(2)	–
Buy EUR 953,158; Sell USD 1,054,168	J.P. Morgan	4 ottobre 2023	(42)	(0,02)
Buy EUR 757,767; Sell USD 855,193	Bank of America	4 ottobre 2023	(50)	(0,02)
Buy EUR 1,511,355; Sell USD 1,656,409	State Street	4 ottobre 2023	(53)	(0,02)
Buy EUR 13,626,396; Sell USD 14,975,000	Toronto-Dominion Bank	4 ottobre 2023	(517)	(0,18)
Buy EUR 13,622,817; Sell USD 14,981,339	Barclays	4 ottobre 2023	(527)	(0,18)
Buy EUR 13,614,924; Sell USD 14,975,000	NatWest Markets	4 ottobre 2023	(529)	(0,18)
Buy EUR 14,974,870; Sell USD 16,479,819	BNP Paribas	4 ottobre 2023	(590)	(0,20)
Buy EUR 15,803,165; Sell USD 17,377,439	Morgan Stanley	4 ottobre 2023	(610)	(0,21)
Buy JPY 71,510,816; Sell EUR 459,596	J.P. Morgan	4 ottobre 2023	(7)	–
Buy JPY 408,910,274; Sell EUR 2,602,369	Barclays	4 ottobre 2023	(14)	(0,01)
Buy JPY 408,915,000; Sell EUR 2,603,204	BNP Paribas	4 ottobre 2023	(15)	(0,01)
Buy JPY 91,934,638; Sell EUR 602,452	Goldman Sachs	4 ottobre 2023	(21)	(0,01)
Buy USD 14,867,254; Sell EUR 14,094,348	NatWest Markets	4 ottobre 2023	(53)	(0,02)
Buy USD 14,860,000; Sell EUR 14,090,116	Morgan Stanley	4 ottobre 2023	(55)	(0,02)
Buy USD 14,860,000; Sell EUR 14,095,288	BNP Paribas	4 ottobre 2023	(60)	(0,02)
Buy USD 14,860,000; Sell EUR 14,098,672	Toronto-Dominion Bank	4 ottobre 2023	(64)	(0,02)
Buy USD 14,860,000; Sell EUR 14,098,672	Barclays	4 ottobre 2023	(64)	(0,02)

Totale perdite non realizzate (31 marzo 2023: (0,16)%)

(3.296) (1,14)

Istituzionale ad accumulazione coperta in SEK

Buy EUR 344,600; Sell SEK 4,053,634	J.P. Morgan	13 ottobre 2023	(7)	–
-------------------------------------	-------------	-----------------	-----	---

Totale perdite non realizzate (31 marzo 2023: 0,00%)⁴

(7) –

Istituzionale ad accumulazione coperta in USD

Totale perdite non realizzate (31 marzo 2023: (0,51)%)

– –

Totale perdite non realizzate su contratti di cambio a termine (31 marzo 2023: (0,67)%)

(3.303) (1,14)

Numero di contratti	Valuta	Importo	Descrizione	Data di scadenza	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
---------------------	--------	---------	-------------	------------------	-------------------------------	---------------------------------

Contratti future

Germania (31 marzo 2023: 0,09%)

(128)	EUR	(12.800.000)	Euro-Bobl	7 dicembre 2023	146	0,05
(39)	EUR	(3.900.000)	Euro-Bund	7 dicembre 2023	103	0,04
Germania - Totale					249	0,09

Giappone (31 marzo 2023: 0,06%)

(9)	JPY	(900.000.000)	Japan 10 Year Bond	13 dicembre 2023	60	0,02
Giappone - Totale					60	0,02

Stati Uniti (31 marzo 2023: 0,13%)

(54)	USD	(5.400.000)	US Long Bond	19 dicembre 2023	323	0,11
(21)	USD	(2.100.000)	US Ultra Bond	19 dicembre 2023	174	0,06
Stati Uniti - Totale					497	0,17

Totale utili non realizzati su contratti future (31 marzo 2023: 0,28%)

806 0,28

FR MULTI-ASSET FUND

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Numero di contratti	Valuta	Importo	Descrizione	Data di scadenza	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Contratti future (continua)						
Germania (31 marzo 2023: (0,21)%)						
297	EUR	29.700.000	Euro-Schatz	7 dicembre 2023	(112)	(0,04)
Germania - Totale					(112)	(0,04)
Giappone (31 marzo 2023: (0,06)%)						
Stati Uniti (31 marzo 2023: (0,03)%)						
28	USD	1.400	S&P 500 Emini Index	15 dicembre 2023	(238)	(0,08)
13	USD	1.300.000	US 10 Year Note	19 dicembre 2023	(24)	(0,01)
Stati Uniti - Totale					(262)	(0,09)
Totale perdite non realizzate su contratti future (31 marzo 2023: (0,30)%)					(374)	(0,13)
					Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico					283.552	98,01
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico					(3.677)	(1,27)
Liquidità e liquidità a margine					9.598	3,32
Strumenti liquidi equivalenti						
Partecipazione	Valuta	Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2023: 0,03%)				
		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0) ¹				
1.015	EUR				102	0,03
Totale in strumenti liquidi equivalenti					102	0,03
Altre attività e passività					(257)	(0,09)
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili					289.318	100,00

	% del totale attività
Analisi del totale attività	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	39,82
Organismi di investimento collettivo	53,73
Strumenti finanziari derivati negoziati in un mercato regolamentato	0,27
Strumenti finanziari derivati OTC	2,66
Altre attività	3,52
Totale attività	100,00

¹Una parte correlata al Fondo.

²Contratti di cambio a termine detenuti da una controparte che ha la stessa divisa di acquisto, divisa di vendita e data di scadenza saranno presentati su base aggregata, se del caso. Non esiste alcuna compensazione di posizioni attive e passive.

³Gli investimenti inferiori a EUR 500 sono stati arrotondati a zero.

⁴Percentuale del valore patrimoniale netto dell'anno precedente arrotondata allo 0,00%.

Valore dell'esposizione	Sui guadagni Migliaia di EUR	Sulle perdite Migliaia di EUR
Contratti di cambio a termine	364.226	163.711
Contratti future	36.248	38.229

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI				
Titoli del debito societario				
Australia				
6.500.000	EUR	Westpac Banking Corp., 3.70%, 16/01/2026	6.457	2,90
		Australia - Totale	6.457	2,90
Belgio				
2.900.000	EUR	Belfius Bank SA, 3.13%, 11/05/2026	2.792	1,25
1.800.000	EUR	Belfius Bank SA, 0.00%, 28/08/2026	1.606	0,72
		Belgio - Totale	4.398	1,97
Finlandia				
5.000.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.25%, 24/03/2026	4.554	2,04
		Finlandia - Totale	4.554	2,04
Francia				
7.400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.01%, 11/05/2026	6.661	2,99
1.500.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.75%, 27/01/2026	1.449	0,65
4.000.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.13%, 11/06/2026	3.707	1,66
1.500.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.88%, 01/10/2026	1.433	0,64
6.700.000	EUR	BPCE SA, 3.63%, 17/04/2026	6.614	2,96
1.500.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.85%, 27/04/2026	1.442	0,65
7.000.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.63%, 15/04/2026	6.570	2,95
500.000	EUR	RCI Banque SA, 4.63%, 13/07/2026	501	0,22
3.000.000	EUR	Renault SA, 2.38%, 25/05/2026	2.786	1,25
		Francia - Totale	31.163	13,97
Germania				
4.500.000	EUR	Commerzbank AG, 4.00%, 23/03/2026	4.376	1,96
4.200.000	EUR	Deutsche Bank AG, 2.63%, 12/02/2026	4.020	1,80
1.500.000	EUR	Deutsche Bank AG, 4.50%, 19/05/2026	1.491	0,67
5.000.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 4.25%, 28/05/2026	4.980	2,23
7.000.000	EUR	RWE AG, 2.13%, 24/05/2026	6.677	3,00
2.100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.38%, 28/01/2026	1.954	0,88
1.500.000	EUR	ZF Finance GmbH, 5.75%, 03/08/2026	1.500	0,67
		Germania - Totale	24.998	11,21
Italia				
5.800.000	EUR	A2A SpA, 2.50%, 15/06/2026	5.565	2,49
5.500.000	EUR	ASTM SpA, 1.00%, 25/11/2026	4.944	2,22
5.300.000	EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 1.75%, 26/06/2026	4.972	2,23
		Italia - Totale	15.481	6,94
Giappone				
4.700.000	EUR	Nissan Motor Co. Ltd., 2.65%, 17/03/2026	4.484	2,01
		Giappone - Totale	4.484	2,01
Lussemburgo				
4.500.000	EUR	Highland Holdings Sarl, 0.32%, 15/12/2026	4.000	1,79
		Lussemburgo - Totale	4.000	1,79
Paesi Bassi				
5.500.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.63%, 10/01/2026	5.448	2,44
2.500.000	EUR	de Volksbank NV, 0.25%, 22/06/2026	2.231	1,00

NM1123U-3256239-168/201

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
OBBLIGAZIONI (continua)				
Titoli del debito societario (continua)				
Paesi Bassi (continua)				
7.400.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.00%, 28/05/2026	6.653	2,98
1.500.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.25%, 19/04/2026	1.403	0,63
5.200.000	EUR	Sika Capital BV, 3.75%, 03/11/2026	5.168	2,32
2.000.000	EUR	ZF Europe Finance BV, 2.00%, 23/02/2026	1.836	0,83
Paesi Bassi - Totale			22.739	10,20
Spagna				
6.800.000	EUR	Banco Santander SA, 3.25%, 04/04/2026	6.582	2,95
2.000.000	EUR	CaixaBank SA, 1.13%, 27/03/2026	1.854	0,83
1.200.000	EUR	CaixaBank SA, 1.38%, 19/06/2026	1.107	0,50
2.000.000	EUR	CaixaBank SA, 1.13%, 12/11/2026	1.806	0,81
5.000.000	EUR	Cellnex Finance Co. SA, 0.75%, 15/11/2026 ¹	4.447	1,99
Spagna - Totale			15.796	7,08
Svezia				
2.500.000	EUR	Lansforsakringar Bank AB, 0.05%, 15/04/2026	2.238	1,00
4.400.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.00%, 09/11/2026	4.371	1,96
4.500.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.75%, 05/05/2026	4.463	2,00
Svezia - Totale			11.072	4,96
Svizzera				
7.200.000	EUR	Credit Suisse AG, 1.50%, 10/04/2026	6.706	3,01
Svizzera - Totale			6.706	3,01
Regno Unito				
2.600.000	EUR	Anglo American Capital plc, 1.63%, 11/03/2026	2.453	1,10
7.000.000	EUR	British Telecommunications plc, 1.75%, 10/03/2026	6.634	2,98
4.300.000	EUR	DS Smith plc, 0.88%, 12/09/2026	3.884	1,74
5.000.000	EUR	Experian Finance plc, 1.38%, 25/06/2026	4.662	2,09
6.850.000	EUR	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 2.38%, 09/04/2026	6.585	2,95
1.200.000	EUR	National Grid plc, 2.18%, 30/06/2026	1.138	0,51
7.000.000	EUR	NatWest Markets plc, 0.13%, 18/06/2026	6.260	2,81
Regno Unito - Totale			31.616	14,18
Stati Uniti				
2.000.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 1.95%, 22/05/2026	1.882	0,84
5.800.000	EUR	Citigroup, Inc., 2.13%, 10/09/2026	5.498	2,47
4.600.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 2.39%, 17/02/2026	4.329	1,94
4.500.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 0.85%, 26/02/2026	4.139	1,86
5.800.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.63%, 27/07/2026	5.448	2,44
4.100.000	EUR	Harley-Davidson Financial Services, Inc., 5.13%, 05/04/2026	4.149	1,86
5.700.000	EUR	National Grid North America, Inc., 0.41%, 20/01/2026	5.229	2,34
7.000.000	EUR	Wells Fargo & Co., 2.00%, 27/04/2026	6.626	2,97
Stati Uniti - Totale			37.300	16,72
Totale investimenti in titoli di debito societario			220.764	98,98
Totale investimenti in obbligazioni			220.764	98,98

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Contratti di cambio a termine²				
Classe C USD Hedged Accumulating				
Buy USD 2,340,907; Sell EUR 2,181,941	J.P. Morgan	13 ottobre 2023	28	0,01
Totale utili non realizzati			28	0,01
Classe C USD Hedged Distributing				
Buy USD 2,416,510; Sell EUR 2,252,410	J.P. Morgan	13 ottobre 2023	29	0,01
Totale utili non realizzati			29	0,01
Totale utili non realizzati su contratti di cambio a termine			57	0,02
Contratti di cambio a termine²				
Buy CHF 1,330; Sell EUR 1,378 ³	J.P. Morgan	31 ottobre 2023	–	–
Buy USD 7,227; Sell EUR 6,832 ³	J.P. Morgan	31 ottobre 2023	–	–
Totale perdite non realizzate			–	–
Classe C CHF Hedged Accumulating				
Buy CHF 170,427; Sell EUR 178,811	J.P. Morgan	13 ottobre 2023	(2)	–
Totale perdite non realizzate			(2)	–
Classe C CHF Hedged Distributing				
Buy CHF 419,987; Sell EUR 440,648	J.P. Morgan	13 ottobre 2023	(7)	–
Totale perdite non realizzate			(7)	–
Totale perdite non realizzate su contratti di cambio a termine			(9)	–
			Valore equo (migliaia di EUR)	% del Valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico			220.821	99,00
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico			(9)	–
Liquidità				
Strumenti liquidi equivalenti				
Partecipazione	Valuta	Organismi di investimento collettivo	7	–
5.594	EUR	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0) ⁴	564	0,25
Totale in strumenti liquidi equivalenti			564	0,25
Altre attività e passività			1.667	0,75
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili			223.050	100,00

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2023

	% del totale attività
Analisi del totale attività	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	98,72
Organismi di investimento collettivo	0,25
Strumenti finanziari derivati OTC	0,03
Altre attività	1,00
Totale attività	100,00

¹ Titolo parzialmente o completamente in prestito.

² Contratti di cambio a termine detenuti da una controparte che ha la stessa divisa di acquisto, divisa di vendita e data di scadenza saranno presentati su base aggregata, se del caso. Non esiste alcuna compensazione di posizioni attive e passive.

³ Gli investimenti inferiori a EUR 500 sono stati arrotondati a zero.

⁴ Una parte correlata al Fondo.

Valore dell'esposizione	Sui guadagni Migliaia di EUR	Sulle perdite Migliaia di EUR
Contratti di cambio a termine	4.493	618

BLACKROCK CANGRANDE GLOBAL INDEX EQUITY FUND

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Vendite		
Quantità	Investimenti	Ricavi Migliaia di EUR
5.409	iShares Developed World ESG Screened Index Fund (IE) - Classe di Azioni US Dollar Flexible Accumulating	104

La CBI richiede un prospetto delle variazioni sostanziali nella composizione del portafoglio durante il periodo finanziario. Con tali variazioni si intendono gli acquisti totali di un titolo che eccedano l'1% del valore complessivo degli acquisti per il periodo finanziario e le vendite totali superiori all'1% del valore complessivo delle vendite. Devono essere riportate come minimo le voci relative ai 20 acquisti e alle 20 vendite principali oppure tutti gli acquisti e le vendite se inferiori a 20. È possibile richiedere gratuitamente all'Agente Amministrativo l'elenco completo delle variazioni di portafoglio per il periodo finanziario.

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Acquisti		
Quantità	Investimenti	Costo Migliaia di EUR
237.259	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0)	23.693
800.000	UBS Group AG, FRN, 7.75%, 01/03/2029	888
600.000	UBS Group AG, FRN, 2.13%, 13/10/2026	571
500.000	Robert Bosch GmbH, 4.38%, 02/06/2043	506
500.000	CA Auto Bank SPA, 4.38%, 08/06/2026	502
500.000	WPP Finance SA, 4.13%, 30/05/2028	501
500.000	KBC Group NV, FRN, 4.50%, 06/06/2026	500
500.000	PACCAR Financial Europe BV, 3.38%, 15/05/2026	497
500.000	Bouygues SA, 3.88%, 17/07/2031	496
425.000	Bayer AG, 4.63%, 26/05/2033	431
400.000	Toyota Motor Credit Corp., 4.05%, 13/09/2029	410
400.000	Anglo American Capital plc, 4.50%, 15/09/2028	407
400.000	DNB Bank ASA, FRN, 4.50%, 19/07/2028	401
400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.13%, 13/03/2029	400
400.000	Banco Santander SA, FRN, 5.75%, 23/08/2033	400
400.000	Intesa Sanpaolo SpA, 5.13%, 29/08/2031	400
400.000	ING Groep NV, FRN, 4.75%, 23/05/2034	400
400.000	Eurogrid GmbH, 3.72%, 27/04/2030	398
400.000	ABN AMRO Bank NV, 3.75%, 20/04/2025	398
400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.13%, 14/06/2033	398
Vendite		
Quantità	Investimenti	Ricavi Migliaia di EUR
238.142	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0)	23.768
650.000	Medtronic Global Holdings SCA, 0.00%, 15/10/2025	609
550.000	Airbus SE, 1.63%, 09/06/2030	498
500.000	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 2.26%, 14/06/2025	490
500.000	DNB Bank ASA, 3.13%, 21/09/2027	488
500.000	Intesa Sanpaolo SpA, 1.00%, 04/07/2024	488
500.000	ING Groep NV, 0.10%, 03/09/2025	482
500.000	Wells Fargo & Co., 1.63%, 02/06/2025	476
500.000	BNP Paribas SA, FRN, 2.13%, 23/01/2027	470
500.000	Berkshire Hathaway, Inc., 2.15%, 15/03/2028	467
500.000	BPCE SA, 0.25%, 15/01/2026	455
450.000	Anheuser-Busch InBev SA, 2.88%, 02/04/2032	421
450.000	Wells Fargo & Co., 1.50%, 24/05/2027	406
400.000	BPCE SA, 4.38%, 13/07/2028	397
400.000	Amprion GmbH, 3.45%, 22/09/2027	397
400.000	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 3.38%, 27/03/2025	395
400.000	RWE AG, 2.50%, 24/08/2025	392
400.000	Sanofi, 0.88%, 06/04/2025	385
400.000	UBS Group AG, 1.25%, 17/04/2025	385
400.000	Enel Finance International NV, 0.00%, 17/06/2024	385

La CBI richiede un prospetto delle variazioni sostanziali nella composizione del portafoglio durante il periodo finanziario. Con tali variazioni si intendono gli acquisti totali di un titolo che eccedano l'1% del valore complessivo degli acquisti per il periodo finanziario e le vendite totali superiori all'1% del valore complessivo delle vendite. Devono essere riportate come minimo le voci relative ai 20 acquisti e alle 20 vendite principali oppure tutti gli acquisti e le vendite se inferiori a 20. È possibile richiedere gratuitamente all'Agente Amministrativo l'elenco completo delle variazioni di portafoglio per il periodo finanziario.

BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Acquisti		
Quantità	Investimenti	Costo Migliaia di EUR
8.471	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0)	844
284.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.75%, 30/05/2024	279
187.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.30%, 15/02/2033	186
170.000	France Government Bond OAT, 2.50%, 24/09/2026	168
170.000	Bundesschatzanweisungen, 2.50%, 13/03/2025	168
162.000	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/11/2028	146
151.000	France Government Bond OAT, 0.25%, 25/11/2026	138
131.000	Bundesobligation, 2.20%, 13/04/2028	130
140.000	Netherlands Government Bond, 0.75%, 15/07/2027	130
130.000	Spain Government Bond, 2.80%, 31/05/2026	129
146.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.80%, 15/08/2053	126
120.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.40%, 01/05/2033	122
110.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.40%, 28/03/2025	110
110.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.85%, 15/12/2029	110
109.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.00%, 01/12/2025	105
108.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2025	103
115.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/11/2028	101
100.000	Croatia Government Bond, 3.00%, 11/03/2025	99
100.000	Croatia Government Bond, 3.00%, 20/03/2027	99
95.000	Spain Government Bond, 3.55%, 31/10/2033	96
112.000	Croatia Government Bond, 1.50%, 17/06/2031	95
115.000	France Government Bond OAT, 1.25%, 25/05/2036	93
96.000	France Government Bond OAT, 1.00%, 25/11/2025	92
90.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.80%, 01/08/2028	91
95.000	France Government Bond OAT, 1.25%, 25/05/2038	85
82.000	France Government Bond OAT, 3.00%, 25/05/2033	82
90.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.10%, 01/04/2027	82
100.000	Latvia Government Bond, 0.25%, 23/01/2030	81
104.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/05/2032	81
55.000	Spain Government Bond, 5.75%, 30/07/2032	76
78.000	France Government Bond OAT, 3.00%, 25/05/2054	73
79.000	France Government Bond OAT, 2.50%, 25/05/2043	71
70.000	Bundesschatzanweisungen, 2.80%, 12/06/2025	70
80.000	Austria Government Bond, 0.90%, 20/02/2032	68
Vendite		
Quantità	Investimenti	Ricavi Migliaia di EUR
10.094	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0)	1.006
860.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.50%, 01/11/2027	960
800.000	France Government Bond OAT, 5.50%, 25/04/2029	908
775.000	France Government Bond OAT, 3.50%, 25/04/2026	783
784.000	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2025	746
734.000	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2026	684
600.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.00%, 01/05/2031	683
580.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.25%, 01/11/2029	626
688.000	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2028	626
693.000	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/11/2028	624
753.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/11/2030	615
535.000	Spain Government Bond, 6.00%, 31/01/2029	608
590.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.50%, 01/03/2024	597
578.000	France Government Bond OAT, 2.75%, 25/10/2027	577
532.000	Spain Government Bond, 5.90%, 30/07/2026	576
565.000	France Government Bond OAT, 2.50%, 25/05/2030	554
439.000	France Government Bond OAT, 4.75%, 25/04/2035	507
511.000	France Government Bond OAT, 2.25%, 25/05/2024	507
539.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2026	500

BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI (continua)

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Vendite (continua)		
Quantità	Investimenti	Ricavi Migliaia di EUR
405.000	Spain Government Bond, 5.75%, 30/07/2032	491

La CBI richiede un prospetto delle variazioni sostanziali nella composizione del portafoglio durante il periodo finanziario. Con tali variazioni si intendono gli acquisti totali di un titolo che eccedano l'1% del valore complessivo degli acquisti per il periodo finanziario e le vendite totali superiori all'1% del valore complessivo delle vendite. Devono essere riportate come minimo le voci relative ai 20 acquisti e alle 20 vendite principali oppure tutti gli acquisti e le vendite se inferiori a 20. È possibile richiedere gratuitamente all'Agente Amministrativo l'elenco completo delle variazioni di portafoglio per il periodo finanziario.

BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Acquisti		
Quantità	Investimenti	Costo Migliaia di GBP
87.834	BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Dis), 0,00%	8.779
700.000	UK Treasury, 3.25%, 31/01/2033	638
500.000	Danske Bank A/S, FRN, 4.63%, 13/04/2027	472
400.000	Deutsche Bank AG, FRN, 6.13%, 12/12/2030	381
400.000	Volkswagen International Finance NV, 4.13%, 17/11/2031	349
300.000	UK Treasury, 4.25%, 07/06/2032	322
300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.38%, 25/05/2028	299
300.000	International Distributions Services plc, 7.38%, 14/09/2030	299
300.000	Banco Santander SA, 5.13%, 25/01/2030	285
300.000	Severn Trent Utilities Finance plc, 4.88%, 24/01/2042	284
300.000	DNB Bank ASA, FRN, 2.63%, 10/06/2026	278
275.000	Yorkshire Building Society, FRN, 6.38%, 15/11/2028	274
250.000	Whitbread Group plc, 3.00%, 31/05/2031	201
200.000	American Honda Finance Corp., 5.60%, 06/09/2030	200
200.000	Credit Agricole SA, FRN, 6.38%, 14/06/2031	199
200.000	Engie SA, 5.63%, 03/04/2053	199
200.000	Rentokil Initial plc, 5.00%, 27/06/2032	196
200.000	Compass Group plc, 4.38%, 08/09/2032	188
200.000	PepsiCo, Inc., 3.55%, 22/07/2034	181
200.000	General Electric Co., 4.88%, 18/09/2037	180
175.000	Principality Building Society, 8.63%, 12/07/2028	175
200.000	Welltower OP LLC, REIT, 4.50%, 01/12/2034	172
200.000	Holcim Sterling Finance Netherlands BV, 3.00%, 12/05/2032	165

Vendite		
Quantità	Investimenti	Ricavi Migliaia di GBP
88.995	BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Dis), 0,00%	8.895
1.785.000	UK Treasury, 4.25%, 07/06/2032	1.804
800.000	Banco Santander SA, 1.75%, 17/02/2027	677
600.000	DNB Bank ASA, FRN, 2.63%, 10/06/2026	568
500.000	Bank of America Corp., 7.00%, 31/07/2028	523
500.000	Imperial Brands Finance plc, 8.13%, 15/03/2024	508
484.000	Severn Trent Utilities Finance plc, 6.25%, 07/06/2029	492
453.000	Eastern Power Networks plc, 5.75%, 08/03/2024	456
400.000	Heathrow Funding Ltd., 6.45%, 10/12/2031	414
500.000	BNP Paribas SA, 1.88%, 14/12/2027	414
350.000	Deutsche Telekom International Finance BV, 8.88%, 27/11/2028	406
400.000	AT&T, Inc., 4.38%, 14/09/2029	370
400.000	Volkswagen International Finance NV, 3.38%, 16/11/2026	367
400.000	NatWest Group plc, FRN, 3.62%, 29/03/2029	357
500.000	Diageo Finance plc, 1.25%, 28/03/2033	354
350.000	Johnson & Johnson, 5.50%, 06/11/2024	352
400.000	American Honda Finance Corp., 1.50%, 19/10/2027	341
375.000	Cooperatieve Rabobank UA, 4.63%, 23/05/2029	340
301.000	Lloyds Bank plc, 7.50%, 15/04/2024	307
300.000	BAT International Finance plc, 7.25%, 12/03/2024	304

La CBI richiede un prospetto delle variazioni sostanziali nella composizione del portafoglio durante il periodo finanziario. Con tali variazioni si intendono gli acquisti totali di un titolo che eccedano l'1% del valore complessivo degli acquisti per il periodo finanziario e le vendite totali superiori all'1% del valore complessivo delle vendite. Devono essere riportate come minimo le voci relative ai 20 acquisti e alle 20 vendite principali oppure tutti gli acquisti e le vendite se inferiori a 20. È possibile richiedere gratuitamente all'Agente Amministrativo l'elenco completo delle variazioni di portafoglio per il periodo finanziario.

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Acquisti		
Quantità	Investimenti	Costo Migliaia di EUR
173.912	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0)	17.382
500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.13%, 13/03/2029	505
500.000	Sage Group plc (The), 3.82%, 15/02/2028	502
500.000	ABN AMRO Bank NV, 4.38%, 20/10/2028	500
500.000	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.00%, 17/12/2027	461
500.000	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.64%, 18/05/2028	455
450.000	Nordea Bank Abp, 4.13%, 05/05/2028	449
450.000	3i Group plc, 4.88%, 14/06/2029	443
500.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.38%, 28/02/2028	424
400.000	DNB Bank ASA, FRN, 4.00%, 14/03/2029	404
400.000	Telecom Italia SpA, 6.88%, 15/02/2028	403
400.000	Lottomatica SpA, FRN, 7.92%, 01/06/2028	403
400.000	ASML Holding NV, 3.50%, 06/12/2025	400
400.000	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 4.23%, 25/04/2029	399
400.000	Azzurra Aeroporti SpA, 2.13%, 30/05/2024	389
400.000	UniCredit SpA, FRN, 4.45%, 16/02/2029	388
400.000	International Consolidated Airlines Group SA, 3.75%, 25/03/2029	355
400.000	BPCE SA, FRN, 1.63%, 02/03/2029	353
300.000	Ford Motor Credit Co. LLC, 6.13%, 15/05/2028	312
300.000	Banco de Sabadell SA, FRN, 5.13%, 10/11/2028	304

Vendite		
Quantità	Investimenti	Ricavi Migliaia di EUR
190.228	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0)	19.005
600.000	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 0.38%, 17/10/2023	591
600.000	Pernod Ricard SA, 0.00%, 24/10/2023	591
500.000	IQVIA, Inc., 2.88%, 15/09/2025	485
500.000	Thermo Fisher Scientific, Inc., 0.75%, 12/09/2024	482
400.000	ASTM SpA, 3.38%, 13/02/2024	398
400.000	Stryker Corp., 1.13%, 30/11/2023	394
400.000	American Honda Finance Corp., 1.95%, 18/10/2024	391
400.000	Iberdrola Finanzas SA, 0.88%, 16/06/2025	379
400.000	MMS USA Holdings, Inc., 0.63%, 13/06/2025	376
400.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 3.75%, 09/05/2027	363
400.000	Catalent Pharma Solutions, Inc., 2.38%, 01/03/2028	359
350.000	Coty, Inc., 3.88%, 15/04/2026	342
350.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH, 2.00%, 15/07/2025	341
350.000	NGG Finance plc, 1.63%, 05/12/2079	334
325.000	Snam SpA, 0.00%, 12/05/2024	313
300.000	Eni SpA, 1.75%, 18/01/2024	296
300.000	Vivendi SE, 1.13%, 24/11/2023	296
300.000	Arkema SA, 2.75%, 31/12/2164	291
300.000	voestalpine AG, 1.38%, 27/09/2024	289

La CBI richiede un prospetto delle variazioni sostanziali nella composizione del portafoglio durante il periodo finanziario. Con tali variazioni si intendono gli acquisti totali di un titolo che eccedano l'1% del valore complessivo degli acquisti per il periodo finanziario e le vendite totali superiori all'1% del valore complessivo delle vendite. Devono essere riportate come minimo le voci relative ai 20 acquisti e alle 20 vendite principali oppure tutti gli acquisti e le vendite se inferiori a 20. È possibile richiedere gratuitamente all'Agente Amministrativo l'elenco completo delle variazioni di portafoglio per il periodo finanziario.

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Acquisti		Costo
Quantità	Investimenti	Migliaia di EUR
19.400.000	China Government Bond, 2.80%, 15/11/2032	2.499
14.100.000	China Government Bond, 2.50%, 25/07/2027	1.847
5.200.000	China Government Bond, 3.32%, 15/04/2052	705
5.200.000	China Government Bond, 2.80%, 24/03/2029	689
570.000	UK Treasury, 4.13%, 29/01/2027	645
90.500.000	Japan Government Two Year Bond, 0.01%, 01/10/2024	577
990.000	Australia Government Bond, 0.25%, 21/11/2024	573
790.000	Canada Government Bond, 3.00%, 01/04/2026	530
770.000	Canada Government Bond, 3.75%, 01/05/2025	529
580.000	US Treasury, 3.00%, 31/07/2024	524
72.150.000	Japan Government Two Year Bond, 0.01%, 01/08/2025	464
420.000	Bundesschatzanweisungen, 2.80%, 12/06/2025	417
1.950.000	Malaysia Government Bond, 4.19%, 07/10/2032	413
400.000	France Government Bond OAT, 2.50%, 24/09/2026	394
430.000	US Treasury, 3.00%, 30/06/2024	388
5.794.000.000	Indonesia Government Bond, 7.00%, 15/02/2033	375
2.700.000	China Government Bond, 2.69%, 12/08/2026	357
360.000	Spain Government Bond, 3.15%, 30/04/2033	352
620.000	Australia Government Bond, 2.75%, 21/11/2028	349
489.640.000	Korea Treasury Bond, 3.13%, 10/06/2026	335
350.000	Bundesobligation, 0.00%, 10/04/2026	327
340.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2025	324
490.000	Canada Government Bond, 2.25%, 01/12/2029	319
Vendite		Ricavi
Quantità	Investimenti	Migliaia di EUR
1.357.000	Commonwealth Bank of Australia, 2.75%, 21/04/2024	855
850.000	US Treasury, 3.00%, 30/06/2024	755
770.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.20%, 14/06/2024	748
685.000	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2025	654
678.000	US Treasury, 3.00%, 31/07/2024	612
640.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/02/2027	589
580.000	Spain Government Bond, 0.25%, 30/07/2024	561
610.000	US Treasury, 2.25%, 15/11/2024	557
838.000	Canada Government Bond, 0.25%, 01/04/2024	537
540.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/03/2024	525
730.000	Australia Government Bond, 4.75%, 21/04/2027	469
475.000	France Government Bond OAT, 1.00%, 25/05/2027	446
67.300.000	Japan Government Ten Year Bond, 0.60%, 20/06/2024	431
3.400.000	China Government Bond, 1.99%, 09/04/2025	429
64.500.000	Japan Government Two Year Bond, 0.01%, 01/08/2024	415
450.000	Spain Government Bond, 0.80%, 30/07/2027	414
431.000	US Treasury, 2.13%, 31/03/2024	386
406.000	Belgium Government Bond, 0.80%, 22/06/2028	372
545.270.000	Korea Treasury Bond, 2.13%, 10/03/2024	370
410.000	US Treasury, 2.50%, 30/04/2024	363
370.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/03/2024	361
537.000	Canada Government Bond, 1.50%, 01/04/2025	353
410.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/11/2029	346
626.000	New Zealand Government Bond, 0.50%, 15/05/2024	338
522.000	Canada Government Bond, 2.00%, 01/06/2028	336
300.000	France Government Bond OAT, 3.50%, 25/04/2026	323
311.000	Finland Government Bond, 0.00%, 15/09/2023	307
310.000	Bundesschatzanweisungen, 2.20%, 12/12/2024	307
320.000	Bundesobligation, 1.30%, 15/10/2027	304
505.000	Australia Government Bond, 2.75%, 21/11/2028	300

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI (continua)

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Vendite (continua)		Ricavi
Quantità	Investimenti	Migliaia di EUR
260.000	UK Treasury, 5.00%, 07/03/2025	300

La CBI richiede un prospetto delle variazioni sostanziali nella composizione del portafoglio durante il periodo finanziario. Con tali variazioni si intendono gli acquisti totali di un titolo che eccedano l'1% del valore complessivo degli acquisti per il periodo finanziario e le vendite totali superiori all'1% del valore complessivo delle vendite. Devono essere riportate come minimo le voci relative ai 20 acquisti e alle 20 vendite principali oppure tutti gli acquisti e le vendite se inferiori a 20. È possibile richiedere gratuitamente all'Agente Amministrativo l'elenco completo delle variazioni di portafoglio per il periodo finanziario.

BLACKROCK DIVERSIFYING FIXED INCOME FUND

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Acquisti		
Quantità	Investimenti	Costo Migliaia di EUR
5.410	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0)	541
46.021	iShares J.P. Morgan \$ EM Corp Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	202
1.907	iShares € High Yield Corp Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	172

Vendite		
Quantità	Investimenti	Ricavi Migliaia di EUR
1.343	BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe Z EUR Hedged Accumulating	135
1.352	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0)	135
589	iShares € Inflation Linked Govt Bond UCITS ETF - EUR (Acc) Share Class	132

La CBI richiede un prospetto delle variazioni sostanziali nella composizione del portafoglio durante il periodo finanziario. Con tali variazioni si intendono gli acquisti totali di un titolo che eccedano l'1% del valore complessivo degli acquisti per il periodo finanziario e le vendite totali superiori all'1% del valore complessivo delle vendite. Devono essere riportate come minimo le voci relative ai 20 acquisti e alle 20 vendite principali oppure tutti gli acquisti e le vendite se inferiori a 20. È possibile richiedere gratuitamente all'Agente Amministrativo l'elenco completo delle variazioni di portafoglio per il periodo finanziario.

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Acquisti		
Quantità	Investimenti	Costo Migliaia di USD
18.711.000	US Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023	18.656
18.146.700	US Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023	18.075
17.720.300	US Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023	17.645
16.776.000	US Treasury Bill, 0.00%, 08/08/2023	16.709
14.450.000	US Treasury Bill, 0.00%, 03/10/2023	14.391
13.637.400	US Treasury Bill, 0.00%, 05/09/2023	13.582
238.735	JD.com, Inc. 'A'	5.532
16.800	Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'	4.146
101.326	Larsen & Toubro Ltd.	3.022
2.390	Samsung Electronics Co. Ltd. GDR	3.019
237.800	ANTA Sports Products Ltd.	2.863
29.047	Bajaj Finance Ltd.	2.576
159.362	IndusInd Bank Ltd.	2.358
53.600	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd	2.336
1.635.400	Xiaomi Corp. 'B'	2.334
2.450.800	Public Bank Bhd.	2.184
3.781.600	BOE Technology Group Co. Ltd. 'A'	2.131
184.819	ICICI Bank Ltd.	2.118
49.132	Genpact Ltd.	2.100
204.800	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co., Ltd.	2.039

Vendite		
Quantità	Investimenti	Ricavi Migliaia di USD
195.285	JD.com, Inc. 'A'	4.989
4.188.300	US Treasury Bill, 0.00%, 03/10/2023	4.186
3.861.400	US Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023	3.859
12.500	Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'	3.080
774.372	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	3.029
7.540.200	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk. PT	2.627
658.779	FirstRand Ltd.	2.537
158.156	Infosys Ltd.	2.487
83.894	Anglo American plc	2.480
5.948.100	Bank Mandiri Persero Tbk. PT	2.198
2.200.000	US Treasury Bill, 0.00%, 08/08/2023	2.194
261.000	Chroma ATE Inc.	2.156
101.990	Cummins India Ltd.	2.125
55.300	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd	2.097
124.376	IndusInd Bank Ltd.	2.047
1.158.400	Ping An Bank Co. Ltd.	2.044
66.920	Contemporary Ampere Technology Co. Ltd.	2.025
85.248	ICICI Bank Ltd. ADR	1.992
65.000	BYD Co. Ltd.	1.985
487.000	BYD Electronic International Co. Ltd.	1.973

La CBI richiede un prospetto delle variazioni sostanziali nella composizione del portafoglio durante il periodo finanziario. Con tali variazioni si intendono gli acquisti totali di un titolo che eccedano l'1% del valore complessivo degli acquisti per il periodo finanziario e le vendite totali superiori all'1% del valore complessivo delle vendite. Devono essere riportate come minimo le voci relative ai 20 acquisti e alle 20 vendite principali oppure tutti gli acquisti e le vendite se inferiori a 20. È possibile richiedere gratuitamente all'Agente Amministrativo l'elenco completo delle variazioni di portafoglio per il periodo finanziario.

BLACKROCK GLOBAL EQUITY SELECTION FUND

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Acquisti		
Quantità	Investimenti	Costo Migliaia di EUR
82.546	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	609
2.813	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating	412
15.662	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD	361
13.466	BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Opportunities Fund - Classe X2 USD	161
3.060	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Classe X2 EUR	149
899	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Classe X EUR Accumulating	133
10.037	iShares Core FTSE 100 UCITS ETF - Classe di Azioni GBP (Acc)	86
984	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Classe X2 USD	74
Vendite		
Quantità	Investimenti	Ricavi Migliaia di EUR
33.495	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Classe X2 USD	625
107.150	iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	619
4.459	BlackRock Global Funds - Systematic Global SmallCap Fund	613
52.729	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	382
6.579	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Classe X2 EUR	330
1.733	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating	269
1.738	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Classe X EUR Accumulating	251
31.445	iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc)	241
11.585	BlackRock Global Funds - European Special Situations Fund - Classe X2 EUR	215
1.144	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Classe X2 EUR	203
17.842	iShares Core FTSE 100 UCITS ETF - Classe di Azioni GBP (Acc)	157
4.844	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD	112
756	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating	110
2.656	BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Classe X2 EUR	81
13.607	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	79
11.501	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	56
384	BlackRock Global Funds - US Basic Value Fund - Classe X2 USD	53
3.565	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR	52
499	BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Classe X2 USD	41
408	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Classe X2 USD	30

La CBI richiede un prospetto delle variazioni sostanziali nella composizione del portafoglio durante il periodo finanziario. Con tali variazioni si intendono gli acquisti totali di un titolo che eccedano l'1% del valore complessivo degli acquisti per il periodo finanziario e le vendite totali superiori all'1% del valore complessivo delle vendite. Devono essere riportate come minimo le voci relative ai 20 acquisti e alle 20 vendite principali oppure tutti gli acquisti e le vendite se inferiori a 20. È possibile richiedere gratuitamente all'Agente Amministrativo l'elenco completo delle variazioni di portafoglio per il periodo finanziario.

BLACKROCK MULTI ASSET BALANCED SELECTION FUND

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Acquisti		
Quantità	Investimenti	Costo Migliaia di EUR
143.486	iShares Core UK Gilts UCITS ETF	690
72.204	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD Hedged	688
3.481	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	569
73.075	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	539
103.102	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	536
4.465	iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	519
43.744	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe X2 USD	438
8.598	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD	198
1.156	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating	170
24.223	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 EUR	162
1.289	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Classe X2 USD	96
1.231	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Classe X2 EUR	62
283	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Classe X EUR Accumulating	42
2.359	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	13
Vendite		
Quantità	Investimenti	Ricavi Migliaia di EUR
428.268	iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	2.150
118.534	iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	686
76.208	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	388
28.885	BlackRock Global Funds - European High Yield Bond Fund	367
2.750	BlackRock Strategic Funds – Emerging Markets Equity Strategies Fund	322
6.357	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Classe X2 EUR	314
13.374	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Classe X2 USD	254
1.592	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Classe X EUR Accumulating	231
18.655	iShares UK Index Fund (IE)	224
1.264	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Classe X2 EUR	222
	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	211
2.055		
1.341	BlackRock Global Funds - Systematic Global SmallCap Fund	184
1.028	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating	148
1.521	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR	141
1.514	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 EUR	139
842	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating	132
528	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	84
3.554	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD	82
2.385	BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Classe X2 EUR	72
16.367	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	68

La CBI richiede un prospetto delle variazioni sostanziali nella composizione del portafoglio durante il periodo finanziario. Con tali variazioni si intendono gli acquisti totali di un titolo che eccedano l'1% del valore complessivo degli acquisti per il periodo finanziario e le vendite totali superiori all'1% del valore complessivo delle vendite. Devono essere riportate come minimo le voci relative ai 20 acquisti e alle 20 vendite principali oppure tutti gli acquisti e le vendite se inferiori a 20. È possibile richiedere gratuitamente all'Agente Amministrativo l'elenco completo delle variazioni di portafoglio per il periodo finanziario.

BLACKROCK MULTI ASSET CONSERVATIVE SELECTION FUND

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Acquisti		
Quantità	Investimenti	Costo Migliaia di EUR
28.112	Blackrock Funds I ICAV - BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund - Classe X USD Accumulating	2.607
10.964	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	1.789
370.155	iShares Core UK Gilts UCITS ETF	1.780
218.910	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	1.618
13.193	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	1.473
249.668	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	1.298
124.100	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR	1.232
112.947	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe X2 USD	1.131
207.101	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	1.088
117.685	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 EUR	787
73.081	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD Hedged	696
97.512	iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	460
2.746	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating	403
14.486	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD	334
2.465	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Classe X2 USD	184
Vendite		
Quantità	Investimenti	Ricavi Migliaia di EUR
892.489	iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	4.485
18.647	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Classe X2 USD	2.650
22.818	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Classe X2 EUR	2.442
242.127	iShares Edge MSCI USA Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	1.511
14.034	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	1.440
73.356	BlackRock Global Funds - European High Yield Bond Fund	932
178.300	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	907
6.713	BlackRock Strategic Funds - Emerging Markets Equity Strategies Fund	785
56.140	iShares Core FTSE 100 UCITS ETF - Classe di Azioni GBP (Acc)	493
3.044	BlackRock Global Funds - Systematic Global SmallCap Fund	419
2.832	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR	400
3.523	Blackrock Funds I ICAV - BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund - Classe X USD Accumulating	340
46.711	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	338
13.453	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Classe X2 USD	262
2.016	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	236
8.212	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD	186
43.406	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	177
2.091	BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Classe X2 USD	170
903	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating	132
4.036	BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Classe X2 EUR	127

La CBI richiede un prospetto delle variazioni sostanziali nella composizione del portafoglio durante il periodo finanziario. Con tali variazioni si intendono gli acquisti totali di un titolo che eccedano l'1% del valore complessivo degli acquisti per il periodo finanziario e le vendite totali superiori all'1% del valore complessivo delle vendite. Devono essere riportate come minimo le voci relative ai 20 acquisti e alle 20 vendite principali oppure tutti gli acquisti e le vendite se inferiori a 20. È possibile richiedere gratuitamente all'Agente Amministrativo l'elenco completo delle variazioni di portafoglio per il periodo finanziario.

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Acquisti		
Quantità	Investimenti	Costo Migliaia di USD
2.081.500	US Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023	2.075
2.004.300	US Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023	1.996
1.697.700	US Treasury Bill, 0.00%, 25/01/2024	1.647
1.650.000	US Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2023	1.638
1.669.400	US Treasury Bill, 0.00%, 09/11/2023	1.633
1.650.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/09/2023	1.629
1.650.000	US Treasury Bill, 0.00%, 12/10/2023	1.620
1.600.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/12/2023	1.559
1.521.700	US Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2023	1.517
10.812	JD.com, Inc. 'A'	261
211.000	China Construction Bank Corp. 'H'	141
812	NAVER Corp.	121
109.000	Compal Electronics, Inc.	91
8.800	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co., Ltd.	89
17.413	Gerdau SA, Preference	87
44.000	Tung Ho Steel Enterprise Corp.	81
5.145	Gold Fields Ltd. ADR	80
21.000	Quanta Computer, Inc.	79
300	Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'	75
2.151	Kolon Industries, Inc.	70

Vendite		
Quantità	Investimenti	Ricavi Migliaia di USD
1.697.700	US Treasury Bill, 0.00%, 25/01/2024	1.648
1.650.000	US Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2023	1.642
1.669.400	US Treasury Bill, 0.00%, 09/11/2023	1.637
1.650.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/09/2023	1.633
1.650.000	US Treasury Bill, 0.00%, 12/10/2023	1.625
1.600.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/12/2023	1.563
1.521.700	US Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2023	1.520
46.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	843
13.900	Tencent Holdings Ltd.	595
8.551	Samsung Electronics Co. Ltd.	465
19.074	JD.com, Inc. 'A'	416
36.740	Alibaba Group Holding Ltd.	395
263.000	China Construction Bank Corp. 'H'	171
459.100	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk. PT	162
24.000	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H'	161
8.495	NetEase, Inc.	152
248.300	Bank Central Asia Tbk. PT	152
1.459	Dino Polska SA	150
6.000	MediaTek, Inc.	150
501	POSCO Holdings, Inc.	149

La CBI richiede un prospetto delle variazioni sostanziali nella composizione del portafoglio durante il periodo finanziario. Con tali variazioni si intendono gli acquisti totali di un titolo che eccedano l'1% del valore complessivo degli acquisti per il periodo finanziario e le vendite totali superiori all'1% del valore complessivo delle vendite. Devono essere riportate come minimo le voci relative ai 20 acquisti e alle 20 vendite principali oppure tutti gli acquisti e le vendite se inferiori a 20. È possibile richiedere gratuitamente all'Agente Amministrativo l'elenco completo delle variazioni di portafoglio per il periodo finanziario.

FR MULTI-ASSET FUND

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Acquisti		
Quantità	Investimenti	Costo Migliaia di EUR
65.607	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	7.350
50.587	BlackRock Funds I ICAV - BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund - Classe X USD Accumulating	4.830
347.512	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR	3.440
460.193	iShares MSCI World ESG Enhanced UCITS ETF - A	2.985
425.931	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	2.972
580.064	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	2.503
302.028	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	1.305
8.423	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating	1.294
339.811	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	1.210
294.164	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	1.203
65.312	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR	900
165.374	iShares MSCI USA Value Factor ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	712
6.835	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	709
93.882	iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF - A	604
5.266	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Real Asset Securities Fund - Classe X2 USD	601
5.782	BlackRock Sustainable Equity Factor Plus Fund - Classe X EUR Accumulating	600
107.604	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	595
4.046	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating	594
3.324	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR	465

Vendite		
Quantità	Investimenti	Ricavi Migliaia di EUR
50.485	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Real Asset Securities Fund - Classe X2 USD	5.759
774.553	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	5.516
30.242	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating	4.662
30.368	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Classe X2 USD	4.348
735.845	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	3.162
28.828	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	2.950
18.346	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating	2.659
22.447	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Classe X2 EUR	2.430
19.184	BlackRock Sustainable Equity Factor Plus Fund - Classe X EUR Accumulating	2.000
124.482	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR	1.800
434.963	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	1.793
384.385	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	1.401
285.944	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	1.240
212.110	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	1.195
8.299	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR	1.170
177.067	iShares MSCI USA Value Factor ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	800
98.401	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe di Azioni X2 EUR Hedged	800
80.890	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR	800
3.207	BlackRock Global Funds - European Fund - Classe X2 EUR	700
6.811	BlackRock Funds I ICAV - BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund - Classe X USD Accumulating	654
130.463	iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	602
5.323	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	600
3.386	iShares € Govt Bond 15-30yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	600
113.928	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	599
62.154	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 USD	599

FR MULTI-ASSET FUND

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI (continua)

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Vendite (continua)		
Quantità	Investimenti	Ricavi Migliaia di EUR
91.855	iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF - A	599

La CBI richiede un prospetto delle variazioni sostanziali nella composizione del portafoglio durante il periodo finanziario. Con tali variazioni si intendono gli acquisti totali di un titolo che eccedano l'1% del valore complessivo degli acquisti per il periodo finanziario e le vendite totali superiori all'1% del valore complessivo delle vendite. Devono essere riportate come minimo le voci relative ai 20 acquisti e alle 20 vendite principali oppure tutti gli acquisti e le vendite se inferiori a 20. È possibile richiedere gratuitamente all'Agente Amministrativo l'elenco completo delle variazioni di portafoglio per il periodo finanziario.

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023

Acquisti		Costo
Quantità	Investimenti	Migliaia di EUR
42.840.000	European Union Bill, 0.00%, 04/08/2023	42.659
42.490.000	German Treasury Bill, 0.00%, 19/07/2023	42.377
42.040.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 19/07/2023	41.923
34.490.000	Belgium Treasury Bill, 0.00%, 13/07/2023	34.398
322.101	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0)	32.154
31.040.000	Netherland Treasury Bill, 0.00%, 28/07/2023	30.972
22.400.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 03/08/2023	22.282
7.000.000	RWE AG, 2.13%, 24/05/2026	6.625
7.400.000	Enel Finance International NV, 0.00%, 28/05/2026	6.604
7.200.000	Credit Suisse AG, 1.50%, 10/04/2026	6.603
7.000.000	British Telecommunications plc, 1.75%, 10/03/2026	6.600
6.700.000	BPCE SA, 3.63%, 17/04/2026	6.592
7.400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.01%, 11/05/2026	6.576
7.000.000	Wells Fargo & Co., 2.00%, 27/04/2026	6.562
6.800.000	Banco Santander SA, 3.25%, 04/04/2026	6.557
6.850.000	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 2.38%, 09/04/2026	6.533
7.000.000	Credit Mutuel Arkea SA, 1.63%, 15/04/2026	6.515
6.500.000	Westpac Banking Corp., 3.70%, 16/01/2026	6.415
7.000.000	NatWest Markets plc, 0.13%, 18/06/2026	6.182
5.800.000	A2A SpA, 2.50%, 15/06/2026	5.534
5.800.000	Citigroup, Inc., 2.13%, 10/09/2026	5.462
5.500.000	ABN AMRO Bank NV, 3.63%, 10/01/2026	5.433
5.800.000	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.63%, 27/07/2026	5.409
5.700.000	National Grid North America, Inc., 0.41%, 20/01/2026	5.189
5.200.000	Sika Capital BV, 3.75%, 03/11/2026	5.158
5.000.000	Fresenius SE & Co. KGaA, 4.25%, 28/05/2026	4.971
5.300.000	Autostrade per l'Italia SpA, 1.75%, 26/06/2026	4.951
5.500.000	ASTM SpA, 1.00%, 25/11/2026	4.898

Vendite		Ricavi
Quantità	Investimenti	Migliaia di EUR
42.840.000	European Union Bill, 0.00%, 04/08/2023	42.750
42.490.000	German Treasury Bill, 0.00%, 19/07/2023	42.464
42.040.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 19/07/2023	42.014
316.507	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0)	31.619
31.040.000	Netherland Treasury Bill, 0.00%, 28/07/2023	30.997
22.400.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 03/08/2023	22.356
300.000	National Grid plc, 2.18%, 30/06/2026	287

La CBI richiede un prospetto delle variazioni sostanziali nella composizione del portafoglio durante il periodo finanziario. Con tali variazioni si intendono gli acquisti totali di un titolo che eccedano l'1% del valore complessivo degli acquisti per il periodo finanziario e le vendite totali superiori all'1% del valore complessivo delle vendite. Devono essere riportate come minimo le voci relative ai 20 acquisti e alle 20 vendite principali oppure tutti gli acquisti e le vendite se inferiori a 20. È possibile richiedere gratuitamente all'Agente Amministrativo l'elenco completo delle variazioni di portafoglio per il periodo finanziario.

BLACKROCK UCITS FUNDS

INFORMAZIONI PER GLI INVESTITORI IN SVIZZERA

La tabella seguente sintetizza la performance per anno civile del Fondo registrato per la distribuzione in Svizzera.

Ulteriori informazioni su questi parametri e metodologie di calcolo della performance in uso sono dettagliate nella sezione Sintesi della performance contenuta nella Relazione del Gestore degli investimenti. La valuta di ogni classe è indicata nella nota al bilancio relativa al Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili.

Nome del Fondo	Data di lancio	2022		2021		2020	
		Rendimento del Fondo %	Rendimento del benchmark %	Rendimento del Fondo %	Rendimento del benchmark %	Rendimento del Fondo %	Rendimento del benchmark %
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund - Classe D ad accumulazione	25 maggio 2017	(6,60)	(0,32)	0,57	(0,55)	0,55	(0,39)

Le performance passate non sono indicative dei rendimenti futuri e non dovrebbero costituire l'unico fattore da tenere presente nella selezione di un prodotto. Tutti gli investimenti finanziari comportano un elemento di rischio. Pertanto, il valore dell'investimento e il reddito generato varieranno e non può essere garantita la restituzione dell'importo dell'investimento iniziale. I dati sulle performance non tengono in considerazione le spese e le commissioni che possono essere imposte al momento della sottoscrizione o del rimborso di quote. I livelli e le basi imponibili possono variare di volta in volta.

BLACKROCK UCITS FUNDS

INFORMAZIONI PER GLI INVESTITORI IN SVIZZERA (continua)

La tabella seguente riporta il TER per ogni classe di quote per il periodo di dodici mesi chiuso il 30 settembre 2023:

Nome del Fondo	Classe del Fondo	TER (%)
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Classe D ad accumulazione	0,24
	Classe D coperta ad accumulazione in CHF	0,24
	Classe D a distribuzione	0,24
	Classe Z ad accumulazione	0,19
	Classe Z coperta ad accumulazione in CHF	0,19
	Classe di quote ad accumulazione flessibile	0,03

TRANSAZIONI CON PERSONE CONNESSE

In conformità ai requisiti della CBI, il Gestore assicurerà che eventuali transazioni eseguite tra ciascun fondo e il Gestore o Fiduciario per il Fondo, i delegati o i subdelegati del Gestore o Fiduciario (escluso qualsiasi subdepositario della società esterno al gruppo nominato da un Fiduciario) e qualsiasi società associata o appartenente al gruppo del Gestore, Fiduciario, delegato o subdelegato ("Persone connesse") debbano svolgersi alle normali condizioni commerciali e nel migliore interesse dei sottoscrittori.

Gli Amministratori hanno verificato la sussistenza di accordi, come comprovato da procedure scritte, al fine di assicurare che gli obblighi stabiliti in precedenza siano applicati a tutte le transazioni con Persone connesse e che le transazioni con le Persone connesse perfezionate durante il periodo siano conformi a tale obbligo.

ACCORDI DI SOFT COMMISSION

Il Gestore degli Investimenti non ha perfezionato alcun accordo di soft commission per conto del Fondo durante il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2023.

BLACKROCK UCITS FUNDS

GESTIONE EFFICIENTE DEL PORTAFOGLIO E OPERAZIONI DI FINANZIAMENTO TRAMITE TITOLI

Tecniche di gestione efficiente del portafoglio

Gli Amministratori possono, per conto di ciascun Fondo e fatte salve le condizioni ed entro i limiti stabiliti dalla CBI e dal prospetto, ricorrere a tecniche e strumenti relativi ai valori mobiliari, compresi gli investimenti in SFD OTC a condizione che tali tecniche e strumenti siano utilizzati a fini di gestione efficiente del portafoglio o per fornire protezione dal rischio di cambio o per fini d'investimento diretto, se del caso.

L'esposizione sottostante ottenuta attraverso SFD e l'identità delle controparti di tali SFD alla fine del periodo finanziario sono indicate nel prospetto degli investimenti del Fondo di riferimento.

Prestito di titoli

Tutte le operazioni di prestito titoli stipulate da ogni Fondo sono soggette a un contratto legale scritto stipulato tra il Fondo e l'agente per il prestito titoli, BlackRock Advisors (UK) Limited, una parte correlata all'Entità, e separatamente tra l'agente per il prestito titoli e la controparte approvata che prende i titoli a prestito. La garanzia ricevuta in cambio di titoli concessi in prestito viene trasferita ai sensi dell'accordo di trasferimento titoli. La garanzia ricevuta viene trasmessa e detenuta in un conto a nome del Fiduciario per conto di ogni Fondo. La garanzia ricevuta è separata dalle attività appartenenti al Fiduciario di ogni Fondo o all'agente per il prestito.

La tabella sotto riportata illustra il valore dei titoli in prestito, in proporzione alle attività totali di ogni Fondo che possono essere prestate e in proporzione al NAV del Fondo, al 30 settembre 2023. Gli attivi totali che possono essere prestati rappresentano il valore aggregato degli attivi che costituiscono parte del programma di prestito di titoli di un Fondo. Ciò esclude ogni attivo detenuto dal Fondo che non sia considerato prestabile per via di limitazioni di mercato, normative, agli investimenti o di altro tipo.

		% delle attività prestabili	% del NAV
BlackRock UK Credit Screened Fund	GBP	10,31	10,09
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	EUR	16,56	16,32
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	EUR	10,52	8,67
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	4,53	2,11
BlackRock Global Equity Selection Fund	EUR	0,80	0,26
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	EUR	5,48	1,81
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	EUR	2,79	1,20
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026	EUR	2,56	1,95

Il reddito realizzato durante il periodo dai Fondi a partire dalle operazioni di prestito titoli è comunicato nelle note al bilancio del Fondo.

Il reddito totale conseguito dalle operazioni di prestito titoli è suddiviso tra il Fondo in questione e l'Agente per il prestito titoli. Ogni Fondo riceve almeno il 62,5%, mentre l'agente per il prestito titoli riceve fino al 37,5% di tale reddito e tutti i costi operativi sono sostenuti a valere sulla quota dell'agente per il prestito titoli.

La tabella seguente illustra il valore dei titoli in prestito (singolarmente identificati nei prospetti degli Investimenti del Fondo di appartenenza), analizzati dalla controparte al 30 settembre 2023.

Controparte	Paese di costituzione della controparte	Valore dei titoli dati in prestito	Valore della garanzia ricevuta
BlackRock UK Credit Screened Fund		Migliaia di GBP	Migliaia di GBP
Morgan Stanley & Co. International	Regno Unito	4.283	4.525
Barclays Bank plc	Regno Unito	1.937	2.032
J.P. Morgan Securities plc	Regno Unito	1.498	1.865
Deutsche Bank AG	Germania	738	795
Goldman Sachs International	Regno Unito	731	769
RBC Europe Ltd.	Regno Unito	548	569
BNP Paribas	Francia	260	278
UBS AG	Svizzera	80	85
Totale		10.075	10.918
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund		Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Goldman Sachs International	Regno Unito	5.560	5.829
Barclays Bank plc	Regno Unito	1.964	2.060
J.P. Morgan Securities plc	Regno Unito	1.810	2.219
Deutsche Bank AG	Germania	1.256	1.348
Merrill Lynch International	Regno Unito	550	604
UBS AG	Svizzera	550	581
BNP Paribas	Francia	379	406
Citigroup Global Markets Ltd.	Regno Unito	180	202

BLACKROCK UCITS FUNDS

GESTIONE EFFICIENTE DEL PORTAFOGLIO E OPERAZIONI DI FINANZIAMENTO TRAMITE TITOLI (continua)

Prestito di titoli (continua)

Controparte	Paese di costituzione della controparte	Valore dei titoli dati in prestito	Valore della garanzia ricevuta
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund (continua)		Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Morgan Stanley & Co. International	Regno Unito	65	68
Totale		12.314	13.317
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund		Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
J.P. Morgan Securities plc	Regno Unito	2.673	3.306
Societe Generale	Francia	2.337	2.407
BNP Paribas	Francia	1.311	1.362
Citigroup Global Markets Ltd.	Regno Unito	1.009	1.085
The Bank of Nova Scotia	Canada	561	618
Morgan Stanley & Co. International	Regno Unito	257	264
Totale		8.148	9.042
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund		Migliaia di USD	Migliaia di USD
UBS AG	Svizzera	1.953	2.094
Goldman Sachs International	Regno Unito	1.406	1.709
J.P. Morgan Securities plc	Regno Unito	1.386	1.871
Societe Generale	Francia	161	172
Totale		4.906	5.846
BlackRock Global Equity Selection Fund		Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Morgan Stanley & Co. International	Regno Unito	72	77
Totale		72	77
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund		Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Goldman Sachs International	Regno Unito	589	712
Totale		589	712
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Goldman Sachs International	Regno Unito	1.052	1.266
Totale		1.052	1.266
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026		Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
BNP Paribas	Francia	4.358	4.645
Totale		4.358	4.645

Tutti i titoli in prestito hanno una scadenza aperta in quanto sono richiamabili o estinguibili giornalmente.

Total return swap (CFD compresi)

Ogni Fondo perfeziona Total return swap (compresi i CFD) ai sensi di un Accordo Quadro ISDA o contratto simile. Un Accordo Quadro ISDA è un accordo bilaterale tra il Fondo e una controparte che disciplina gli SFD OTC (compresi i total return swap e i CFD) stipulati tra le parti. Ai sensi dell'Accordo Quadro ISDA le esposizioni delle parti vengono compensate e date in garanzia congiuntamente; di conseguenza qualsiasi comunicazione su garanzie fornite riguarda tutti gli SFD OTC stipulati da parte del Fondo secondo l'Accordo Quadro ISDA, non solo i total return swap e i CFD.

Tutta la garanzia ricevuta/contabilizzata da ogni Fondo ai sensi dell'Accordo Quadro ISDA viene trasferita in modo bilaterale ai sensi dell'accordo di trasferimento titoli.

La tabella sotto riportata illustra il valore dei total return swap (compresi i CFD) in proporzione al NAV del Fondo al 30 settembre 2023 e il reddito/rendimento ottenuto nel periodo chiuso il 30 settembre 2023. Il valore dei total return swap (compresi i CFD) è basato sul valore dell'esposizione sottostante su base lorda assoluta.

		% del NAV	Rendimenti totali conseguiti in migliaia
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	5,93	124
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	USD	–	59

I rendimenti totali ottenuti dai total return swap (compresi i CFD) sono presentati in termini di rendimento totale, comprensivo dei relativi interessi e dividendi attivi o passivi e dei profitti/perdite netti generati dai movimenti dei prezzi al valore equo. Tutti i rendimenti e i costi generati dai total return swap (compresi i CFD) matureranno in ogni Fondo e non sono soggetti ad alcun accordo di divisione dei rendimenti o dei costi con il Gestore del Fondo o alcuna parte terza.

BLACKROCK UCITS FUNDS

GESTIONE EFFICIENTE DEL PORTAFOGLIO E OPERAZIONI DI FINANZIAMENTO TRAMITE TITOLI (continua)

Total return swap (compresi i CFD) (continua)

La tabella seguente illustra il valore dell'esposizione sottostante per i total return swap (compresi i CFD), analizzati per controparte al 30 settembre 2023.

Controparte	Paese di costituzione della controparte	Esposizione sottostante Migliaia di USD
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund		
Merrill Lynch International	Regno Unito	6.415
HSBC Bank plc	Regno Unito	6.214
Goldman Sachs International	Regno Unito	1.170

La tabella seguente fornisce un'analisi della scadenza dei total return swap (compresi i CFD) al 30 settembre 2023.

Fondo	Valuta	Scadenza	
		Aperto Migliaia	Totale Migliaia
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	13.799	13.799

Tutti i CFD detenuti hanno una scadenza aperta in quanto sono richiamabili o estinguibili giornalmente.

Analisi della valuta della garanzia

La tabella seguente fornisce un'analisi per valuta della liquidità e della garanzia non liquida sottostante ricevuta da parte di ogni Fondo mediante un accordo di trasferimento del titolo, in relazione alle operazioni di prestito titoli e agli SFD OTC (compresi i CFD) al 30 settembre 2023.

Valuta	Garanzia liquida ricevuta Migliaia di GBP	Garanzia liquida depositata Migliaia di GBP	Garanzia non liquida ricevuta Migliaia di GBP
BlackRock UK Credit Screened Fund			
Operazioni di prestito titoli			
CAD	-	-	4
DKK	-	-	7
EUR	-	-	7.386
GBP	-	-	1.323
NOK	-	-	7
USD	-	-	2.191
Totale	-	-	10.918
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund			
Operazioni di prestito titoli			
CAD	-	-	8
DKK	-	-	45
EUR	-	-	8.370
GBP	-	-	1.528
NOK	-	-	4
SEK	-	-	1
USD	-	-	3.361
Totale	-	-	13.317
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund			
Operazioni di prestito titoli			
DKK	-	-	103
EUR	-	-	5.174
GBP	-	-	311
NOK	-	-	10
SEK	-	-	7
USD	-	-	3.437
Totale	-	-	9.042
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund			
Operazioni di prestito titoli			
CAD	-	-	388
EUR	-	-	519
GBP	-	-	368
JPY	-	-	5
USD	-	-	4.566
SFD OTC			
USD	-	381	-
Totale	-	381	5.846

BLACKROCK UCITS FUNDS

GESTIONE EFFICIENTE DEL PORTAFOGLIO E OPERAZIONI DI FINANZIAMENTO TRAMITE TITOLI (continua)

Analisi della valuta della garanzia (continua)

Valuta	Garanzia liquida ricevuta	Garanzia liquida depositata	Garanzia non liquida ricevuta
	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
BlackRock Global Equity Selection Fund			
Operazioni di prestito titoli			
EUR	-	-	42
GBP	-	-	14
USD	-	-	21
Totale	-	-	77
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund			
Operazioni di prestito titoli			
EUR	-	-	128
GBP	-	-	12
JPY	-	-	2
USD	-	-	570
Totale	-	-	712
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund			
Operazioni di prestito titoli			
EUR	-	-	229
GBP	-	-	21
JPY	-	-	3
USD	-	-	1.013
Totale	-	-	1.266
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026			
Operazioni di prestito titoli			
DKK	-	-	119
EUR	-	-	3.429
GBP	-	-	908
NOK	-	-	44
USD	-	-	145
Totale	-	-	4.645

BLACKROCK UCITS FUNDS

GESTIONE EFFICIENTE DEL PORTAFOGLIO E OPERAZIONI DI FINANZIAMENTO TRAMITE TITOLI (continua)

Analisi del tipo, della qualità e della scadenza della garanzia

La tabella seguente fornisce un'analisi per tipo, qualità e scadenza della garanzia non liquida ricevuta da ogni Fondo mediante clausole di garanzia con trasferimento del titolo di proprietà relativamente alle operazioni di prestito titoli al 30 settembre 2023.

Tipo e qualità della garanzia	Scadenza							Aperto	Totale
	1 giorno	2 - 7 giorni	8 - 30 giorni	31 - 90 giorni	91 - 365 giorni	Più di 365 giorni			
BlackRock UK Credit Screened Fund	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP
Garanzia ricevuta - prestito di titoli									
Reddito fisso									
Investment grade	–	22	13	4	1.146	9.494	–	–	10.679
Azioni									
Indice azionario riconosciuto	–	–	–	–	–	–	237	–	237
ETF									
OICVM	–	–	–	–	–	–	2	–	2
Totale	–	22	13	4	1.146	9.494	239	–	10.918
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Garanzia ricevuta - prestito di titoli									
Reddito fisso									
Investment grade	–	165	13	6	706	11.776	–	–	12.666
Azioni									
Indice azionario riconosciuto	–	–	–	–	–	–	637	–	637
ETF									
OICVM	–	–	–	–	–	–	14	–	14
Totale	–	165	13	6	706	11.776	651	–	13.317
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Garanzia ricevuta - prestito di titoli									
Reddito fisso									
Investment grade	–	–	21	575	1.141	5.095	–	–	6.832
Azioni									
Indice azionario riconosciuto	–	–	–	–	–	–	2.210	–	2.210
Totale	–	–	21	575	1.141	5.095	2.210	–	9.042
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD
Garanzia ricevuta - prestito di titoli									
Reddito fisso									
Investment grade	–	–	45	96	462	1.394	–	–	1.997
Azioni									
Indice azionario riconosciuto	–	–	–	–	–	–	3.475	–	3.475
ETF									
OICVM	–	–	–	–	–	–	34	–	34
Non OICVM	–	–	–	–	–	–	340	–	340
Totale	–	–	45	96	462	1.394	3.849	–	5.846
BlackRock Global Equity Selection Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Garanzia ricevuta - prestito di titoli									

BLACKROCK UCITS FUNDS

GESTIONE EFFICIENTE DEL PORTAFOGLIO E OPERAZIONI DI FINANZIAMENTO TRAMITE TITOLI (continua)

Analisi del tipo, della qualità e della scadenza della garanzia (continua)

Tipo e qualità della garanzia	Scadenza							Aperto	Totale
	1 giorno	2 - 7 giorni	8 - 30 giorni	31 - 90 giorni	91 - 365 giorni	Più di 365 giorni			
BlackRock Global Equity Selection Fund (continua)	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Reddito fisso									
Investment grade	-	-	-	-	14	55	-	-	69
Azioni									
Indice azionario riconosciuto	-	-	-	-	-	-	7	-	7
ETF									
Non OICVM	-	-	-	-	-	-	1	-	1
Totale	-	-	-	-	14	55	8	-	77
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Garanzia ricevuta - prestito di titoli									
Reddito fisso									
Investment grade	-	-	-	-	1	216	-	-	217
Azioni									
Indice azionario riconosciuto	-	-	-	-	-	-	339	-	339
ETF									
OICVM	-	-	-	-	-	-	14	-	14
Non OICVM	-	-	-	-	-	-	142	-	142
Totale	-	-	-	-	1	216	495	-	712
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Garanzia ricevuta - prestito di titoli									
Reddito fisso									
Investment grade	-	-	-	-	2	385	-	-	387
Azioni									
Indice azionario riconosciuto	-	-	-	-	-	-	602	-	602
ETF									
OICVM	-	-	-	-	-	-	25	-	25
Non OICVM	-	-	-	-	-	-	252	-	252
Totale	-	-	-	-	2	385	879	-	1.266
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Garanzia ricevuta - prestito di titoli									
Reddito fisso									
Investment grade	-	-	-	-	3	4.642	-	-	4.645
Totale	-	-	-	-	3	4.642	-	-	4.645

I titoli investment grade sono quelli emessi da un'entità che ha ricevuto un rating minimo di qualità investment grade da almeno una delle agenzie di rating riconosciute a livello mondiale: Standard & Poor's, Moody's o Fitch. Un indice riconosciuto contiene almeno 20 titoli, in cui nessun singolo titolo rappresenta più del 20% dell'indice totale e nessuna combinazione di cinque titoli rappresenta oltre il 60% dell'indice totale.

L'analisi della scadenza per i titoli a reddito fisso ricevuti o forniti in garanzia si basa sulla rispettiva data di scadenza contrattuale, mentre per azioni ed ETF ricevuti o forniti in garanzia è presentata sotto forma di operazioni aperte in quanto non soggette a scadenza contrattuale.

BLACKROCK UCITS FUNDS

GESTIONE EFFICIENTE DEL PORTAFOGLIO E OPERAZIONI DI FINANZIAMENTO TRAMITE TITOLI (continua)

Analisi del tipo, della qualità e della scadenza della garanzia (continua)

Tutta la liquidità ricevuta o depositata come garanzia ha una scadenza aperta, non essendo soggetta a una data di scadenza contrattuale.

Riutilizzo della garanzia ricevuta

La garanzia non liquida ricevuta mediante un accordo di garanzia di trasferimento titoli in merito al prestito titoli e SFD OTC non può essere venduta, re-investita o data in pegno.

Deposito a custodia della garanzia ricevuta

La tabella seguente fornisce un'analisi degli importi di garanzie non liquide ricevute da ogni Fondo in merito a operazioni di prestito titoli, e detenuti dal Fiduciario del Fondo (o da suoi delegati) o attraverso un sistema di regolamento titoli, al 30 settembre 2023.

Depositario	Garanzia non liquida ricevuta Prestito di titoli
BlackRock UK Credit Screened Fund	Migliaia di GBP
Euroclear	5.387
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	5.531
Totale	10.918
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Migliaia di EUR
Euroclear	6.783
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	6.534
Totale	13.317
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	Migliaia di EUR
Euroclear	6.564
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	2.478
Totale	9.042
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	Migliaia di USD
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	5.846
Totale	5.846
BlackRock Global Equity Selection Fund	Migliaia di EUR
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	77
Totale	77
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Migliaia di EUR
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	712
Totale	712
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	Migliaia di EUR
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	1.266
Totale	1.266
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026	Migliaia di EUR
Euroclear	4.645
Totale	4.645

Concentrazione della garanzia ricevuta

La tabella seguente elenca i dieci principali emittenti in termini di valore della garanzia non liquida ricevuta da ogni Fondo per mezzo di un accordo di garanzia di trasferimento del titolo attraverso operazioni di prestito titoli al 30 settembre 2023.

Emittente	Valore
BlackRock UK Credit Screened Fund	Migliaia di GBP
France Government	3.960
US Treasury	1.840
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.290
UK Treasury	1.278
Republic of Austria	829
Netherlands Government	710
Kingdom Of Belgium Government	191
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	177
Bundesobligation	131
Finland Government	122
Altri emittenti	390
Totale	10.918
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Migliaia di EUR
France Government	4.457
US Treasury	2.172
UK Treasury	1.523

BLACKROCK UCITS FUNDS

GESTIONE EFFICIENTE DEL PORTAFOGLIO E OPERAZIONI DI FINANZIAMENTO TRAMITE TITOLI (continua)

Concentrazione della garanzia ricevuta (continua)

Emittente	Valore
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund (continua)	Migliaia di EUR
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.425
Netherlands Government	1.197
Kingdom Of Belgium Government	427
Asian Development Bank	347
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	302
Finland Government	246
Bundesobligation	233
Altri emittenti	988
Totale	13.317
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	Migliaia di EUR
France Government	1.983
US Treasury	1.221
Kingdom Of Belgium Government	1.014
German Treasury	381
UK Treasury	309
Bundesobligation	302
Finland Government	291
Netherlands Government	273
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	259
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	219
Altri emittenti	2.790
Totale	9.042
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	Migliaia di USD
US Treasury	750
France Government	418
Canada Government	388
UK Treasury	340
Microsoft Corp	232
United Rentals Inc	160
Old Dominion Freight Line Inc	158
TAL Education Group	157
Banco Bradesco SA	157
Adyen NV	155
Altri emittenti	2.931
Totale	5.846
BlackRock Global Equity Selection Fund	Migliaia di EUR
France Government	15
UK Treasury	14
German Treasury	14
Netherlands Government	14
US Treasury	14
Chesapeake Energy Corp	4
Flutter Entertainment PLC	2
Totale	77
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Migliaia di EUR
France Government	125
US Treasury	89
TAL Education Group	65
Banco Bradesco SA	65
iShares MSCI ACWI ex US ETF	60
iShares S&P 500 Value ETF	37
Nitto Denko Corp	31
JOYY Inc	30
Vista Energy SAB de CV	29
Gerdau SA	24
Altri emittenti	157
Totale	712
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	Migliaia di EUR
France Government	221
US Treasury	158
TAL Education Group	116
Banco Bradesco SA	116
iShares MSCI ACWI ex US ETF	107
iShares S&P 500 Value ETF	65
Nitto Denko Corp	56
JOYY Inc	53

BLACKROCK UCITS FUNDS

GESTIONE EFFICIENTE DEL PORTAFOGLIO E OPERAZIONI DI FINANZIAMENTO TRAMITE TITOLI (continua)

Concentrazione della garanzia ricevuta (continua)

Emittente	Valore
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund (continua)	Migliaia di EUR
Vista Energy SAB de CV	52
Gerdau SA	43
Altri emittenti	279
Totale	1.266
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026	Migliaia di EUR
France Government	906
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	883
Netherlands Government	882
UK Treasury	882
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	882
Denmark Government	119
US Treasury	47
Norway Government	44
Totale	4.645

BLACKROCK UCITS FUNDS

DECLINAZIONE DI RESPONSABILITÀ

Declinazione di responsabilità per la citazione di indici di riferimento e dei siti web dei fornitori degli indici

Ai sensi dei requisiti della Banca centrale, il Gestore, per conto dei Comparti dell'Indice, deve fornire dettagli del sito web del pertinente fornitore dell'indice ("Sito web") per consentire ai Sottoscrittori di quote di ottenere ulteriori informazioni sull'Indice di riferimento del Fondo pertinente (inclusi i componenti dell'indice). Il Gestore non è in alcun modo responsabile dei diversi Siti web e non sponsorizza, avalla né partecipa in alcun modo alla costituzione o al funzionamento di ogni Sito web e dei relativi contenuti. Inoltre, il Gestore non è in alcun modo responsabile dell'Indice di riferimento del fornitore dell'indice né della qualità, della precisione e della completezza dei dati relativi ai suoi Indici di riferimento né del fatto che gli indici pubblicati saranno gestiti in linea con le loro metodologie degli indici descritte.

Declinazione di responsabilità del Fornitore dell'indice

Gli Indici di riferimento non sono gestiti e non consentono investimenti diretti. È vietato lo sviluppo o la creazione di qualsiasi prodotto che utilizzi, si basi su o venga sviluppato in relazione a qualsiasi indice Barclays (ognuno un "prodotto") senza il previo consenso scritto di Barclays Risk Analytics and Index Solutions ("BRAIS"). BRAIS non sponsorizza, avalla, vende o promuove tali Prodotti e non si assume alcuna responsabilità in merito all'opportunità di investire in uno qualsiasi di tali Prodotti.

Barclays non funge da consulente per gli investimenti né da fiduciaria. Questo Prospetto non costituisce una consulenza d'investimento personale e non tiene conto delle circostanze finanziarie personali né degli obiettivi di alcun investitore. Gli indici, i titoli, le materie prime, le valute, i derivati e altri prodotti finanziari discussi nel presente documento potrebbero non essere adeguati a tutti gli scopi o a tutti gli investitori. Di conseguenza i destinatari devono stabilire in modo indipendente, avvalendosi dei loro consulenti, se un indice o un investimento citato nel presente documento sia adeguato ai loro scopi.

I dati degli indici, i modelli quantitativi, gli strumenti analitici e ulteriori informazioni ("Contenuto") citati nel presente Prospetto vengono considerati affidabili da Barclays, che tuttavia non dichiara che il Contenuto (incluse le informazioni ottenute da fonti terze) sia preciso, completo o esente da errori e, in quanto tale, non deve essere preso a riferimento. Il Contenuto viene fornito esclusivamente a scopo informativo e viene reso disponibile "così com'è". Barclays non garantisce la precisione, la tempestività, l'affidabilità, le prestazioni, la continua disponibilità, la completezza o l'aggiornamento di qualsiasi Contenuto e Barclays non sarà in alcun modo responsabile di eventuali errori, omissioni o interruzioni relativi. Tutti i dati concernenti i risultati ottenuti nel passato, la creazione di modelli o l'analisi retrospettiva citati nel Contenuto non sono indicativi di rendimenti futuri. Non viene fornita alcuna dichiarazione sulla ragionevolezza delle ipotesi formulate nel presente documento, sull'esattezza o sulla completezza della creazione di modelli o dell'analisi retrospettiva. Non potendosi escludere errori umani o meccanici, nonché altri fattori, Barclays non accetta alcuna responsabilità per errori od omissioni nel Contenuto (incluso, a titolo di esempio, il calcolo o la performance di qualsiasi indice e/o del risultato di qualsiasi modello quantitativo o strumento analitico). Barclays non accetta alcuna responsabilità relativamente ad accuratezza, tempestività, affidabilità, prestazioni, disponibilità continua, completezza o attualità del Contenuto, né per ritardi o omissioni nel Contenuto stesso, o per interruzioni nella fornitura di qualsiasi Contenuto, o per qualsiasi danno speciale, punitivo, indiretto, accidentale o consequenziale derivante dall'uso o dall'affidabilità di qualsiasi contenuto, anche qualora informata della possibilità di tali danni.

I rendimenti degli indici costituiscono risultati ottenuti nel passato e non sono indicativi di alcun investimento specifico. Il Contenuto (incluso tutto l'output elaborato a partire da modelli o strumenti analitici) non si prefigge di prevedere i risultati effettivi, che possono divergere sensibilmente da quelli indicati. I rendimenti passati non costituiscono necessariamente un indicatore di quelli futuri.

Per ulteriori dettagli:

blackrockinternational.com | +44 (0)20 7743 3300

© 2023 BlackRock, Inc. Tutti i diritti riservati. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS e iSHARES sono marchi di proprietà di BlackRock, Inc. o delle sue consociate negli Stati Uniti e in altri paesi. Tutti gli altri marchi sono proprietà dei rispettivi proprietari.

BlackRock[®]

Elimina la carta. . .

È facile, economico ed ecologico!

Visita www.blackrock.com/edelivery

