

**BlackRock**<sup>®</sup>

# **Relazione semestrale e bilancio non certificato**

BlackRock UCITS Funds

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2022

# BLACKROCK UCITS FUNDS

INDICE	Pagina
<b>Panoramica</b>	
Informazioni di carattere generale	1
Informazioni sulla Società	3
<b>Performance</b>	
Relazione del Gestore degli Investimenti	5
<b>Bilancio</b>	
Conto economico sintetico	18
Prospetto sintetico delle variazioni del patrimonio netto	23
Prospetto sintetico delle variazioni del patrimonio netto attribuibili ai sottoscrittori di quote di partecipazione rimborsabili	25
Stato patrimoniale sintetico	28
Note al Bilancio	33
Prospetti degli investimenti	52
<b>Ulteriori informazioni e informativa ai sensi della legge</b>	
Prospetti degli acquisti e delle vendite principali	181
Informazioni per gli investitori in Svizzera	198
Transazioni con persone connesse	199
Accordi di soft commission	199
Gestione efficiente del portafoglio e operazioni di finanziamento titoli	200
Declinazione di responsabilità	209

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)<sup>1</sup>  
Graham Bamping (britannico)<sup>1</sup>  
Patrick Boylan (irlandese)<sup>2/3</sup>  
Michael Hodson (irlandese)<sup>1</sup>  
Enda McMahon (irlandese)<sup>2/3</sup>  
Justin Mealy (irlandese)<sup>2/3</sup>  
Adele Spillane (irlandese)<sup>2/3</sup>  
Catherine Woods (irlandese)

<sup>1</sup> Amministratore non esecutivo

<sup>2</sup> Amministratore esecutivo

<sup>3</sup> Dipendenti del Gruppo BlackRock

### Gestore

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

### Gestore della copertura valutaria<sup>4</sup>

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

Sanne 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 investimenti<sup>5</sup>

BlackRock Financial Management, Inc.  
40 East 52<sup>nd</sup> Street  
New York  
NY 10022  
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  
20 Anson Road, #18-01  
Singapore 079912  
Singapore

### Società di Revisione indipendente

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

### Consulente Legale

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

### Agente incaricato dei pagamenti in Italia

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

### Agente incaricato dei pagamenti in Svezia

BlackRock Investment Management (UK)  
Limited  
Filiale di Stoccolma  
Norrandsgatan 16  
111 43 Stockholm  
Svezia

### Agente incaricato dei pagamenti in Svizzera

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

### Rappresentante in Svizzera

BlackRock Asset Management Schweiz AG  
Bahnhofstrasse 39  
8001 Zürich  
Svizzera

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## INFORMAZIONI DI CARATTERE GENERALE (continua)

### Rappresentante in Danimarca

BlackRock, filiale di Copenhagen  
Harbour House  
Sundkrogsgade 21  
Copenhagen  
DK- 2100  
Danimarca

<sup>4</sup>Limitatamente alle classi di quote con copertura valutaria di alcuni Fondi.

<sup>5</sup>Limitatamente ad alcuni Fondi.

Per gli investitori svizzeri: Il prospetto dell'Entità, l'Atto Costitutivo, i Documenti contenenti le informazioni chiave per gli investitori ("KIID"), 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 Fixed Income Selection Fund, BlackRock Global Equity Selection Fund, BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund, BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund, BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund 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 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 con separazione delle passività 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 2022 l'Entità deteneva 14 Fondi operativi.

### Variazioni all'Entità durante il periodo finanziario

Il 22 aprile 2022 è stata emessa una linea di credito modificata per agevolare un aumento a USD 450.000.000 della linea di credito messa a disposizione da JPMorgan e dagli altri finanziatori sindacati.

Il 29 aprile 2022, Paul Freeman ha rassegnato le dimissioni da amministratore non esecutivo del gestore.

Il 1° maggio 2022, Rosemary Quinlan è stata nominata Amministratore non esecutivo del Gestore.

Il 4 maggio 2022 è stato pubblicato un prospetto aggiornato per l'Entità per agevolare le modifiche seguenti:

- Inserimento di FR Multi-Asset Fund.
- Nomina di Michael Hodson ed Eimear Martin in qualità di Amministratori non esecutivi del Gestore.
- Inserimento di classi di quote in BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund.
- Cambiamento post-fusione del Fiduciario da J.P. Morgan Bank (Ireland) plc a J.P. Morgan SE - Filiale di Dublino.

Il 31 maggio 2022, William Roberts ha rassegnato le dimissioni da Presidente e Amministratore non esecutivo del Gestore.

Il 1 giugno 2022, Rosemary Quinlan è stata nominata Presidente del Gestore e Graham Bamping è stato nominato Amministratore non esecutivo del Gestore.

Il 29 giugno 2022, gli Amministratori hanno deciso di chiudere BlackRock Fixed Income Selection Fund.

Il 30 giugno 2022, Eimear Martin ha rassegnato le dimissioni da Amministratore non esecutivo del Gestore.

Il 13 luglio 2022, FR Multi-Asset Fund ha iniziato le attività con il lancio della classe di quote Istituzionali ad Accumulazione coperte in USD.

Il 31 luglio 2022, Barry O'Dwyer si è dimesso da Amministratore esecutivo del Gestore.

Il 31 agosto 2022, BlackRock Diversified Strategies Selection Fund e BlackRock Euro Cash Fund sono stati completamente rimborsati.

Il 2 settembre 2022, sono state lanciate la classe di quote istituzionali coperte ad accumulazione in SEK e la classe di quote istituzionali ad accumulazione in EUR per il Fondo FR Multi-Asset.

### Diffusione del COVID-19

La diffusione del coronavirus ha avuto un profondo impatto su tutti gli aspetti della società negli ultimi anni. Sebbene nelle economie sviluppate vi sia un crescente consenso sull'avvenuto superamento della fase critica, è probabile che fattori quali restrizioni di viaggio, controlli sanitari più rigorosi nei porti d'ingresso e altrove, interruzioni e ritardi nella preparazione e fornitura di servizi sanitari, cancellazioni, strozzature dell'offerta e calo della domanda dei consumatori continueranno a rappresentare delle sfide. In molti paesi sono in atto campagne vaccinali che stanno generando effetti positivi e, tuttavia, l'impatto del Covid-19 continua a ripercuotersi sulle economie di molte nazioni del mondo, con conseguenze potenzialmente più pesanti nei luoghi in cui i tassi di vaccinazione sono più bassi, come in alcuni mercati emergenti. Nonostante sia difficile anticipare le tempistiche, prevedibilmente si continueranno ad avvertire gli effetti economici del Covid-19 anche dopo che il virus si sarà trasformato da pandemico a endemico; ciò, a sua volta, potrebbe continuare a incidere sugli investimenti detenuti dall'Entità.

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## INFORMAZIONI SULLA SOCIETÀ (continua)

### **Diffusione del COVID-19 (segue)**

Il Gestore ha valutato l'impatto delle condizioni di mercato conseguenti alla diffusione del COVID-19 sulla capacità dei Fondi di raggiungere i propri obiettivi di investimento. In base alle ultime informazioni disponibili, i Fondi continuano a essere gestiti in linea con i loro obiettivi di investimento, senza alcuna interruzione delle loro operazioni e della pubblicazione dei NAV.

### **Conflitto tra Russia e Ucraina**

Alcuni mercati finanziari hanno registrato un calo principalmente a causa delle tensioni geopolitiche derivanti dall'invasione dell'Ucraina da parte della Russia e dell'impatto della successiva serie di sanzioni, normative e altre misure che hanno ridotto la normale negoziazione di titoli russi. Il Gestore degli Investimenti continua a monitorare che la performance degli investimenti sia in linea con gli obiettivi d'investimento dei Fondi e che le attività operative dei Fondi e la pubblicazione del NAV proseguano.

# 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 Diversified Strategies Selection Fund**

L'obiettivo di investimento del Fondo è consistito nel cercare di fornire agli investitori un rendimento assoluto rispetto all'orizzonte di investimento stabilito con una correlazione limitata ai movimenti del mercato.

#### **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 nel mondo.

#### **BlackRock Diversifying Fixed Income Fund**

L'obiettivo d'investimento del Fondo consiste nel fornire agli investitori un reddito semestrale e 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**

#### **BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund**

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

#### **BlackRock Euro Cash Fund**

L'obiettivo di investimento del Fondo è consistito nell'investire il 100% delle proprie attività in BlackRock ICS Euro Liquidity Fund, un comparto di Institutional Cash Series plc.

#### **BlackRock Fixed Income 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 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.

#### **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 UCITS FUNDS

## RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

### Metodo di gestione degli investimenti

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

Nome del Fondo	Indice di riferimento/ 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 Diversified Strategies Selection Fund <sup>1/2</sup>	N/A	Attivo
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	Bloomberg Barclays Euro Aggregate Treasury Bond Index	Replica dell'Indice - non replicante
BlackRock UK Credit Screened Fund <sup>3</sup>	iBoxx Sterling Corporate ex Tier 1 and Upper Tier 2 with a 2% issuer cap	Attivo
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund <sup>3</sup>	3 Month EURIBOR Index	Attivo
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund <sup>3</sup>	Bloomberg Barclays Global Treasury Index (customised)	Attivo
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund <sup>3</sup>	3 Month EURIBOR Index	Attivo
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund <sup>3</sup>	MSCI Emerging Markets Index (Net)	Attivo
BlackRock Euro Cash Fund <sup>1/3</sup>	7-Day EUR LIBID	Gestione della liquidità
BlackRock Fixed Income Selection Fund <sup>2</sup>	N/A	Attivo
BlackRock Global Equity Selection Fund <sup>3</sup>	50% MSCI Europe Index and 50% MSCI All Country World ex Europe Index	Attivo
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund <sup>2</sup>	N/A	Attivo
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund <sup>2</sup>	N/A	Attivo
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund <sup>3</sup>	MSCI EM ex Fossil Fuels Index	Attivo
FR Multi-Asset Fund <sup>4</sup>	50% MSCI All Country World and 50% Bloomberg Global Aggregate Index	Attivo

<sup>1</sup> Il Fondo è stato chiuso il 31 agosto 2022.

<sup>2</sup> Per questo Fondo non sono calcolati i parametri della performance.

<sup>3</sup> 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.

<sup>4</sup> Il Fondo è stato lanciato il 14 luglio 2022.

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.

### 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 2022. Specifica inoltre il tracking error previsto del Fondo che replica l'indice (comunicato nel prospetto su base ex ante) con il tracking error effettivamente realizzato del Fondo al 30 settembre 2022.

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 ("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.



# BLACKROCK UCITS FUNDS

## RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

### Performance del fondo, tracking difference e tracking error (continua)

- 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 2022.
- 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 %	Tracking error realizzato %
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund - Classe di quote istituzionali a distribuzione	(11,83)	(10,74)	0,26	Fino allo 0,60	2,52
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund <sup>1</sup> - EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	(10,14)	(10,12)	0,06	Fino allo 0,30	0,10
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund <sup>1</sup> - EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	(12,09)	(12,03)	0,08	Fino allo 0,20	0,03

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

### Performance del fondo, tracking difference e tracking error (continua)

Nome del Fondo	Rendimento del Fondo %	Parametro di riferimento della performance %
BlackRock Diversified Strategies Selection Fund <sup>1</sup> - Classe E ad accumulazione	(2,34)	n.a.
BlackRock UK Credit Screened Fund - Classe di quote ad accumulazione flessibile	(18,25)	(18,41)
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund - Classe D ad accumulazione	(6,03)	(0,37)
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund - EUR - Classe di quote ad accumulazione flessibile	(8,40)	(8,65)
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund - Classe di quote istituzionali 1 a distribuzione	(10,70)	(0,37)
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund - Classe D ad accumulazione	(22,22)	(21,70)
BlackRock Euro Cash Fund <sup>1</sup> - Classe D ad accumulazione	(0,97)	(0,20)
BlackRock Fixed Income Selection Fund - Classe D ad accumulazione	(7,94)	n.a.
BlackRock Global Equity Selection Fund - Classe D ad accumulazione	(12,80)	(11,53)
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund - Classe D ad accumulazione	(11,35)	n.a.
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund - Classe D ad accumulazione	(8,76)	n.a.
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund - Classe di quote ad accumulazione flessibile	(23,94)	(22,34)
FR Multi-Asset Fund <sup>2</sup> - Istituzionali in EUR ad accumulazione	(3,71)	(4,61)

<sup>1</sup>Il Fondo è stato interamente rimborsato nel corso dell'esercizio finanziario. I rendimenti vengono mostrati dall'inizio dell'esercizio finanziario alla data del completo riscatto del Fondo.

<sup>2</sup>Il Fondo ha iniziato le attività nel corso dell'esercizio finanziario. I rendimenti vengono mostrati dalla data di lancio alla fine dell'esercizio 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 KIID. Loro copie sono disponibili presso i Servizi agli investitori, l'Agente per i trasferimenti, la Società di Gestione o qualsiasi Rappresentante o Distributore.

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

### Panoramica economica globale

Le azioni globali, rappresentate dall'indice MSCI All Country World ("ACWI"), hanno reso il -21,41% (in termini di USD) nei sei mesi chiusi al 30 settembre 2022. In un contesto di rallentamento della ripresa economica, sia le obbligazioni che le azioni hanno risentito di un'inflazione persistentemente elevata (ritmo di crescita dei prezzi di beni e servizi) e delle misure di stretta della politica monetaria da parte delle maggiori banche centrali mondiali. L'invasione russa dell'Ucraina ha aggiunto incertezze e turbolenze sui mercati finanziari. Le sanzioni imposte alla Russia hanno avuto un impatto negativo sulle imprese legate alla regione e hanno contribuito a innalzare la volatilità (oscillazioni di mercato) dei prezzi di alcune materie prime.

Nel secondo trimestre del 2022 l'economia USA ha dato segnali di debolezza e si è contratta a causa del rallentamento della crescita dei consumi e del forte calo della fiducia delle imprese. L'economia giapponese ha registrato una crescita modesta, favorita dall'abolizione delle restrizioni COVID-19 e dall'aumento della spesa pubblica. L'economia del Regno Unito ha subito un rallentamento a causa della debolezza delle attività produttive e del settore manifatturiero. La crescita lenta ma costante dell'Eurozona è stata alimentata dalla spesa delle famiglie e dall'attività turistica in un contesto di allentamento delle restrizioni COVID-19.

I Paesi dei mercati emergenti hanno evidenziato una crescita generalmente lenta, a causa del raffreddamento dell'economia globale. In Cina, l'economia ha subito un sostanziale rallentamento nel secondo trimestre del 2022 a seguito di una serie di rigide misure di blocco volte a contenere l'aumento dei contagi da COVID-19.

Di fronte al continuo aumento dell'inflazione a livello globale, le maggiori banche centrali del mondo hanno attuato diverse misure di inasprimento monetario. La Federal Reserve statunitense ("la Fed") ha aumentato i tassi di interesse quattro volte nel tentativo di contenere l'inflazione, compresi tre aumenti consecutivi di 75 punti base a giugno, luglio e settembre 2022. Nel giugno 2022 la Fed ha anche chiuso i suoi programmi di acquisti obbligazionari e iniziato a vendere parte delle posizioni obbligazionarie accumulate.

La Bank of England ("BoE") ha operato quattro aumenti dei tassi d'interesse, in quanto l'inflazione ha toccato il massimo degli ultimi quarant'anni. Anche nell'Eurozona l'inflazione ha subito un'accelerazione e la Banca Centrale Europea ("BCE") ha aumentato due volte i tassi di interesse nel tentativo di contenere l'aumento dei prezzi. Inoltre, la BCE ha espresso l'intenzione di intervenire per evitare una divergenza significativa tra i rendimenti obbligazionari (che si muovono inversamente ai prezzi) dei paesi dell'Eurozona in caso di aumento dei tassi di interesse.

La performance azionaria globale è stata fortemente negativa nella maggior parte del mondo. L'aumento dell'inflazione, in un contesto di restrizioni della catena di approvvigionamento e di stretta monetaria da parte di molte banche centrali, ha penalizzato i listini finanziari. I titoli azionari statunitensi, europei e dell'Asia-Pacifico hanno tutti subito una flessione nel corso del semestre.

Anche i prezzi delle obbligazioni globali sono scesi, a causa della crescente inflazione che ha frenato i rendimenti. I Treasury USA si sono deprezzati nel timore che la Fed innalzi ancora i tassi di interesse a causa dell'elevata inflazione. I rendimenti dei gilt britannici sono saliti in modo sostanziale, poiché i tagli fiscali proposti alla fine del periodo hanno aumentato la probabilità di un aumento dell'indebitamento pubblico. La BoE è intervenuta per fornire ulteriore liquidità in un contesto di forte volatilità, stabilizzando il mercato dei gilt britannici. Anche i titoli di Stato europei hanno registrato un calo significativo nel semestre, mentre l'arretramento dei titoli di Stato giapponesi è stato meno marcato. Le obbligazioni societarie hanno ceduto terreno in tutto il mondo, in quanto gli investitori si sono preoccupati dell'impatto dell'aumento dei tassi di interesse sui costi di finanziamento delle imprese.

I titoli azionari dei mercati emergenti hanno evidenziato un calo sostanziale a causa dell'apprezzamento del dollaro statunitensi e del rialzo dei tassi d'interesse. Le banche centrali di diversi mercati emergenti, come India, Brasile e Messico, hanno aumentato più volte i tassi d'interesse in risposta alle crescenti preoccupazioni sull'inflazione. Anche i prezzi delle obbligazioni dei mercati emergenti hanno subito un forte calo, specialmente dopo l'invasione russa dell'Ucraina.

Il mercato delle materie prime è apparso volatile, con un forte aumento dei prezzi nelle prime fasi dell'invasione russa dell'Ucraina e un'attenuazione successiva provocata dai timori per la crescita. Il prezzo del greggio Brent è salito bruscamente all'inizio del periodo di riferimento, ma ha ritracciato con la stabilizzazione dei mercati per chiudere il semestre in lieve calo. I prezzi del gas naturale hanno registrato una certa volatilità, soprattutto in Europa, a causa delle interruzioni delle forniture dalla Russia. Le quotazioni dell'oro sono scese, poiché l'aumento dei tassi di interesse ha reso relativamente meno interessanti gli investimenti non fruttiferi, nonostante l'aumento dell'inflazione.

Per quanto concerne le valute estere, il dollaro statunitense si è apprezzato rispetto alla maggior parte delle altre valute globali, in particolare quando la Fed ha avviato la stretta monetaria nel 2022. Lo yen giapponese è sceso notevolmente rispetto al dollaro USA, poiché la posizione relativamente accomodante della Banca del Giappone ha fatto sì che i tassi di interesse aumentassero negli Stati Uniti più rapidamente che in Giappone. Anche l'euro, la sterlina e lo yuan cinese si sono indeboliti rispetto al biglietto verde, che gli investitori hanno ritenuto più protetto dalle turbolenze geopolitiche.

### Valutazione della performance e attività del Fondo

**BlackRock Diversified Strategies Selection Fund**  
**BlackRock Fixed Income Selection Fund**  
**BlackRock Global Equity Selection Fund**  
**BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund**  
**BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund**

Il 2022 si è confermato un anno all'insegna della volatilità per i mercati finanziari. L'invasione russa dell'Ucraina, il conseguente aggravamento dello shock energetico e i rialzi dei tassi di molte banche centrali mondiali hanno aumentato notevolmente l'incertezza degli investitori nel periodo. L'assoggettamento della Russia a sanzioni ha fatto aumentare l'inflazione trainata dall'offerta e i prezzi delle materie prime. Gli asset rischiosi hanno subito un forte calo nel periodo in esame, nonostante una parziale ripresa a luglio. Le banche centrali non sembrano rinunciare ad aumentare i tassi. A causa dell'aumento dell'inflazione, i rendimenti dei titoli di Stato sono cresciuti fortemente. I movimenti hanno riguardato soprattutto la parte breve della curva, più sensibile alle aspettative di aumento dei tassi di interesse, ma la parte lunga continua a risentire delle tensioni geopolitiche.

### BlackRock Diversified Strategies Selection Fund

Nel periodo chiuso al 31 agosto 2022, il Fondo ha reso il (2,32%).

Il Fondo è gestito attivamente con il duplice obiettivo di garantire un'elevata diversificazione tra i gestori sottostanti e di mantenere un basso livello di beta e la correlazione con i mercati azionari e obbligazionari.

Il Fondo ha registrato un calo nel periodo (fino alla chiusura) soprattutto a causa della performance negativa generalizzata delle classi di attivi, nonostante abbia mantenuto un beta limitato rispetto ai mercati azionari e una buona diversificazione tra le strategie sottostanti. Il Fondo è stato chiuso il 31 agosto 2022.

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

### Valutazione della performance e attività del Fondo (continua)

#### BlackRock Diversified Strategies Selection Fund (continua)

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

Contributi più positivi		Contributi più negativi	
Settore	Effetto sul rendimento del Fondo	Settore	Effetto sul rendimento del Fondo
BlackRock Strategic Funds - Global Event Driven Fund	0,94%	Derivati (copertura del rischio di cambio) e strumenti liquidi equivalenti	(3,51%)
BlackRock Strategic Funds - Systematic Global Long-Short Equity Fund	0,71%	BlackRock Strategic Funds - Fixed Income Global Opportunities Fund Euro Hedged	(0,33%)
BlackRock Strategic Funds - UK Equity Absolute Return Fund	0,64%	BlackRock Strategic Funds - European Absolute Return Fund	(0,15%)

Gli apporti più utili alla performance sono venuti dalla strategia globale event-driven, dal fondo sistematico long-short (sostenuto anche dal dollaro USA) e dal fondo long-short del Regno Unito. A causa dell'apprezzamento del dollaro USA, la copertura sui cambi applicata a livello del portafoglio per controllare il rischio ha prodotto la maggiore erosione del risultato.

La tabella seguente riporta le principali ponderazioni del portafoglio al 31 agosto 2022 e al 31 marzo 2022:

31 agosto 2022		31 marzo 2022	
Settore	Ponderazione	Settore	Ponderazione
Titoli monetari	100%	BlackRock Strategic Funds - European Absolute Return Fund	15,10%
		BlackRock Strategic Funds - UK Equity Absolute Return Fund	13,00%
		BlackRock Tactical Opportunities Fund	12,50%

#### BlackRock UK Credit Screened Fund

Nel semestre conclusosi il 30 settembre 2022, il Fondo ha ottenuto un rendimento positivo dello 0,16% (in sterline), sovraperformando il suo parametro della performance (il rendimento attivo è la differenza tra il rendimento del Fondo e quello del parametro della performance).

Nel secondo trimestre del 2022 l'attenzione del mercato si è spostata dai timori per l'aumento dell'inflazione ai rischi di rallentamento della crescita, man mano che la frenata della crescita globale si faceva più evidente. Nel terzo trimestre del 2022 i rendimenti dei titoli di Stato dei mercati sviluppati hanno registrato un'impennata, mentre i timori di una recessione globale e di una stretta monetaria hanno pesato sui sentiment degli investitori. Le turbolenze che hanno afflitto il mercato dei titoli di Stato del Regno Unito verso la fine di settembre hanno acuito la volatilità a livello globale. Al contempo, in quasi tutti i paesi le pressioni inflazionistiche globali sono rimaste, insieme all'inflazione core (che esclude alimentari ed energia) ben al di sopra degli obiettivi delle banche centrali.

Nel periodo in esame, il Fondo ha sovraperformato il suo parametro della performance. Il Fondo si è posizionato in chiave difensiva, con una sottoponderazione (filtri di esclusione) in alcuni emittenti tecnologici e titoli del comparto automobilistico nell'universo dei beni di consumo ciclici. Inoltre, il Fondo ha escluso alcuni emittenti selezionati nei sottosettori dei beni di consumo non ciclici, in particolare i prodotti farmaceutici e i prodotti di consumo, nonché in alcuni sottosettori dei beni strumentali, in particolare i materiali da costruzione e i prodotti manifatturieri diversificati. Nel segmento finanziario, il Fondo si è posizionato in chiave difensiva su alcuni emittenti bancari. Fra le utility, il Fondo ha evitato alcuni emittenti nel sottosettore dell'energia elettrica.

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

Contributi più positivi		Contributi più negativi	
Settore	Effetto sul rendimento del Fondo	Settore	Effetto sul rendimento del Fondo
Energia elettrica <sup>∞</sup>	0,05%	Assicurazioni <sup>##</sup>	(0,03%)
Banche <sup>∞</sup>	0,03%	Industria di base <sup>##</sup>	(0,02%)
Tecnologia <sup>∞</sup>	0,03%	Gas naturale <sup>##</sup>	(0,02%)
Beni strumentali <sup>##</sup>	0,03%	Beni di consumo non ciclici <sup>##</sup>	(0,02%)
REIT <sup>#</sup>	0,01%	Agenzie <sup>0</sup>	(0,02%)

<sup>#</sup> Posizione di sovrappeso - esposizione superiore a quella del parametro della performance.

<sup>0</sup> Posizione di sottopeso - esposizione inferiore a quella del parametro della performance.

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, e quindi il Fondo mira ad evitare qualsiasi sovrapponderazione attiva.

#### BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2022 il Fondo ha reso il (6,03%), sottoperformando il suo parametro della performance che ha registrato un rendimento del (0,37%).

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

### Valutazione della performance e attività del Fondo (continua)

#### Blackrock Defensive Yield ESG Screened Fund (continua)

Nel secondo trimestre del 2022 l'attenzione del mercato si è spostata dai timori per l'aumento dell'inflazione ai rischi di rallentamento della crescita, man mano che la frenata della crescita globale si faceva più evidente. Nel terzo trimestre del 2022 i rendimenti dei titoli di Stato dei mercati sviluppati hanno registrato un'impennata, mentre i timori di una recessione globale e di una stretta monetaria hanno pesato sul sentiment degli investitori. Le turbolenze intervenute a fine settembre nel mercato dei titoli di Stato del Regno Unito hanno acuito la volatilità a livello globale. Al contempo, in quasi tutti i paesi le pressioni inflazionistiche globali sono rimaste, insieme all'inflazione core (che esclude alimentari ed energia) ben al di sopra degli obiettivi delle banche centrali.

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 2022, il Fondo detiene un portafoglio complessivo il cui valore di mercato è composto al 66,2% da credito investment grade, rispetto al 63,4% di inizio periodo, e al 34,0% da credito high yield, rispetto al 36,2% di inizio periodo.

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

Contributi più positivi		Contributi più negativi	
Settore	Effetto sul rendimento del Fondo	Settore	Effetto sul rendimento del Fondo
		Beni di consumo non ciclici <sup>ff</sup>	(1,05%)
		Banche <sup>ff</sup>	(0,78%)
		Beni di consumo ciclici <sup>ff</sup>	(0,68%)
		Beni strumentali <sup>ff</sup>	(0,62%)
		Altre società finanziarie <sup>#</sup>	(0,61%)

<sup>#</sup> Posizione di sovrappeso - esposizione superiore a quella del parametro della performance.

La tabella seguente riporta le principali ponderazioni del portafoglio al 30 settembre 2022 e al 31 marzo 2022:

30 settembre 2022		31 marzo 2022	
Settore	Esposizione lorda	Settore	Esposizione lorda
Banche	19,72%	Banche	17,63%
Beni di consumo non ciclici	16,41%	Beni di consumo non ciclici	15,37%
Beni di consumo ciclici	12,44%	Beni di consumo ciclici	12,17%
Beni strumentali	8,95%	Beni strumentali	9,14%
Beni strumentali	7,20%	Comunicazioni	8,70%

#### BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund

Nel semestre conclusosi il 30 settembre 2022, il Fondo ha ottenuto un rendimento positivo dello 0,25% (in euro), sovraperformando il suo parametro della performance (il rendimento attivo è la differenza tra il rendimento del Fondo e quello del parametro della performance).

Nel secondo trimestre del 2022 l'attenzione del mercato si è spostata dai timori per l'aumento dell'inflazione ai rischi di rallentamento della crescita, man mano che la frenata della crescita globale si faceva più evidente. Nel terzo trimestre del 2022 i rendimenti dei titoli di Stato dei mercati sviluppati hanno registrato un'impennata, mentre i timori di una recessione globale e di una stretta monetaria hanno pesato sul sentiment degli investitori. Le turbolenze intervenute a fine settembre nel mercato dei titoli di Stato del Regno Unito hanno acuito la volatilità a livello globale. Al contempo, in quasi tutti i paesi le pressioni inflazionistiche globali sono rimaste, insieme all'inflazione core (che esclude alimentari ed energia) ben al di sopra degli obiettivi delle banche centrali.

Nel periodo in esame, il Fondo ha mantenuto un'allocazione sovrappesata principalmente in Germania, Corea del Sud, Australia e Paesi Bassi e un'allocazione sottopesata in Giappone, Regno Unito, Spagna e Italia. La sottoponderazione di Regno Unito, Italia, Spagna e Giappone 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:

Contributi più positivi		Contributi più negativi	
Paese	Effetto sul rendimento del Fondo	Paese	Effetto sul rendimento del Fondo
Regno Unito <sup>v</sup>	0,74%	Germania <sup>ff</sup>	(0,41%)
Italia <sup>v</sup>	0,42%	Stati Uniti <sup>ff</sup>	(0,33%)
Francia <sup>v</sup>	0,38%	Paesi Bassi <sup>ff</sup>	(0,26%)
Spagna <sup>v</sup>	0,37%	Corea del Sud <sup>ff</sup>	(0,23%)
Giappone <sup>o</sup>	0,10%	Austria <sup>#</sup>	(0,22%)

<sup>#</sup> Posizione di sovrappeso - esposizione superiore a quella del parametro della performance.

<sup>o</sup> Posizione di sottopeso - esposizione inferiore a quella del parametro della performance.

Le sovraesposizioni alla Germania e ai Paesi Bassi sono state determinate dalla valutazione favorevole sui margini di bilancio e sulla capacità di rimborso. La sovraesposizione a Stati Uniti e Corea del Sud è stata determinata dalla valutazione positiva sui conti pubblici; viceversa, la sottoesposizione a Regno Unito, Italia, Spagna, Francia e Giappone è derivata dalla valutazione negativa sui conti pubblici.

# 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)

La seguente tabella illustra in dettaglio le posizioni attive significative in cui il Fondo è sovrappeso (detiene un'esposizione maggiore rispetto al parametro della performance) e sottopeso (detiene un'esposizione minore rispetto al parametro della performance), al 30 settembre 2022 e al 31 marzo 2022:

Maggiore posizione in sovrappeso:			
30 settembre 2022		31 marzo 2022	
Paese	Ponderazione	Paese	Ponderazione
Germania	3,97%	Germania	3,98%
Paesi Bassi	1,94%	Paesi Bassi	2,18%
Austria	1,52%	Austria	1,63%

Maggiore posizione in sottopeso:			
30 settembre 2022		31 marzo 2022	
Paese	Ponderazione	Paese	Ponderazione
Italia	(3,55%)	Spagna	(3,57%)
Spagna	(3,47%)	Italia	(3,51%)
Francia	(2,17%)	Francia	(2,58%)

#### BlackRock Diversifying Fixed Income Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2022 il Fondo ha reso il (10,70%), sottoperformando il suo parametro della performance che ha registrato un rendimento del (0,40%).

Nel secondo trimestre del 2022, gli asset obbligazionari hanno in generale risentito del rialzo dei rendimenti dovuto agli elevati dati sull'inflazione e ai toni aggressivi ribaditi dalle banche centrali. In particolare, a maggio l'indice dei prezzi al consumo degli Stati Uniti è salito all'8,6% su base annua e a giugno la Fed ha aumentato il tasso ufficiale di 75 punti base. Anche in Europa i rendimenti hanno evidenziato una certa volatilità, avendo la BCE comunicato la fine degli acquisti di titoli e l'aumento dei tassi. In questo contesto, il Fondo ha generato un rendimento negativo in quanto sia i tassi che il rischio di credito hanno contribuito negativamente. Nel terzo trimestre del 2022, le banche centrali hanno continuato a inasprire la politica monetaria, - per esempio a settembre la Fed e la BCE hanno aumentato i tassi di riferimento di altri 75 punti base - alimentando la volatilità già insita nei mercati obbligazionari. In questo contesto, il Fondo ha risentito del generale aumento dei rendimenti dei titoli di Stato e dell'ampliamento degli spread creditizi.

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

Contributi più positivi		Contributi più negativi	
Posizioni	Effetto sul rendimento del Fondo	Posizioni	Effetto sul rendimento del Fondo
iShares JPM \$ emerging markets corporate Bond UCITS ETF	0,49%	BlackRock global high yield ESG and credit screened fund	(2,08%)
US ultra 10 year note	0,16%	iShares emerging markets government bond index fund	(1,96%)

È stato un semestre difficile per la generalità delle classi di attivi obbligazionari. In questa cornice, non si sono registrati che pochi contributi positivi; soprattutto le esposizioni alle obbligazioni high yield e dei mercati emergenti hanno penalizzato il risultato del fondo.

La tabella seguente riporta le ponderazioni del portafoglio al 30 settembre 2022 e al 31 marzo 2022:

30 settembre 2022		31 marzo 2022	
Classe di attivi	Esposizione lorda	Classe di attivi	Esposizione lorda
Obbligazioni corporate high yield	33,34%	Obbligazioni corporate high yield	31,68%
Obbligazioni corporate investment grade	31,57%	Debito dei mercati emergenti in valuta forte	30,35%
Debito dei mercati emergenti in valuta forte	25,74%	Obbligazioni corporate investment grade	28,13%
Liquidità e altro	5,63%	Titoli di Stato	5,84%
Titoli di Stato	3,72%	Liquidità e altro	4,00%

#### BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2022 il Fondo ha reso il (22,22%), sottoperformando il suo parametro della performance che ha registrato un rendimento del (21,70%).

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

Il maggior contributo alla performance del Fondo è venuto dalle analisi che contribuiscono a rilevare il sentiment dei partecipanti al mercato, come ad esempio la comunità di analisti sell side o gli hedge fund. Parimenti, le analisi sui titoli Value, ossia gli approfondimenti che aiutano a individuare le aziende con un valore interessante hanno avuto un effetto accrescitivo.

Tuttavia, non è bastato a compensare le performance deludenti di altre componenti del modello. I segnali generati dalle analisi sui titoli di Qualità, e più precisamente quelle incentrate sull'ESG, hanno prodotto le peggiori performance. Il contributo negativo di queste analisi ha spinto in territorio negativo la performance complessiva del fondo.



# 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 periodo i maggiori contributi positivi e negativi al risultato del Fondo sono giunti dalle posizioni seguenti:

Contributi più positivi		Contributi più negativi	
Settore	Effetto sul rendimento del Fondo	Settore	Effetto sul rendimento del Fondo
Beni di prima necessità <sup>†</sup>	0,34%	Materiali <sup>†</sup>	0,43%
Energia <sup>†</sup>	0,26%	Beni di consumo discrezionali <sup>†</sup>	0,38%
Informatica <sup>†</sup>	0,22%	Finanziari <sup>‡</sup>	0,17%
Servizi pubblici (utility) <sup>‡</sup>	0,08%	Industriali <sup>§</sup>	0,09%
Servizi di comunicazione <sup>§</sup>	0,04%	Immobiliare <sup>§</sup>	0,03%

<sup>†</sup> Posizione di sovrappeso - esposizione superiore a quella del parametro della performance.

<sup>§</sup> Posizione di sottopeso - esposizione inferiore a quella del parametro della performance.

Una posizione sovrappesata relativa sui beni di consumo primari ha apportato il maggiore contributo alla performance, che è stata invece penalizzata da una posizione sovrappesata relativa nei materiali.

Le seguenti tabelle illustrano 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 2022 e al 31 marzo 2022:

#### Maggiore posizione in sovrappeso:

30 settembre 2022		31 marzo 2022	
Area azionaria	Ponderazione	Area azionaria	Ponderazione
Sudafrica	2,04%	Sudafrica	2,09%
Brasile	1,99%	Cina	1,38%
Indonesia	1,81%	Taiwan	1,27%

#### Maggiore posizione in sottopeso:

30 settembre 2022		31 marzo 2022	
Area azionaria	Ponderazione	Area azionaria	Ponderazione
India	2,83%	India	2,10%
Corea del Sud	2,48%	Kuwait	0,77%
Arabia Saudita	0,74%	Polonia	0,66%

Il Sudafrica rimane la posizione maggiormente sovrappesata, seguita dal Brasile. L'India si conferma viceversa la posizione più sottopesata.

#### BlackRock Euro Cash Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2022 il Fondo ha reso il (0,97%), sottoperformando il suo parametro della performance che ha registrato un rendimento del (0,20%).

Alla luce dell'aumento delle pressioni sui prezzi nell'Eurozona e dopo aver lasciato i tassi invariati dall'inizio dell'anno, a luglio la BCE ha operato un rialzo di 50 punti base, superiore alle aspettative del mercato che, alla vigilia della riunione, prevedeva solo il 50% di possibilità di una stretta di 50 punti base. Si tratta del primo rialzo dei tassi in 11 anni e pone fine a un ciclo di tassi negativi.

L'inflazione rimane robusta, in crescita nel corso dell'anno e più viscosa di quanto le banche centrali non si attendessero. La lotta all'inflazione comporta una crescita più lenta o una recessione, che le banche centrali sembrano disposte a sopportare almeno temporaneamente. Si assiste a un rapido deterioramento del quadro macroeconomico e gli indicatori economici previsionali prefigurano una recessione in Europa. Apparentemente la recessione è data per scontata e ci si chiede piuttosto quando accadrà e quanto sarà profonda. Il mercato rimane sensibile e focalizzato sull'inflazione - parte preponderante del mandato della BCE - e ritiene che quest'ultima dovrà inaugurare una fase di politica monetaria restrittiva, con un tasso terminale al di sopra del tasso neutro, al fine di ridurre la domanda e spingere l'inflazione verso il basso.

La curva ESTER (tassi a breve termine in euro) prevedeva che la BCE avrebbe operato un rialzo di 69 punti base a ottobre, e un secondo di ulteriori 62 punti base a dicembre, per un totale di 131 punti base nella restante parte dell'anno. Il mercato prevede ora un tasso terminale vicino al 3% nel terzo trimestre del 2023, il che implica un tasso ufficiale compatibile con una politica monetaria restrittiva.

Nel Fondo, abbiamo concentrato i nostri sforzi nell'impiego della liquidità che avevamo creato dopo la fine dell'anno. Continuiamo a privilegiare il segmento breve, concentrandoci principalmente sui titoli di durata pari e inferiore a 3 mesi, con investimenti limitati entro i 6 mesi. Dopo una fase di sorprendente neutralità della curva, i tassi del mercato monetario europeo si sono apprezzati.

Nel periodo abbiamo continuato a usare prudenza, in quanto il mercato continua a rivalutare aspettative di rialzi dei tassi e la guerra in Ucraina, a cui si aggiunge la spirale dei prezzi dell'energia, aggiunge incertezza. Abbiamo concentrato il nostro investimento in titoli a breve scadenza (con una WAM o Scadenza Media Ponderata in calo da 51 a 30 giorni) e la nostra liquidità giornaliera e settimanale è rimasta elevata.

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

### Valutazione della performance e attività del Fondo (continua)

#### BlackRock Euro Cash Fund (continua)

La tabella seguente riporta le principali ponderazioni del portafoglio al 30 settembre 2022 e al 31 marzo 2022:

30 settembre 2022		31 marzo 2022	
Classe di attivi	Ponderazione	Classe di attivi	Ponderazione
Carta commerciale di società finanziarie	29,12%	Carta commerciale di società finanziarie	27,36%
Certificati di deposito	28,51%	Certificati di deposito	21,71%
Altro strumento (deposito a tempo)	12,44%	Altro strumento (deposito a tempo)	21,50%
Pronti contro termine di agenzie governative	10,12%	Carta commerciale garantita da attività	12,93%
Carta commerciale garantita da attività	8,50%	Altra carta commerciale	12,26%
Altra carta commerciale	5,65%	Società d'investimento	4,23%
Altri titoli di debito	2,94%		
Debito del Tesoro	2,73%		

#### BlackRock Fixed Income Selection Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2022, il Fondo ha reso il (7,94%).

Il Fondo è gestito attivamente investendo principalmente in classi di attivi a reddito fisso (titoli di Stato, obbligazioni corporate, debito dei mercati emergenti) al fine di mantenere un contributo di rischio ben bilanciato fra i macro-fattori di rischio (tassi e spread). Tali esposizioni direzionali sono integrate da strategie obbligazionarie flessibili e strategie multi-asset nell'intento di ottimizzare la diversificazione del Fondo e il rapporto fra rischio e rendimento.

Nel 2022 il Fondo ha registrato una performance negativa sulla scia di rendimenti in rialzo nell'intero periodo e di perdite generalizzate sui mercati finanziari.

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

Contributi più positivi		Contributi più negativi	
Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo	Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo
BlackRock Strategic Funds – China Bond Fund USD Hedged	0,23%	Derivati (copertura del rischio di cambio) e liquidi equivalenti	(1,48%)
iShares Treasury 7–10 Year USD ETF	0,07%	iShares USD Corporate Bond ESG UCITS ETF EUR Hedged	(1,02%)
BlackRock Strategic Funds – Emerging Markets Short Duration Bond Fund	0,06%	BlackRock Global Funds – ESG Multi Asset Fund	(0,78%)

L'esposizione alle obbligazioni cinesi è stata il principale elemento di diversificazione e ha premiato il risultato, insieme agli asset esposti positivamente al dollaro USA, mentre le obbligazioni corporate statunitensi con copertura in euro hanno sensibilmente penalizzato la performance, a causa del forte movimento dei tassi e dall'allargamento degli spread nel periodo. A causa dell'apprezzamento del dollaro USA, la copertura sui cambi applicata a livello del portafoglio per controllare il rischio ha prodotto la maggiore erosione del risultato.

La tabella seguente riporta le principali ponderazioni del portafoglio al 30 settembre 2022 e al 31 marzo 2022:

30 settembre 2022		31 marzo 2022	
Strategia	Ponderazione	Strategia	Ponderazione
BlackRock Strategic Funds – Sustainable Fixed Income Strategy Fund	13,60%	BlackRock Strategic Funds – Fixed Income Strategies Fund	13,70%
BlackRock Global Funds – Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	11,10%	BlackRock Global Funds – ESG Fixed Income Global Opportunities Fund	11,20%
BlackRock Global Funds – ESG Multi-Asset Fund	9,00%	BlackRock Tactical Opportunities Fund	9,00%

#### BlackRock Global Equity Selection Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2022 il Fondo ha reso il (12,80%), sottoperformando il parametro della performance.

La relativa sottoperformance del Fondo è stata trainata principalmente dall'inefficace selezione del gestore, con le strategie attive sottostanti che hanno generato alfa negativo. In particolare, la piattaforma fondamentale europea (situazioni continentali e speciali) ha registrato risultati fortemente negativi nell'area attiva, seguita dalle esposizioni ai settori finanziario e informatico.

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

Contributi più positivi		Contributi più negativi	
Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo	Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo
BlackRock Global Funds – World Energy Fund <sup>#</sup>	0,07%	BlackRock Global Funds – Continental European Flexible Fund <sup>#</sup>	(2,41%)
BlackRock Global Funds – World Health Science Fund <sup>#</sup>	0,04%	BlackRock Global Funds – European Special Situations Fund <sup>#</sup>	(1,88%)
BlackRock Strategic Funds – Emerging markets Equity Strategies Fund <sup>#</sup>	0,01%	iShares edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF- EUR <sup>#</sup>	(1,45%)

NMT 2220-2615/57-16/212



# BLACKROCK UCITS FUNDS

## RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

### Valutazione della performance e attività del Fondo (continua)

#### BlackRock Global Equity Selection Fund (continua)

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

Le esposizioni all'energia e alla sanità sono state le principali componenti di diversificazione e hanno generato un contributo sostanzialmente piatto al rendimento totale, seguite dalla strategia high conviction sui mercati emergenti; le azioni europee hanno invece causato la maggior penalizzazione al risultato, anche a causa dell'alfa negativo.

Le seguenti tabelle illustrano in dettaglio le posizioni attive significative nelle quali il Fondo è sovrappeso (detiene un'esposizione maggiore rispetto al parametro della performance) e sottopesato (detiene un'esposizione minore rispetto al parametro della performance), al 30 settembre 2022 e al 31 marzo 2022:

Maggiori posizioni in sovrappeso:			
30 settembre 2022		31 marzo 2022	
Area azionaria	Posizione attiva	Area azionaria	Posizione attiva
Titoli monetari	1,56%	Titoli monetari	1,11%
Paesi di frontiera	0,37%	Mercati emergenti	0,38%
Giappone	0,29%	Giappone	0,25%

Maggiori posizioni in sottopeso:			
30 settembre 2022		31 marzo 2022	
Area azionaria	Posizione attiva	Area azionaria	Posizione attiva
Canada	(1,05%)	Canada	(1,24%)
Europa continentale, Regno Unito escluso	(0,97%)	USA	(0,73%)
Regno Unito	(0,57%)	Europa core, Regno Unito escluso	(0,48%)

#### BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund

Nel semestre chiuso al 30 settembre 2022, il Fondo ha reso il (11,35%).

Il Fondo è gestito attivamente combinando le esposizioni a reddito fisso (titoli di Stato, obbligazioni corporate, debito dei mercati emergenti) e quelle azionarie, privilegiando l'Europa, al fine di ottenere una crescita del capitale con un livello di rischio equilibrato. Si possono aggiungere strategie multi-asset con l'obiettivo di accrescere la diversificazione del Fondo e il rapporto tra rischio e rendimento.

Il rendimento totale del Fondo è stato negativo a causa delle perdite generalizzate dei mercati finanziari nel corso del periodo.

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

Contributi più positivi		Contributi più negativi	
Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo	Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo
BlackRock Strategic Funds – Global Event Driven Fund	0,11%	Derivati (copertura del rischio di cambio) e strumenti liquidi equivalenti	(2,57%)
BlackRock Global Funds – Emerging Markets Local Currency Bond Fund	0,02%	BlackRock Global Funds – Continental Europe Flexible Fund	(1,41%)
BlackRock Tactical Opportunities Fund	0,08%	BlackRock Strategic Funds – Sustainable European Bond Fund	(1,12%)

Le esposizioni alle strategie absolute return, come le opportunità globali event-driven e tattiche, hanno offerto i maggiori contributi alla diversificazione, generando un contributo sostanzialmente piatto al rendimento totale; gli asset europei, sia nel settore azionario che in quello del reddito fisso, hanno invece fortemente penalizzato la performance, anche a causa dell'alfa negativo. A causa dell'apprezzamento del dollaro USA, la copertura sui cambi applicata a livello del portafoglio per controllare il rischio ha prodotto la maggiore erosione del risultato.

La tabella seguente riporta le principali ponderazioni del portafoglio al 30 settembre 2022 e al 31 marzo 2022:

30 settembre 2022		31 marzo 2022	
Strategia	Ponderazione	Strategia	Ponderazione
BlackRock Strategic Funds – Sustainable Euro Bond Fund	9,63%	BlackRock Global Funds – ESG Euro Bond Fund	11,10%
iShares \$ Corporate Bond ESG ETF	8,89%	BlackRock Global Funds – US Dollar Bond Fund	9,70%
BlackRock Strategic Funds – Sustainable Euro Corporate Bond Fund	6,02%	BlackRock Global Funds – Continental European Flexible Fund	7,20%

# 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 2022, il Fondo ha reso il (8,76%).

Il Fondo è gestito attivamente combinando le esposizioni a reddito fisso (titoli di Stato, obbligazioni corporate, debito dei mercati emergenti) e quelle azionarie, con una componente di diversificazione, al fine di ottenere una crescita del capitale con un livello di rischio prudenziale. La componente di diversificazione è costruita garantendo un equilibrio fra i gestori sottostanti e mantenendo un basso livello di beta e la correlazione con i mercati finanziari, al fine di ottimizzare il rapporto fra rischio e rendimento del Fondo.

Il rendimento totale del Fondo è stato negativo a causa delle perdite generalizzate dei mercati finanziari nel periodo e nonostante l'asset allocation diversificata con una duration relativamente bassa.

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

Contributi più positivi		Contributi più negativi	
Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo	Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo
BlackRock Strategic Funds – Global Event Driven Fund	0,41%	Derivati (copertura del rischio di cambio) e strumenti liquidi equivalenti	(2,78%)
BlackRock Global Funds – China Bond Fund	0,24%	iShares \$ Corporate Bond ESG EUR Hedged	(0,84%)
iShares Treasury 7-10 year USD ETF	0,13%	BlackRock Strategic Funds – Sustainable European Bond Fund	(0,80%)

Abbiamo attuato una diversificazione principalmente attraverso strategie absolute return - come quella event-driven globale - e obbligazioni cinesi, che hanno marginalmente migliorato il rendimento totale. Per contro, le obbligazioni corporate statunitensi (con copertura in euro) e le obbligazioni in euro si sono fortemente deprezzate, a causa del mercato movimento dei tassi e dell'allargamento degli spread nel periodo. A causa dell'apprezzamento del dollaro USA, la copertura valutaria applicata a livello del portafoglio per controllare il rischio ha prodotto la maggiore erosione del risultato.

La tabella seguente riporta le principali ponderazioni del portafoglio al 30 settembre 2022 e al 31 marzo 2022:

30 settembre 2022		31 marzo 2022	
Strategia	Ponderazione	Strategia	Ponderazione
iShares \$ Corporate Bond ESG ETF	9,62%	BlackRock Global Funds – ESG Euro Bond Fund	9,00%
BlackRock Strategic Funds – Sustainable Euro Bond Fund	6,69%	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	8,40%
BlackRock Strategic Funds – Sustainable Euro Corporate Bond Fund	5,34%	BlackRock Strategic Funds – European Absolute Return Fund	6,80%

#### BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund

Nel semestre conclusosi il 30 settembre 2022, con un rendimento attivo del (1,60%) il Fondo ha sottoperformato il suo parametro della performance (il rendimento attivo è la differenza tra il rendimento del Fondo e quello del parametro della performance).

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 di impatto proprietari sono stati la causa principale della performance negativa. Particolarmente penalizzanti sono state, per esempio, le nostre analisi sui flussi ESG. I flussi degli investitori verso l'ESG hanno registrato una forte inversione di tendenza (cioè da afflussi netti a deflussi netti) per tutto il periodo. Parimenti penalizzanti sono state le analisi che si concentrano sulla "E" di ESG. Un contributo pesantemente negativo è venuto per esempio dal segnale incentrato sulle emissioni di gas serra.

Inoltre, le analisi che contribuiscono a identificare il Clima di fiducia di vari partecipanti al mercato, come ad esempio la comunità di analisti sell side o gli hedge fund, sono state un importante propulsore della performance del fondo. Parimenti, le analisi sui titoli Value, ossia gli approfondimenti che aiutano a individuare le aziende con un valore interessante, hanno avuto un effetto accrescitivo. Tuttavia, non è bastato a compensare le performance deludenti di altre componenti del modello.

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
Informatica <sup>#</sup>	0,76%	Finanziari <sup>o</sup>	0,22%
Immobiliare <sup>#</sup>	0,32%	Beni di consumo discrezionali <sup>#</sup>	0,19%
Servizi pubblici (utility) <sup>#</sup>	0,21%	Salute <sup>#</sup>	0,17%
Energia <sup>#</sup>	0,08%	Servizi di comunicazione <sup>o</sup>	0,16%
Industria <sup>#</sup>	0,04%	Materiali <sup>o</sup>	0,14%

<sup>#</sup> Posizione di sovrappeso - esposizione superiore a quella del parametro della performance.

<sup>o</sup> Posizione di sottopeso - esposizione inferiore a quella del parametro della performance.

Una posizione sovrappesata relativa nell'informatica ha apportato il maggiore contributo alla performance, che è stata invece penalizzata da una posizione sottopesata relativa nelle attività finanziarie.

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## RELAZIONE DEL GESTORE DEGLI INVESTIMENTI (continua)

### Valutazione della performance e attività del Fondo (continua)

#### BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund (continua)

La seguente tabella illustra in dettaglio le posizioni attive significative in cui il Fondo è sovrappeso (detiene un'esposizione maggiore rispetto al parametro della performance) e sottopeso (detiene un'esposizione minore rispetto al parametro della performance), al 30 settembre 2022 e al 31 marzo 2022:

Maggiore posizione in sovrappeso:			
31 marzo 2022		30 settembre 2022	
Paese	Ponderazione	Paese	Ponderazione
Sudafrica	1,15%	Cina	1,21%
Cina	0,85%	Brasile	0,95%
Taiwan	0,80%	Sudafrica	0,88%

Maggiore posizione in sottopeso:			
31 marzo 2022		30 settembre 2022	
Paese	Ponderazione	Paese	Ponderazione
India	0,88%	Corea del Sud	1,75%
Filippine	0,70%	India	1,44%
Kuwait	0,64%	Arabia Saudita	1,19%

La Cina ha assunto una posizione di forte sovrappeso, seguita dal Brasile. La Corea è la più sottopesata e l'India occupa ora il secondo posto.

#### FR Multi-Asset Fund

Nel periodo dal 13 luglio 2022 (data di lancio) al 30 settembre 2022, con un rendimento attivo dello 0,90% il Fondo ha sovraperformato il suo parametro della performance (il rendimento attivo è la differenza tra il rendimento del Fondo e quello del parametro della performance).

Il 2022 si è confermato un anno all'insegna della volatilità per i mercati finanziari. L'invasione russa dell'Ucraina, il conseguente aggravamento dello shock energetico e i rialzi dei tassi di molte banche centrali mondiali hanno aumentato notevolmente l'incertezza degli investitori nel periodo. L'assoggettamento della Russia a sanzioni ha fatto aumentare l'inflazione trainata dall'offerta e i prezzi delle materie prime. Gli asset rischiosi hanno subito un forte calo nel periodo in esame, nonostante una parziale ripresa a luglio. Le banche centrali non sembrano rinunciare ad aumentare i tassi. A causa dell'aumento dell'inflazione, i rendimenti dei titoli di Stato sono cresciuti fortemente. I movimenti hanno riguardato soprattutto la parte breve della curva, più sensibile alle aspettative di aumento dei tassi di interesse, ma la parte lunga continua a risentire delle tensioni geopolitiche.

Il Fondo è gestito attivamente combinando le esposizioni obbligazionarie (titoli di Stato, obbligazioni corporate, debito dei mercati emergenti) e quelle azionarie con una componente di diversificazione, al fine di sovraperformare il benchmark di riferimento. La componente di diversificazione è costruita garantendo un equilibrio fra i gestori sottostanti e mantenendo un basso livello di beta e la correlazione con i mercati finanziari.

Il rendimento totale del Fondo è stato negativo a causa delle perdite generalizzate dei mercati finanziari nel corso del periodo. La performance attiva del Fondo è stata positiva grazie a diversi fattori: un contributo positivo è venuto anzitutto dal nostro posizionamento tattico nell'asset allocation, grazie al posizionamento corto nella duration che si è rivelato fortemente accrescitivo in un periodo di sofferenza comune sia delle azioni che delle obbligazioni; un altro importante fattore di performance positiva è derivato poi dalla scelta di strategie a rendimento assoluto, come le strategie event-driven globali che in generale hanno sovraperformato quelle obbligazionarie.

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

Contributi più positivi		Contributi più negativi	
Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo	Strategia	Effetto sul rendimento del Fondo
BlackRock Advantage US Equity Fund	0,36%	iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	(0,82%)
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	0,30%	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund Class X2 EUR	(0,55%)
German 5Y Government Bonds Future	0,25%	BlackRock Strategic Funds - Global Real Asset Securities Fund	(0,51%)

La tabella seguente riporta le principali ponderazioni del portafoglio al 30 settembre 2022:

30 settembre 2022	
Strategia	Ponderazione
BlackRock Advantage US Equity Fund	9,80%
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	9,80%
German 2Y Government Bonds Future	8,90%

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## CONTO ECONOMICO SINTETICO

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2022

	BlackRock Cangrande	BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	BlackRock Diversified Strategies Selection Fund <sup>2</sup>	BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1				
	Global Index Equity Fund <sup>1</sup>							
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	
	Note	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Reddito di esercizio		48	2.432	1.744	–	–	385	405
Utili/(perdite) netti su strumenti finanziari		(13.488)	(53.742)	(68)	(84)	168	(18.336)	(1.442)
<b>Totale reddito/(perdita) da investimenti</b>		<b>(13.440)</b>	<b>(51.310)</b>	<b>1.676</b>	<b>(84)</b>	<b>168</b>	<b>(17.951)</b>	<b>(1.037)</b>
Spese di esercizio		(167)	(133)	(117)	(67)	(94)	(65)	(85)
<b>Reddito/(spese) netto(e) di esercizio</b>		<b>(13.607)</b>	<b>(51.443)</b>	<b>1.559</b>	<b>(151)</b>	<b>74</b>	<b>(18.016)</b>	<b>(1.122)</b>
<b>Costi finanziari:</b>								
Interessi passivi o oneri simili		–	(1)	(1)	–	–	–	–
<b>Totale costi finanziari</b>		<b>–</b>	<b>(1)</b>	<b>(1)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Profitto/(perdita) netto/(a) al lordo di imposte</b>		<b>(13.607)</b>	<b>(51.444)</b>	<b>1.558</b>	<b>(151)</b>	<b>74</b>	<b>(18.016)</b>	<b>(1.122)</b>
Tassazione	6	–	(1)	10	–	–	(2)	2
<b>Profitto/(perdita) netto/(a) al netto di imposte</b>		<b>(13.607)</b>	<b>(51.445)</b>	<b>1.568</b>	<b>(151)</b>	<b>74</b>	<b>(18.018)</b>	<b>(1.120)</b>
<b>Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>		<b>(13.607)</b>	<b>(51.445)</b>	<b>1.568</b>	<b>(151)</b>	<b>74</b>	<b>(18.018)</b>	<b>(1.120)</b>

<sup>1</sup> Poiché il Fondo è stato lanciato nell'esercizio finanziario precedente, non sono disponibili dati comparativi.

<sup>2</sup> Il Fondo è stato chiuso durante il periodo 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 2022

	BlackRock UK Credit Screened Fund	
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021
Note	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP
Utili/(perdite) netti su strumenti finanziari	(45.340)	(1.722)
<b>Totale reddito/(perdita) da investimenti</b>	<b>(42.204)</b>	<b>2.536</b>
Spese di esercizio	(57)	(133)
<b>Reddito/(spese) netto/(e) di esercizio</b>	<b>(42.261)</b>	<b>2.403</b>
<b>Profitto/(perdita) netto/(a) al lordo di imposte</b>	<b>(42.261)</b>	<b>2.403</b>
Tassazione 6	-	6
<b>Profitto/(perdita) netto/(a) al netto di imposte</b>	<b>(42.261)</b>	<b>2.409</b>
<b>Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>	<b>(42.261)</b>	<b>2.409</b>

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 2022

	BlackRock Defensive Yield Fund 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 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021
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	732	712	692	1.014	718	626	8.381	8.229
Utili/(perdite) netti su strumenti finanziari	(5.408)	271	(9.328)	(771)	(10.073)	1.618	(91.781)	(31.343)
<b>Totale reddito/(perdita) da investimenti</b>	<b>(4.676)</b>	<b>983</b>	<b>(8.636)</b>	<b>243</b>	<b>(9.355)</b>	<b>2.244</b>	<b>(83.400)</b>	<b>(23.114)</b>
Spese di esercizio	(89)	(99)	(123)	(159)	(143)	(155)	(1.126)	(1.305)
<b>Reddito/(spese) netto/(e) di esercizio</b>	<b>(4.765)</b>	<b>884</b>	<b>(8.759)</b>	<b>84</b>	<b>(9.498)</b>	<b>2.089</b>	<b>(84.526)</b>	<b>(24.419)</b>
<b>Costi finanziari:</b>								
Interessi passivi o oneri simili	(1)	(1)	(1)	(5)	–	–	(15)	(64)
Distribuzioni ai sottoscrittori di quote rimborsabili	5	–	–	(598)	(125)	(465)	–	–
<b>Totale costi finanziari</b>	<b>(1)</b>	<b>(1)</b>	<b>(1)</b>	<b>(603)</b>	<b>(125)</b>	<b>(465)</b>	<b>(15)</b>	<b>(64)</b>
<b>Profitto/(perdita) netto/(a) al lordo di imposte</b>	<b>(4.766)</b>	<b>883</b>	<b>(8.760)</b>	<b>(519)</b>	<b>(9.623)</b>	<b>1.624</b>	<b>(84.541)</b>	<b>(24.483)</b>
Tassazione	6	–	4	(37)	–	–	(772)	(551)
<b>Profitto/(perdita) netto/(a) al netto di imposte</b>	<b>(4.766)</b>	<b>887</b>	<b>(8.797)</b>	<b>(538)</b>	<b>(9.623)</b>	<b>1.624</b>	<b>(85.313)</b>	<b>(25.034)</b>
Correzioni per l'allineamento alla metodologia di valutazione specificata nel prospetto	–	–	–	–	(3)	(3)	–	–
<b>Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>	<b>(4.766)</b>	<b>887</b>	<b>(8.797)</b>	<b>(538)</b>	<b>(9.626)</b>	<b>1.621</b>	<b>(85.313)</b>	<b>(25.034)</b>

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 2022

	BlackRock Euro Cash Fund <sup>1</sup>		BlackRock Fixed Income Selection Fund		BlackRock Global Equity Selection Fund		BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021
	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 di esercizio	–	–	92	75	18	13	57	24
Utili/(perdite) netti su strumenti finanziari	(9)	(23)	(3.452)	965	(4.130)	3.144	(4.579)	1.744
<b>Totale reddito/(perdita) da investimenti</b>	<b>(9)</b>	<b>(23)</b>	<b>(3.360)</b>	<b>1.040</b>	<b>(4.112)</b>	<b>3.157</b>	<b>(4.522)</b>	<b>1.768</b>
Spese di esercizio	(37)	(33)	(237)	(278)	(249)	(269)	(307)	(303)
<b>Reddito/(spese) netto/(e) di esercizio</b>	<b>(46)</b>	<b>(56)</b>	<b>(3.597)</b>	<b>762</b>	<b>(4.361)</b>	<b>2.888</b>	<b>(4.829)</b>	<b>1.465</b>
<b>Costi finanziari:</b>								
Interessi passivi o oneri simili	–	–	(1)	(4)	–	–	(1)	(1)
<b>Totale costi finanziari</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(1)</b>	<b>(4)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(1)</b>	<b>(1)</b>
<b>Profitto/(perdita) netto/(a)</b>	<b>(46)</b>	<b>(56)</b>	<b>(3.598)</b>	<b>758</b>	<b>(4.361)</b>	<b>2.888</b>	<b>(4.830)</b>	<b>1.464</b>
Correzioni per l'allineamento alla metodologia di valutazione specificata nel prospetto	–	(1)	–	–	–	–	–	–
<b>Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>	<b>(46)</b>	<b>(57)</b>	<b>(3.598)</b>	<b>758</b>	<b>(4.361)</b>	<b>2.888</b>	<b>(4.830)</b>	<b>1.464</b>

<sup>1</sup> Il Fondo è stato chiuso durante il periodo 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 2022

	BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund		FR Multi-Asset Fund <sup>1</sup>
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022
Note	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di EUR
Reddito di esercizio	129	47	3.050	4.988	4
Utili/(perdite) netti su strumenti finanziari	(8.413)	2.746	(29.753)	(18.134)	73
<b>Totale reddito/(perdita) da investimenti</b>	<b>(8.284)</b>	<b>2.793</b>	<b>(26.703)</b>	<b>(13.146)</b>	<b>77</b>
Spese di esercizio	(445)	(376)	(148)	(192)	(55)
<b>Reddito/(spese) netto(e) di esercizio</b>	<b>(8.729)</b>	<b>2.417</b>	<b>(26.851)</b>	<b>(13.338)</b>	<b>22</b>
<b>Costi finanziari:</b>					
Interessi passivi o oneri simili	(2)	(4)	(9)	(28)	(1)
<b>Totale costi finanziari</b>	<b>(2)</b>	<b>(4)</b>	<b>(9)</b>	<b>(28)</b>	<b>(1)</b>
<b>Profitto/(perdita) netto/(a) al lordo di imposte</b>	<b>(8.731)</b>	<b>2.413</b>	<b>(26.860)</b>	<b>(13.366)</b>	<b>21</b>
Tassazione	6	–	(316)	(438)	–
<b>Profitto/(perdita) netto/(a) al netto di imposte</b>	<b>(8.731)</b>	<b>2.413</b>	<b>(27.176)</b>	<b>(13.804)</b>	<b>21</b>
Correzioni per l'allineamento alla metodologia di valutazione specificata nel prospetto	–	–	(5)	(3)	–
<b>Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>	<b>(8.731)</b>	<b>2.413</b>	<b>(27.181)</b>	<b>(13.807)</b>	<b>21</b>

<sup>1</sup> 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 2022

	BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund <sup>1</sup>	BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	BlackRock Diversified Strategies Selection Fund <sup>2</sup>	BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1			
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021
	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Patrimonio netto all'inizio dell'esercizio finanziario	107.521	491.376	455.582	6.779	10.198	151.866	165.701
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	(13.607)	(51.445)	1.568	(151)	74	(18.018)	(1.120)
<b>Operazioni su quote:</b>							
Emissione di quote rimborsabili	24.000	39.127	2.992	11	104	733	8.007
Rimborso di quote rimborsabili	–	(7.316)	(21.279)	(6.639)	(2.115)	(4.215)	(10.587)
<b>Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto derivante da operazioni su quote</b>	<b>24.000</b>	<b>31.811</b>	<b>(18.287)</b>	<b>(6.628)</b>	<b>(2.011)</b>	<b>(3.482)</b>	<b>(2.580)</b>
<b>Patrimonio netto alla fine del periodo finanziario</b>	<b>117.914</b>	<b>471.742</b>	<b>438.863</b>	<b>–</b>	<b>8.261</b>	<b>130.366</b>	<b>162.001</b>

<sup>1</sup> Poiché il Fondo è stato lanciato nell'esercizio finanziario precedente, non sono disponibili dati comparativi.

<sup>2</sup> Il Fondo è stato chiuso durante il periodo finanziario.

La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

## BLACKROCK UCITS FUNDS

PROSPETTO SINTETICO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO (continua)  
Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2022

	BlackRock UK Credit Screened Fund	
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021
	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP
Patrimonio netto all'inizio dell'esercizio finanziario	258.941	341.390
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	(42.261)	2.409
<b>Operazioni su quote:</b>		
Emissione di quote rimborsabili	111	18.984
Rimborso di quote rimborsabili	(38.836)	(5.805)
<b>Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto derivante da operazioni su quote</b>	<b>(38.725)</b>	<b>13.179</b>
<b>Patrimonio netto alla fine del periodo finanziario</b>	<b>177.955</b>	<b>356.978</b>

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 2022

	BlackRock Defensive Screened Fund	Yield Fund 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 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021
	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di USD	Migliaia di USD
Patrimonio netto all'inizio dell'esercizio finanziario	92.491	99.720	103.950	174.445	90.067	94.771	384.733	552.045	
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	(4.766)	887	(8.797)	(538)	(9.626)	1.621	(85.313)	(25.034)	
<b>Operazioni su quote:</b>									
Emissione di quote rimborsabili	398	5.494	–	–	–	–	771	4.383	
Rimborso di quote rimborsabili	(4.708)	(9.129)	–	(37.419)	(8.823)	–	(21)	(77.659)	
<b>Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto derivante da operazioni su quote</b>	<b>(4.310)</b>	<b>(3.635)</b>	<b>–</b>	<b>(37.419)</b>	<b>(8.823)</b>	<b>–</b>	<b>750</b>	<b>(73.276)</b>	
<b>Patrimonio netto alla fine del periodo finanziario</b>	<b>83.415</b>	<b>96.972</b>	<b>95.153</b>	<b>136.488</b>	<b>71.618</b>	<b>96.392</b>	<b>300.170</b>	<b>453.735</b>	

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 2022

	BlackRock Euro Cash Fund <sup>1</sup>		BlackRock Fixed Income Selection Fund		BlackRock Global Equity Selection Fund		BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021
	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Patrimonio netto all'inizio dell'esercizio finanziario	4.882	8.976	46.105	61.631	33.555	32.461	42.318	34.969
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	(46)	(57)	(3.598)	758	(4.361)	2.888	(4.830)	1.464
<b>Operazioni su quote:</b>								
Emissione di quote rimborsabili	3	5	620	700	1.161	3.016	1.471	6.119
Rimborso di quote rimborsabili	(4.839)	(2.381)	(5.072)	(8.328)	(2.020)	(4.999)	(3.701)	(4.208)
<b>Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto derivante da operazioni su quote</b>	<b>(4.836)</b>	<b>(2.376)</b>	<b>(4.452)</b>	<b>(7.628)</b>	<b>(859)</b>	<b>(1.983)</b>	<b>(2.230)</b>	<b>1.911</b>
<b>Patrimonio netto alla fine del periodo finanziario</b>	<b>–</b>	<b>6.543</b>	<b>38.055</b>	<b>54.761</b>	<b>28.335</b>	<b>33.366</b>	<b>35.258</b>	<b>38.344</b>

<sup>1</sup> Il Fondo è stato chiuso durante il periodo 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 2022

	BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund		FR Multi-Asset Fund <sup>1</sup>
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022 Migliaia di EUR	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021 Migliaia di EUR	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022 Migliaia di USD	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021 Migliaia di USD	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022 Migliaia di EUR
Patrimonio netto all'inizio dell'esercizio finanziario	87.605	54.542	270.128	301.610	–
Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	(8.731)	2.413	(27.181)	(13.807)	21
<b>Operazioni su quote:</b>					
Emissione di quote rimborsabili	16.906	29.093	10.005	–	54.764
Rimborso di quote rimborsabili	(3.814)	(4.869)	(242.946)	–	–
<b>Aumento/(diminuzione) del patrimonio netto derivante da operazioni su quote</b>	<b>13.092</b>	<b>24.224</b>	<b>(232.941)</b>	<b>–</b>	<b>54.764</b>
<b>Patrimonio netto alla fine del periodo finanziario</b>	<b>91.966</b>	<b>81.179</b>	<b>10.006</b>	<b>287.803</b>	<b>54.785</b>

<sup>1</sup> Poiché 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 2022

		BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund		BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1		BlackRock Diversified Strategies Selection Fund <sup>1</sup>		BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	
		AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022
	Note	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
<b>ATTIVITÀ CORRENTI</b>									
Liquidità		52	28	7	239	70	4	11	79
Strumenti liquidi equivalenti		–	–	1.243	2.168	–	–	310	345
Liquidità a margine		–	–	–	12	–	–	–	–
Crediti		8	8	7.267	5.723	2	38	2.342	4.175
Attività finanziarie al valore equo in conto economico	4	117.977	107.551	466.520	487.277	–	6.823	129.144	150.544
<b>Totale attività correnti</b>		<b>118.037</b>	<b>107.587</b>	<b>475.037</b>	<b>495.419</b>	<b>72</b>	<b>6.865</b>	<b>131.807</b>	<b>155.143</b>
<b>PATRIMONIO NETTO</b>									
Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	7	117.914	107.521	471.742	491.376	–	6.779	130.366	151.866
<b>Totale patrimonio netto</b>		<b>117.914</b>	<b>107.521</b>	<b>471.742</b>	<b>491.376</b>	<b>–</b>	<b>6.779</b>	<b>130.366</b>	<b>151.866</b>
<b>PASSIVITÀ CORRENTI</b>									
Debiti		123	66	3.295	4.043	72	59	1.441	3.277
Passività finanziarie al valore equo in conto economico	4	–	–	–	–	–	27	–	–
<b>Totale passività correnti</b>		<b>123</b>	<b>66</b>	<b>3.295</b>	<b>4.043</b>	<b>72</b>	<b>86</b>	<b>1.441</b>	<b>3.277</b>
<b>Totale patrimonio netto e passività</b>		<b>118.037</b>	<b>107.587</b>	<b>475.037</b>	<b>495.419</b>	<b>72</b>	<b>6.865</b>	<b>131.807</b>	<b>155.143</b>

<sup>1</sup> Il Fondo è stato chiuso durante il periodo finanziario.  
La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

## BLACKROCK UCITS FUNDS

### STATO PATRIMONIALE SINTETICO (continua)

Al 30 settembre 2022

	BlackRock UK Credit Screened Fund	
	Al 30 settembre 2022	Al 31 marzo 2022
Note	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP

#### ATTIVITÀ CORRENTI

Liquidità	10	129
Strumenti liquidi equivalenti	2.743	1.351
Crediti	7.235	5.430
Attività finanziarie al valore equo in conto economico	4 174.543	255.534
<b>Totale attività correnti</b>	<b>184.531</b>	<b>262.444</b>

#### PATRIMONIO NETTO

Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili	7 177.955	258.941
<b>Totale patrimonio netto</b>	<b>177.955</b>	<b>258.941</b>

#### PASSIVITÀ CORRENTI

Debiti	6.576	3.503
<b>Totale passività correnti</b>	<b>6.576</b>	<b>3.503</b>

<b>Totale patrimonio netto e passività</b>	<b>184.531</b>	<b>262.444</b>
--	----------------	----------------

La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

# BLACKROCK UCITS FUNDS

STATO PATRIMONIALE SINTETICO (continua)  
Al 30 settembre 2022

	BlackRock Defensive Yield Fund ESG Screened Fund		BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund		BlackRock Diversifying Fixed Income Fund		BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	
	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 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
<b>ATTIVITÀ CORRENTI</b>								
Liquidità	55	109	1.460	924	15	73	56.802	36.530
Strumenti liquidi equivalenti	1.531	2.294	–	–	4.412	5.287	–	–
Liquidità a margine	–	6	–	–	–	89	7.430	3.972
Garanzia liquida	–	–	–	–	–	–	262	–
Crediti	661	726	686	1.376	7.111	219	7.273	31.978
Attività finanziarie al valore equo in conto economico	4	81.367	89.771	94.901	103.142	68.380	85.178	237.199
<b>Totale attività correnti</b>	<b>83.614</b>	<b>92.906</b>	<b>97.047</b>	<b>105.442</b>	<b>79.918</b>	<b>90.846</b>	<b>308.966</b>	<b>401.428</b>
<b>PASSIVITÀ CORRENTI</b>								
Scoperto bancario	–	–	–	–	–	–	–	431
Liquidità a margine esigibile	–	6	–	–	–	121	–	1.803
Garanzia liquida esigibile	–	–	30	10	–	–	–	2.114
Debiti	199	401	99	84	6.843	64	4.016	12.344
Passività finanziarie al valore equo in conto economico	4	8	1.765	1.398	1.470	610	4.780	3
<b>Totale passività correnti</b>	<b>199</b>	<b>415</b>	<b>1.894</b>	<b>1.492</b>	<b>8.313</b>	<b>795</b>	<b>8.796</b>	<b>16.695</b>
<b>Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>								
	83.415	92.491	95.153	103.950	71.605	90.051	300.170	384.733
Correzioni per l'allineamento alla metodologia di valutazione specificata nel prospetto	7	–	–	–	13	16	–	–
<b>Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>	<b>7</b>	<b>83.415</b>	<b>92.491</b>	<b>95.153</b>	<b>71.618</b>	<b>90.067</b>	<b>300.170</b>	<b>384.733</b>

La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.



# BLACKROCK UCITS FUNDS

STATO PATRIMONIALE SINTETICO (continua)  
Al 30 settembre 2022

	BlackRock Euro Cash Fund <sup>1</sup>		BlackRock Fixed Income Selection Fund		BlackRock Global Equity Selection Fund		BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund		
	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	
Note	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	
<b>ATTIVITÀ CORRENTI</b>									
Liquidità	69	–	29	900	20	6	36	27	
Strumenti liquidi equivalenti	–	4.928	–	–	–	–	–	–	
Crediti	–	–	558	2	253	35	700	236	
Attività finanziarie al valore equo in conto economico	4	–	38.254	45.483	28.349	33.607	35.237	42.304	
<b>Totale attività correnti</b>	<b>69</b>	<b>4.928</b>	<b>38.841</b>	<b>46.385</b>	<b>28.622</b>	<b>33.648</b>	<b>35.973</b>	<b>42.567</b>	
<b>PASSIVITÀ CORRENTI</b>									
Debiti	69	46	654	198	287	93	522	114	
Passività finanziarie al valore equo in conto economico	4	–	132	82	–	–	193	135	
<b>Totale passività correnti</b>	<b>69</b>	<b>46</b>	<b>786</b>	<b>280</b>	<b>287</b>	<b>93</b>	<b>715</b>	<b>249</b>	
<b>Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>	7	–	4.882	38.055	46.105	28.335	33.555	35.258	42.318

<sup>1</sup> Il Fondo è stato chiuso durante il periodo finanziario.  
La nota integrativa costituisce parte integrante del presente bilancio.

# BLACKROCK UCITS FUNDS

STATO PATRIMONIALE SINTETICO (continua)  
Al 30 settembre 2022

		BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund		FR Multi-Asset Fund <sup>1</sup>
		AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 30 settembre 2022
	Note	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di EUR
<b>ATTIVITÀ CORRENTI</b>						
Liquidità		548	959	1.484	37.157	1.202
Liquidità a margine		–	–	208	2.865	181
Crediti		7.409	73	13.647	1.408	3.320
Attività finanziarie al valore equo in conto economico	4	91.466	86.975	7.945	232.672	64.095
<b>Totale attività correnti</b>		<b>99.423</b>	<b>88.007</b>	<b>23.284</b>	<b>274.102</b>	<b>68.798</b>
<b>PASSIVITÀ CORRENTI</b>						
Liquidità a margine esigibile		–	–	14	1.320	111
Garanzia liquida esigibile		–	–	58	2.038	–
Debiti		6.880	140	13.092	619	5.544
Passività finanziarie al valore equo in conto economico	4	577	262	117	5	8.358
<b>Totale passività correnti</b>		<b>7.457</b>	<b>402</b>	<b>13.281</b>	<b>3.982</b>	<b>14.013</b>
<b>Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>						
		91.966	87.605	10.003	270.120	54.785
Correzioni per l'allineamento alla metodologia di valutazione specificata nel prospetto	7	–	–	3	8	–
<b>Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>	7	<b>91.966</b>	<b>87.605</b>	<b>10.006</b>	<b>270.128</b>	<b>54.785</b>

<sup>1</sup> Poiché 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 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 Diversified Strategies Selection Fund, BlackRock Euro Cash Fund e BlackRock Fixed Income Selection Fund sono stati redatti senza il presupposto della continuità aziendale in quanto tali Fondi sono stati chiusi durante il periodo. Il 29 giugno 2022, gli Amministratori hanno deciso di chiudere BlackRock Diversified Strategies Selection Fund e BlackRock Euro Cash Fund con effetto dal 31 agosto 2022. Il 29 giugno 2022, gli Amministratori hanno deciso di chiudere BlackRock Fixed Income Selection Fund. Per i Fondi redatti senza 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 ogni 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.

Uno strumento di misurazione utilizzato dal Risk and Quantitative Analysis Group per misurare il rischio di mercato è il Value-at-Risk ("VaR"), che prende in considerazione rischio valutario, tasso d'interesse e prezzo. Il VaR è una misurazione del rischio statistico che stima la potenziale perdita di portafoglio derivante da movimenti di mercato avversi in un contesto di mercato normale. L'analisi del VaR riflette le interdipendenze tra variabili di rischio, a differenza di un'analisi della sensibilità tradizionale.

Il VaR a un giorno basato su un livello di confidenza del 99% è definito nella tabella sotto riportata:

Nome del Fondo	2022 %	2021 %
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	3,53	n.a.
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	1,04	0,25
BlackRock Diversified Strategies Selection Fund <sup>1</sup>	n.a.	0,41
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	1,38	0,49
BlackRock UK Credit Screened Fund	2,05	0,61
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	0,61	0,07
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	0,89	0,36
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	0,93	0,30
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	3,17	2,65
BlackRock Euro Cash Fund <sup>1</sup>	n.a.	0,00
BlackRock Fixed Income Selection Fund	0,69	0,27
BlackRock Global Equity Selection Fund	3,40	2,49
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	1,48	1,05
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	1,01	0,81
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	3,46	2,81
FR Multi-Asset Fund <sup>2</sup>	1,86	n.a.

<sup>1</sup> Il Fondo è stato chiuso durante il periodo finanziario.

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

### 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.

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

### 4. Gerarchia del valore equo (continua)

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.

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") e gli investimenti in 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 e dell'ETF partecipati 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 e 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 sintetico;
- (vii) 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 dello stato patrimoniale sintetico;
- (viii) 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;
- (ix) per le opzioni in valuta estera, i modelli di prezzo delle opzioni; e
- (x) 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 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 2022 e al 31 marzo 2022:

<b>30 settembre 2022</b>	<b>Livello 1</b>	<b>Livello 2</b>	<b>Livello 3</b>	<b>Totale</b>
	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
<b>BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund</b>				
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	37.554	–	37.554
ETF	–	80.423	–	80.423
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>117.977</b>	<b>–</b>	<b>117.977</b>
<b>BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1</b>				
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	466.520	–	466.520
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>466.520</b>	<b>–</b>	<b>466.520</b>
<b>BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1</b>				
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	129.144	–	129.144
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>129.144</b>	<b>–</b>	<b>129.144</b>

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

### 4. Gerarchia del valore equo (continua)

30 settembre 2022	Livello 1	Livello 2	Livello 3	Totale
<b>BlackRock UK Credit Screened Fund</b>	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP	Migliaia di GBP
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	174.543	–	174.543
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>174.543</b>	<b>–</b>	<b>174.543</b>
<b>BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	81.335	–	81.335
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	32	–	32
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>81.367</b>	<b>–</b>	<b>81.367</b>
<b>BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	92.480	–	92.480
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	2.421	–	2.421
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>94.901</b>	<b>–</b>	<b>94.901</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(1.765)	–	(1.765)
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>(1.765)</b>	<b>–</b>	<b>(1.765)</b>
<b>BlackRock Diversifying Fixed Income Fund</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	42.593	–	42.593
ETF	–	25.570	–	25.570
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	217	–	217
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>68.380</b>	<b>–</b>	<b>68.380</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(1.470)	–	(1.470)
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>(1.470)</b>	<b>–</b>	<b>(1.470)</b>
<b>BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund</b>	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Azioni	236.777	–	218	236.995
Utili non realizzati su contratti per differenze	–	204	–	204
<b>Totale</b>	<b>236.777</b>	<b>204</b>	<b>218</b>	<b>237.199</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti per differenze	–	(1.015)	–	(1.015)
Perdite non realizzate su contratti future	(3.765)	–	–	(3.765)
<b>Totale</b>	<b>(3.765)</b>	<b>(1.015)</b>	<b>–</b>	<b>(4.780)</b>
<b>BlackRock Fixed Income Selection Fund</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	29.268	–	29.268
ETF	8.986	–	–	8.986
<b>Totale</b>	<b>8.986</b>	<b>29.268</b>	<b>–</b>	<b>38.254</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(132)	–	(132)
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>(132)</b>	<b>–</b>	<b>(132)</b>
<b>BlackRock Global Equity Selection Fund</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	19.733	–	19.733
ETF	8.616	–	–	8.616
<b>Totale</b>	<b>8.616</b>	<b>19.733</b>	<b>–</b>	<b>28.349</b>
<b>BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	25.470	–	25.470
ETF	9.758	–	–	9.758
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	9	–	9
<b>Totale</b>	<b>9.758</b>	<b>25.479</b>	<b>–</b>	<b>35.237</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(193)	–	(193)
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>(193)</b>	<b>–</b>	<b>(193)</b>
<b>BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	54.883	–	54.883
ETF	36.548	–	–	36.548
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	35	–	35
<b>Totale</b>	<b>36.548</b>	<b>54.918</b>	<b>–</b>	<b>91.466</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(577)	–	(577)
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>(577)</b>	<b>–</b>	<b>(577)</b>

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

### 4. Gerarchia del valore equo (continua)

<b>30 settembre 2022</b>	<b>Livello 1</b>	<b>Livello 2</b>	<b>Livello 3</b>	<b>Totale</b>
<b>BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund</b>	<b>Migliaia di USD</b>	<b>Migliaia di USD</b>	<b>Migliaia di USD</b>	<b>Migliaia di USD</b>
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Azioni	6.394	–	352	6.746
Obbligazioni	–	1.198	–	1.198
Utili non realizzati su contratti per differenze	–	1	–	1
<b>Totale</b>	<b>6.394</b>	<b>1.199</b>	<b>352</b>	<b>7.945</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti per differenze	–	(21)	–	(21)
Perdite non realizzate su contratti future	(96)	–	–	(96)
<b>Totale</b>	<b>(96)</b>	<b>(21)</b>	<b>–</b>	<b>(117)</b>
<b>FR Multi-Asset Fund<sup>1</sup></b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	30.648	–	30.648
ETF	23.510	–	–	23.510
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	9.803	–	9.803
Utili non realizzati su contratti future	134	–	–	134
<b>Totale</b>	<b>23.644</b>	<b>40.451</b>	<b>–</b>	<b>64.095</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(8.273)	–	(8.273)
Perdite non realizzate su contratti future	(85)	–	–	(85)
<b>Totale</b>	<b>(85)</b>	<b>(8.273)</b>	<b>–</b>	<b>(8.358)</b>
<b>31 marzo 2022</b>	<b>Livello 1</b>	<b>Livello 2</b>	<b>Livello 3</b>	<b>Totale</b>
<b>BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	33.999	–	33.999
ETF	73.552	–	–	73.552
<b>Totale</b>	<b>73.552</b>	<b>33.999</b>	<b>–</b>	<b>107.551</b>
<b>BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	487.261	–	487.261
Utili non realizzati su contratti future	16	–	–	16
<b>Totale</b>	<b>16</b>	<b>487.261</b>	<b>–</b>	<b>487.277</b>
<b>BlackRock Diversified Strategies Selection Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	6.814	–	6.814
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	9	–	9
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>6.823</b>	<b>–</b>	<b>6.823</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(27)	–	(27)
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>(27)</b>	<b>–</b>	<b>(27)</b>
<b>BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	150.544	–	150.544
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>150.544</b>	<b>–</b>	<b>150.544</b>
<b>BlackRock UK Credit Screened Fund</b>	<b>Migliaia di GBP</b>	<b>Migliaia di GBP</b>	<b>Migliaia di GBP</b>	<b>Migliaia di GBP</b>
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	255.534	–	255.534
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>255.534</b>	<b>–</b>	<b>255.534</b>
<b>BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	89.771	–	89.771
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>89.771</b>	<b>–</b>	<b>89.771</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(8)	–	(8)
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>(8)</b>	<b>–</b>	<b>(8)</b>
<b>BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Obbligazioni	–	102.528	41	102.569
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	573	–	573
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>103.101</b>	<b>41</b>	<b>103.142</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(1.398)	–	(1.398)
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>(1.398)</b>	<b>–</b>	<b>(1.398)</b>

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

### 4. Gerarchia del valore equo (continua)

31 marzo 2022	Livello 1	Livello 2	Livello 3	Totale
<b>BlackRock Diversifying Fixed Income Fund</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	52.295	–	52.295
ETF	32.515	–	–	32.515
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	267	–	267
Utili non realizzati su contratti future	101	–	–	101
<b>Totale</b>	<b>32.616</b>	<b>52.562</b>	<b>–</b>	<b>85.178</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(597)	–	(597)
Perdite non realizzate su contratti future	(13)	–	–	(13)
<b>Totale</b>	<b>(13)</b>	<b>(597)</b>	<b>–</b>	<b>(610)</b>
<b>BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund</b>	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Azioni	325.229	–	1	325.230
Utili non realizzati su contratti per differenze	–	1.982	–	1.982
Utili non realizzati su contratti future	1.736	–	–	1.736
<b>Totale</b>	<b>326.965</b>	<b>1.982</b>	<b>1</b>	<b>328.948</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti per differenze	–	(3)	–	(3)
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>(3)</b>	<b>–</b>	<b>(3)</b>
<b>BlackRock Fixed Income Selection Fund</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	38.316	–	38.316
ETF	7.164	–	–	7.164
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	3	–	3
<b>Totale</b>	<b>7.164</b>	<b>38.319</b>	<b>–</b>	<b>45.483</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(82)	–	(82)
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>(82)</b>	<b>–</b>	<b>(82)</b>
<b>BlackRock Global Equity Selection Fund</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	24.337	–	24.337
ETF	9.270	–	–	9.270
<b>Totale</b>	<b>9.270</b>	<b>24.337</b>	<b>–</b>	<b>33.607</b>
<b>BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	35.018	–	35.018
ETF	7.282	–	–	7.282
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	4	–	4
<b>Totale</b>	<b>7.282</b>	<b>35.022</b>	<b>–</b>	<b>42.304</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(135)	–	(135)
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>(135)</b>	<b>–</b>	<b>(135)</b>
<b>BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Organismi di investimento collettivo	–	64.798	–	64.798
ETF	22.170	–	–	22.170
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	–	7	–	7
<b>Totale</b>	<b>22.170</b>	<b>64.805</b>	<b>–</b>	<b>86.975</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	–	(262)	–	(262)
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>(262)</b>	<b>–</b>	<b>(262)</b>
<b>BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund</b>	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD
Attività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Azioni	229.561	–	2	229.563
Utili non realizzati su contratti per differenze	–	1.834	–	1.834
Utili non realizzati su contratti future	1.275	–	–	1.275
<b>Totale</b>	<b>230.836</b>	<b>1.834</b>	<b>2</b>	<b>232.672</b>
Passività finanziarie al valore equo in conto economico:				
Perdite non realizzate su contratti per differenze	–	(5)	–	(5)
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>(5)</b>	<b>–</b>	<b>(5)</b>

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

## 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 Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund		BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021
	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Maggio	-	-	(107)	(465)
Giugno	-	(300)	-	-
Settembre	-	(146)	-	-
<b>Distribuzioni dichiarate</b>				
Reddito di perequazione	-	(152)	(18)	-
<b>Totale</b>	<b>-</b>	<b>(598)</b>	<b>(125)</b>	<b>(465)</b>

#### 6. Tassazione

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2022

	Bond Index Fund 1		Fund 1		BlackRock UK Credit Screened Fund		Screened Fund	
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021
<b>Imposte correnti</b>								
Ritenuta d'acconto sui redditi esteri non recuperabile	(1)	10	(2)	2	-	6	-	4
<b>Totale imposte</b>	<b>(1)</b>	<b>10</b>	<b>(2)</b>	<b>2</b>	<b>-</b>	<b>6</b>	<b>-</b>	<b>4</b>



# BLACKROCK UCITS FUNDS

## NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

### 6. Tassazione (continua)

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2022

	BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2022
	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021	Per il periodo chiuso il 30 settembre 2021

#### Imposte correnti

Ritenuta d'acconto sui redditi esteri  
non recuperabile

	(37)	(19)	(772)	(551)	(316)	(438)
<b>Totale imposte</b>	<b>(37)</b>	<b>(19)</b>	<b>(772)</b>	<b>(551)</b>	<b>(316)</b>	<b>(438)</b>

#### 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.

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

### 7. Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili

Al 30 settembre 2022

		AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 31 marzo 2021
<b>BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund<sup>1</sup></b>				
<b>- Classe di Quote Istituzionali a Distribuzione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	117.914	107.521	–
Quote in circolazione		13.545.796	10.890.315	–
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	8,70	9,87	–
<b>BlackRock Diversified Strategies Selection Fund<sup>2</sup></b>				
<b>Classe E ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	–	6.779	10.198
Quote in circolazione		–	707.139	1.045.330
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	–	9,59	9,76
<b>BlackRock UK Credit Screened Fund</b>				
<b>Classe di quote ad accumulazione flessibile</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di GBP	177.955	258.941	341.390
Quote in circolazione		12.621.937	15.014.988	18.780.643
Valore patrimoniale netto per quota	GBP	14,10	17,25	18,18
<b>BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund</b>				
<b>Classe D ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	17.433	19.305	18.332
Quote in circolazione		1.816.191	1.890.014	1.757.312
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	9,60	10,21	10,43
<b>Classe D CHF coperta ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di CHF	1.809	2.054	5.180
Quote in circolazione		191.809	204.301	503.131
Valore patrimoniale netto per quota	CHF	9,43	10,05	10,30
<b>Classe D a distribuzione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	2.586	2.937	3.874
Quote in circolazione		297.390	317.390	403.230
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	8,70	9,25	9,61
<b>Classe Z ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	52.154	58.435	59.717
Quote in circolazione		5.418.224	5.706.066	5.711.172
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	9,63	10,24	10,46
<b>Classe Z CHF coperta ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di CHF	9.026	10.038	14.501
Quote in circolazione		955.329	997.099	1.406.826
Valore patrimoniale netto per quota	CHF	9,45	10,07	10,31
<b>Classe di quote ad accumulazione flessibile</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	5	5	5
Quote in circolazione		482	482	482
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	9,71	10,32	10,52
<b>BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund EUR - Classe di quote ad accumulazione flessibile</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	2.318	2.530	2.686
Quote in circolazione		233.040	233.040	233.040
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	9,94	10,86	11,53
<b>EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	92.835	101.420	107.837
Quote in circolazione		10.634.678	10.634.678	10.634.678
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	8,73	9,54	10,14
<b>BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund</b>				
<b>Classe D ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di USD	1	1	1
Quote in circolazione		100	100	100
Valore patrimoniale netto per quota	USD	8,83	11,36	13,07
<b>Classe Z ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di USD	139.576	179.331	205.893
Quote in circolazione		16.007.366	16.007.366	16.007.366
Valore patrimoniale netto per quota	USD	8,72	11,20	12,86
<b>Classe di quote ad accumulazione flessibile</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di USD	67.727	86.782	201.493
Quote in circolazione		7.549.045	7.551.375	15.363.241
Valore patrimoniale netto per quota	USD	8,97	11,49	13,12

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

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

		AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 31 marzo 2021
<b>BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund (continua)</b>				
<b>Classe di quote istituzionali ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di USD	92.866	118.619	144.658
Quote in circolazione		10.654.836	10.581.890	11.217.624
Valore patrimoniale netto per quota	USD	8,72	11,21	12,90
<b>BlackRock Fixed Income Selection Fund</b>				
<b>Classe A ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	121	153	158
Quote in circolazione		13.200	15.320	15.320
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	9,15	9,98	10,32
<b>Classe D ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	23.464	26.091	30.417
Quote in circolazione		2.429.502	2.486.898	2.825.532
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	9,66	10,49	10,76
<b>Classe E ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	14.470	19.861	31.056
Quote in circolazione		1.591.267	2.002.078	3.025.357
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	9,09	9,92	10,27
<b>BlackRock Global Equity Selection Fund</b>				
<b>Classe A ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	2.103	2.931	883
Quote in circolazione		158.460	191.556	62.312
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	13,27	15,30	14,17
<b>Classe D ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	10.118	11.613	10.954
Quote in circolazione		646.139	646.717	665.686
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	15,66	17,96	16,45
<b>Classe E ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	16.114	19.011	20.624
Quote in circolazione		1.131.158	1.156.349	1.351.799
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	14,25	16,44	15,26
<b>BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund</b>				
<b>Classe D ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	9.045	11.052	6.858
Quote in circolazione		807.330	874.575	547.032
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	11,20	12,64	12,54
<b>Classe E ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	26.213	31.266	28.111
Quote in circolazione		2.545.110	2.675.831	2.397.116
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,30	11,68	11,73
<b>BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund</b>				
<b>Classe A ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	947	1.210	978
Quote in circolazione		94.177	109.311	88.385
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,05	11,07	11,06
<b>Classe D ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	54.483	47.122	24.859
Quote in circolazione		5.053.732	3.987.951	2.125.409
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,78	11,82	11,70
<b>Classe E ad accumulazione</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	36.531	39.273	28.705
Quote in circolazione		3.639.121	3.551.738	2.596.548
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	10,04	11,06	11,06
<b>Classe di quote ad accumulazione flessibile<sup>3</sup></b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	5	–	–
Quote in circolazione		475	–	–
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	9,87	–	–

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

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

		AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 31 marzo 2021
<b>FR Multi-Asset Fund<sup>4</sup></b>				
<b>Istituzionale ad accumulazione in EUR</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di EUR	5	–	–
Quote in circolazione		499	–	–
Valore patrimoniale netto per quota	EUR	9,45	–	–
<b>Istituzionale ad accumulazione coperta in SEK</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di SEK	50	–	–
Quote in circolazione		533	–	–
Valore patrimoniale netto per quota	SEK	94,38	–	–
<b>Istituzionale ad accumulazione coperta in USD</b>				
Valore patrimoniale netto	Migliaia di USD	53.661	–	–
Quote in circolazione		5.529.374	–	–
Valore patrimoniale netto per quota	USD	9,70	–	–

<sup>1</sup> Poiché il Fondo è stato lanciato durante l'esercizio finanziario precedente, non sono disponibili dati comparativi.

<sup>2</sup> Il Fondo è stato chiuso durante l'esercizio finanziario.

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

<sup>4</sup> Poiché il Fondo è stato lanciato durante il periodo finanziario, non sono disponibili dati comparativi.

	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 31 marzo 2021
<b>BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1</b>			
	<b>Migliaia di EUR</b>		
<b>Valore patrimoniale netto</b>			
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104	471.742	491.376	455.582
Rettifiche effettuate per:			
- Costi di costituzione	4	4	4
<b>Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto</b>	<b>471.746</b>	<b>491.380</b>	<b>455.586</b>
<b>N. di quote in circolazione</b>			
EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	49.328.711	46.169.540	40.565.890
<b>Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104</b>			
EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	EUR 9,56	EUR 10,64	EUR 11,23
<b>Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto</b>			
EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	EUR 9,56	EUR 10,64	EUR 11,23

	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 31 marzo 2021
<b>BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1</b>			
	<b>Migliaia di EUR</b>		
<b>Valore patrimoniale netto</b>			
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104	130.366	151.866	165.701
Rettifiche effettuate per:			
- Costi di costituzione	4	4	4
<b>Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto</b>	<b>130.370</b>	<b>151.870</b>	<b>165.705</b>
<b>N. di quote in circolazione</b>			
EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	13.819.371	14.152.817	14.447.809
<b>Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104</b>			
EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	EUR 9,43	EUR 10,73	EUR 11,47
<b>Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto</b>			
EUR - Classe di quote istituzionali ad accumulazione	EUR 9,43	EUR 10,73	EUR 11,47

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

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

<b>BlackRock Diversifying Fixed Income Fund</b>	<b>AI 30 settembre 2022</b>	<b>AI 31 marzo 2022</b>	<b>AI 31 marzo 2021</b>
	<b>Migliaia di EUR</b>		
<b>Valore patrimoniale netto</b>			
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104	71.605	90.051	94.749
Rettifiche effettuate per:			
- Costi di costituzione	13	16	22
<b>Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto</b>	<b>71.618</b>	<b>90.067</b>	<b>94.771</b>
<b>N. di quote in circolazione</b>			
Classe di quote istituzionali 1 a distribuzione	7.050.651	7.050.651	7.050.651
Classe di quote istituzionali 2 a distribuzione	1.468.501	2.498.501	2.498.501
<b>Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104</b>			
Classe di quote istituzionali 1 a distribuzione	EUR 8,40	EUR 9,41	EUR 9,88
Classe di quote istituzionali 2 a distribuzione	EUR 8,45	EUR 9,48	EUR 10,05
<b>Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto</b>			
Classe di quote istituzionali 1 a distribuzione	EUR 8,40	EUR 9,42	EUR 9,88
Classe di quote istituzionali 2 a distribuzione	EUR 8,45	EUR 9,48	EUR 10,05

<b>BlackRock Euro Cash Fund<sup>1</sup></b>	<b>AI 30 settembre 2022</b>	<b>AI 31 marzo 2022</b>	<b>AI 31 marzo 2021</b>
	<b>Migliaia di EUR</b>		
<b>Valore patrimoniale netto</b>			
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104	-	4.882	8.975
Rettifiche effettuate per:			
- Costi di costituzione	-	-	1
<b>Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto</b>	<b>-</b>	<b>4.882</b>	<b>8.976</b>
<b>N. di quote in circolazione</b>			
Classe D ad accumulazione	-	100	100
Classe E ad accumulazione	-	521.965	941.871
<b>Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104</b>			
Classe D ad accumulazione	-	EUR 9,40	EUR 9,57
Classe E ad accumulazione	-	EUR 9,35	EUR 9,53
<b>Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto</b>			
Classe D ad accumulazione	-	EUR 9,40	EUR 9,57
Classe E ad accumulazione	-	EUR 9,35	EUR 9,53

<sup>1</sup> Il Fondo è stato chiuso durante il periodo finanziario.

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

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

BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	AI 30 settembre 2022	AI 31 marzo 2022	AI 31 marzo 2021
	Migliaia di USD		
<b>Valore patrimoniale netto</b>			
Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104	10.003	270.120	301.595
Rettifiche effettuate per:			
- Costi di costituzione	3	8	15
<b>Patrimonio netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto</b>	<b>10.006</b>	<b>270.128</b>	<b>301.610</b>
<b>N. di quote in circolazione</b>			
Classe A ad accumulazione	100	100	100
Classe di quote ad accumulazione flessibile	1.225.941	25.184.855	25.184.855
Classe di quote ad accumulazione flessibile in NZD	810	-	-
<b>Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità con l'FRS 104</b>			
Classe A ad accumulazione	USD 7,95	USD 10,49	USD 11,78
Classe di quote ad accumulazione flessibile	USD 8,16	USD 10,73	USD 11,98
Classe di quote ad accumulazione flessibile in NZD <sup>1</sup>	NZD 9,69	-	-
<b>Valore patrimoniale netto per quota attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili in conformità al prospetto</b>			
Classe A ad accumulazione	USD 7,95	USD 10,49	USD 11,78
Classe di quote ad accumulazione flessibile	USD 8,16	USD 10,73	USD 11,98
Classe di quote ad accumulazione flessibile in NZD <sup>1</sup>	NZD 9,69	-	-

<sup>1</sup> Poiché il Fondo è stato lanciato durante l'esercizio finanziario, non sono disponibili dati comparativi.

### 8. Tassi di cambio

In data 30 settembre 2022 e 31 marzo 2022 i tassi di cambio in vigore erano i seguenti:

	30 settembre 2022	31 marzo 2022
<b>EUR = 1</b>		
AUD	1,5237	1,4817
CAD	1,3461	1,3898
CHF	0,9642	1,0239
CLP	938,4410	875,5721
CNY	6,9841	7,0577
COP	4.500,5169	4.176,5598
CZK	24,5715	24,4254
DKK	7,4354	7,4385
GBP	0,8776	0,8451
HKD	7,6902	8,7136
HUF	423,0750	367,2400
IDR	14.917,6202	15.980,4353
ILS	3,4847	3,5507
JPY	141,7994	135,0479
KRW	1.401,5852	1.348,5874
MXN	19,6983	22,1885
MYR	4,5426	4,6784
NOK	10,6755	9,7290
NZD	1,7319	1,5997
PEN	3,8967	4,1335
PLN	4,8385	4,6367
RON	4,9508	4,9419
RUB	59,8811	91,6267
SEK	10,8717	10,3692
SGD	1,4057	1,5058
THB	36,9524	36,9956
USD	0,9796	1,1126
ZAR	17,6068	16,2586

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

### 8. Tassi di cambio (continua)

	30 settembre 2022	31 marzo 2022
<b>GBP = 1</b>		
EUR	1,1395	1,1833
<b>USD = 1</b>		
AED	3,6731	3,6731
BRL	5,4089	4,7520
CLP	957,9350	786,9250
CNY	7,1292	6,3431
CZK	25,0820	21,9525
EUR	1,0208	0,8988
GBP	0,8958	0,7595
HKD	7,8499	7,8314
HUF	431,8635	330,0589
IDR	15.227,5000	14.362,5000
KRW	1.430,7000	1.212,0500
KWD	0,3100	0,3038
MXN	20,1075	19,9420
MYR	4,6370	4,2048
NZD	1,7679	1,4377
PHP	58,6250	51,7450
PLN	4,9390	4,1673
QAR	3,6735	3,6418
RUB	61,1250	82,3500
SAR	3,7570	3,7515
THB	37,7200	33,2500
TRY	18,5385	14,6678
TWD	31,7490	28,6515
ZAR	17,9725	14,6125

### 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.

Le seguenti entità erano parti correlate dell'Entità durante il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2022:

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, filiale di Copenhagen
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 Diversified Strategies Selection Fund	BlackRock Investment Management (UK) Limited
BlackRock Euro Cash Fund	BlackRock Institutional Trust Company, N.A.
BlackRock Fixed Income Selection 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 Emerging Markets Alpha Tilts 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.



# BLACKROCK UCITS FUNDS

## NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

### 9. Operazioni con parti correlate (continua)

Nella tabella seguente sono indicati gli Amministratori al 30 settembre 2022:

Amministratori	Dipendenti del Gruppo BlackRock	Amministratore delle consociate BlackRock e/o di altri fondi gestiti da BlackRock
Rosemary Quinlan	No	No
Graham Bamping	No	No
Patrick Boylan	Si	Si
Michael Hodson	No	No
Enda McMahon	Si	No
Justin Mealy	Si	No
Adele Spillane	Si	Si
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
<b>ICAV - OICVM autorizzato in Irlanda da CBI</b>	
BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Classe X EUR Accumulating	NA <sup>1</sup>
BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	NA <sup>1</sup>
BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe Z EUR Hedged Accumulating	Spesa annua massima pari allo 0,30% del NAV <sup>1</sup>
BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating	NA <sup>1</sup>
BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating	NA <sup>1</sup>
BlackRock Sustainable Equity Factor Plus Fund - Classe X EUR Accumulating	NA <sup>1</sup>
BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	NA <sup>1</sup>
<b>Società d'investimento - OICVM autorizzato in Germania dall'Autorità federale di vigilanza finanziaria (BaFin)</b>	
iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF (DE)	Spesa annua massima pari allo 0,46% del NAV <sup>1</sup>
<b>Società d'investimento - OICVM autorizzato in Irlanda da CBI</b>	
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc TO)	Spesa annua massima pari allo 0,03% del NAV <sup>2</sup>
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund - Azioni Agency	Spesa annua massima pari allo 0,03% del NAV <sup>2</sup>
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Dis)	Spesa annua massima pari allo 0,03% del NAV <sup>2</sup>
iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	Spesa annua massima pari all'1,00% del NAV <sup>1</sup>
iShares \$ TIPS UCITS ETF - EUR Hedged (Acc) Share Class	Spesa annua massima pari all'1,00% del NAV <sup>1</sup>
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	Spesa annua massima pari all'1,00% del NAV <sup>1</sup>
iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,07% del NAV <sup>1</sup>
iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	Spesa annua massima pari all'1,00% del NAV <sup>1</sup>
iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,07% del NAV <sup>1</sup>
iShares € Govt Bond 15-30yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,20% del NAV <sup>1</sup>
iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,09% del NAV <sup>1</sup>
iShares € High Yield Corp Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,50% del NAV <sup>1</sup>
iShares € Inflation Linked Govt Bond UCITS ETF - EUR (Acc) Share Class	Spesa annua massima pari allo 0,25% del NAV <sup>1</sup>
iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,09% del NAV <sup>1</sup>
iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	Spesa annua massima pari all'1,00% del NAV <sup>1</sup>
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF - Classe di Azioni GBP (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,07% del NAV <sup>1</sup>
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,20% del NAV <sup>1</sup>
iShares Core S&P 500 UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,07% del NAV <sup>1</sup>
iShares Developed World ESG Screened Index Fund (IE) - Classe di Azioni US Dollar Flexible Accumulating	Spesa annua massima pari allo 0,30% del NAV <sup>3</sup>
iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,19% del NAV <sup>1</sup>
iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,25% del NAV <sup>1</sup>
iShares Edge MSCI USA Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,20% del NAV <sup>1</sup>
iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,30% del NAV <sup>1</sup>
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni Flexible Euro Hedged Accumulating	NA <sup>4</sup>
iShares Emerging Markets Index Fund (IE) - Classe di Azioni Euro Flexible Accumulating	Spesa annua massima pari allo 0,30% del NAV <sup>3</sup>



# 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
iShares ESG Screened Euro Corporate Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni Flexible Euro Accumulating	NA <sup>4</sup>
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 <sup>4</sup>
iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	Spesa annua massima pari all'1,00% del NAV <sup>1</sup>
iShares Global Corp Bond EUR Hedged UCITS ETF (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,25% del NAV <sup>1</sup>
iShares Global Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	Spesa annua massima pari all'1,00% del NAV <sup>1</sup>
iShares Green Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni Flexible EUR Hedged Accumulating	NA <sup>5</sup>
iShares Italy Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,20% del NAV <sup>1</sup>
iShares J.P. Morgan \$ EM Corp Bond UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,50% del NAV <sup>1</sup>
iShares MSCI Canada UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,48% del NAV <sup>1</sup>
iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,23% del NAV <sup>1</sup>
iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,15% del NAV <sup>1</sup>
iShares MSCI Europe ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,12% del NAV <sup>1</sup>
iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,20% del NAV <sup>1</sup>
iShares MSCI Japan ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,15% del NAV <sup>1</sup>
iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	Spesa annua massima pari allo 0,60% del NAV <sup>1</sup>
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,10% del NAV <sup>1</sup>
iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,07% del NAV <sup>1</sup>
iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,25% del NAV <sup>1</sup>
iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	Spesa annua massima pari allo 0,30% del NAV <sup>1</sup>
iShares Pacific Index Fund (IE) - Classe di Azioni US Dollar Flexible Accumulating	Spesa annua massima pari allo 0,30% del NAV <sup>3</sup>
iShares Physical Gold ETC	Spesa annua massima pari allo 0,12% del NAV <sup>1</sup>
iShares UK Index Fund (IE) - Classe di Azioni Euro (Hedged) Flexible Accumulating	Spesa annua massima pari allo 0,50% del NAV <sup>3</sup>
iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	Spesa annua massima pari all'1,00% del NAV <sup>1</sup>
<b>Società d'investimento - OICVM autorizzata in Lussemburgo dalla Commission de Surveillance du Secteur Financier</b>	
BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD Hedged	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Classe X2 EUR	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 EUR	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - ESG Multi-Asset Fund - Classe I2 EUR	0,65% del NAV <sup>7</sup>
BlackRock Global Funds - Euro Short Duration Bond Fund - Classe X2 EUR	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - European Fund - Classe X2 EUR	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - European Special Situations Fund - Classe X2 EUR	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Global Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Global Inflation Linked Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Global Multi-Asset Income Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Japan Small & MidCap Opportunities Fund Classe X2 JPY	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe di Azioni X2 EUR Hedged	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Opportunities Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - Systematic Global SmallCap Fund - Classe D2 EUR	0,75% del NAV <sup>7</sup>
BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Classe X2 EUR	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - US Basic Value Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - US Dollar Bond Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Classe X2 EUR	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Classe X2 EUR	NA <sup>6</sup>
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Real Asset Securities Fund - Classe X2 USD	NA <sup>6</sup>
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 EUR	NA <sup>6</sup>

# 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 Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR	NA <sup>6</sup>
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR	NA <sup>6</sup>

<sup>1</sup> 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).

<sup>2</sup> 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.

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

<sup>4</sup> 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.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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.

<sup>7</sup> Il Fondo è soggetto a una commissione di gestione per questo investimento. Inoltre, 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 lo 0,30% annuo per BlackRock Global 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 2022 Migliaia	Riduzione della commissione di gestione per il periodo chiuso il 30 settembre 2021 Migliaia
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	EUR	48	-
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	EUR	90	71
BlackRock Fixed Income Selection Fund	EUR	16	15
BlackRock Global Equity Selection Fund	EUR	8	7
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	EUR	7	6
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	EUR	20	14
FR Multi-Asset Fund	EUR	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").

#### Al 30 settembre 2022

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	72,27	1
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	Zero	100,00 <sup>1</sup>	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	82,76	1
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	-2	Zero	Zero
BlackRock Fixed Income Selection Fund	-2	Zero	Zero
BlackRock Global Equity Selection Fund	0,01	52,01	1

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

### 9. Operazioni con parti correlate (continua)

#### Investitori Importanti (continua)

Nome del Fondo	% totale di quote detenute da Investitori Correlati a BlackRock	% totale di quote detenute da Investitori Importanti che non sono Correlati a BlackRock	Numero di Investitori Importanti che non sono Investitori Correlati a BlackRock
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Zero	58,39	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	0,02	99,98	1

<sup>1</sup>La percentuale è stata arrotondata per eccesso al 100.00%.

<sup>2</sup>Gli investimenti inferiori allo 0,005% sono stati arrotondati a zero.

#### Al 31 marzo 2022

Nome del Fondo	% totale di quote detenute da Investitori Correlati a BlackRock	% totale di quote detenute da Investitori Importanti che non sono 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	68,83	1
BlackRock Diversified Strategies Selection Fund	Zero	88,22	1
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	Zero	100,00 <sup>1</sup>	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	73,84	1
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	- <sup>2</sup>	Zero	Zero
BlackRock Euro Cash Fund	0,02	99,87	1
BlackRock Fixed Income Selection Fund	- <sup>2</sup>	Zero	Zero
BlackRock Global Equity Selection Fund	0,01	52,18	1
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Zero	58,45	1
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	- <sup>2</sup>	Zero	Zero
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	- <sup>2</sup>	100,00 <sup>1</sup>	1

<sup>1</sup>La percentuale è stata arrotondata per eccesso al 100.00%.

<sup>2</sup>Gli investimenti inferiori allo 0,005% sono stati arrotondati a zero.

#### Prestito di titoli

Il reddito totale guadagnato dalle operazioni di prestito titoli è suddiviso tra il Fondo in questione e l'Agente per il prestito titoli. Il Fondo che effettua operazioni di prestito titoli 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 riporta il reddito da prestito titoli maturato nel periodo finanziario chiuso:

Nome del Fondo	Valuta	30 settembre 2022 Migliaia	30 settembre 2021 Migliaia
BlackRock UK Credit Screened Fund	GBP	11	19
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	EUR	18	5
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	EUR	3	2
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	EUR	79	-
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	12	14
BlackRock Global Equity Selection Fund	EUR	1	-
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	USD	6	9

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 2022: nessuna).

Nessun importo è stato svalutato durante il periodo finanziario relativamente agli importi dovuti alle o dalle parti correlate (31 marzo 2022: nessuna).

# BLACKROCK UCITS FUNDS

## NOTA INTEGRATIVA AL BILANCIO (continua)

### 9. Operazioni con parti correlate (continua)

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 2022: nessuna).

### 10. Linea di credito

I Fondi hanno ottenuto una linea di credito presso JPMorgan in virtù della quale JPMorgan, insieme ad altri finanziatori sindacati, ha messo a disposizione dei Fondi, ad eccezione di FR Multi-Asset Fund, una quota della linea di credito di USD 300.000.000. La quota della linea di credito di USD 300.000.000 sarà assegnata ai Fondi in base al contratto di credito datato 23 aprile 2021. Il 22 aprile 2022 è stato emesso un contratto di credito modificato per agevolare un aumento a USD 450.000.000 della linea di credito messa a disposizione da JPMorgan e dagli altri finanziatori sindacati. 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 esercizio, tali Fondi non rientreranno in alcuna linea di credito, né potranno attingervi. 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.

### 11. Impegni e sopravvenienze passive

Non sussiste alcun impegno o sopravvenienza passiva al 30 settembre 2022 e al 31 marzo 2022.

### 12. Eventi successivi

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 2022.

### 13. Data di approvazione

Il bilancio è stato approvato dagli Amministratori in data 18 novembre 2022.

# BLACKROCK CANGRANDE GLOBAL INDEX EQUITY FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO</b>				
<b>Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2022: 31,62%)</b>				
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 31,62%)</b>				
1.308.365	USD	iShares Developed World ESG Screened Index Fund (IE) - Classe di Azioni US Dollar Flexible Accumulating <sup>1</sup>	22.386	18,98
790.708	EUR	iShares Emerging Markets Index Fund (IE) - Classe di Azioni Euro Flexible Accumulating <sup>1</sup>	13.120	11,13
37.233	USD	iShares Pacific Index Fund (IE) - Classe di Azioni US Dollar Flexible Accumulating <sup>1</sup>	2.048	1,74
		<b>Irlanda - Totale</b>	<b>37.554</b>	<b>31,85</b>
<b>Totale investimenti in organismi di investimento collettivo</b>			<b>37.554</b>	<b>31,85</b>
<b>Totale investimenti in organismi di investimento collettivo</b>			<b>37.554</b>	<b>31,85</b>
<b>ETF (31 marzo 2022: 68,41%)</b>				
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 68,41%)</b>				
55.480	EUR	iShares Core S&P 500 UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	20.931	17,75
13.920	EUR	iShares MSCI Canada UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	2.127	1,80
1.723.339	EUR	iShares MSCI Europe ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc) <sup>1</sup>	10.212	8,66
795.814	EUR	iShares MSCI Japan ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	3.728	3,16
2.960.730	EUR	iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	20.975	17,79
3.582.551	EUR	iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	22.450	19,04
		<b>Irlanda - Totale</b>	<b>80.423</b>	<b>68,20</b>
<b>Totale investimenti in ETF</b>			<b>80.423</b>	<b>68,20</b>
<b>Totale investimenti in ETF</b>			<b>80.423</b>	<b>68,20</b>
<b>Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico</b>			<b>117.977</b>	<b>100,05</b>
Liquidità			52	0,04
Altre attività e passività			(115)	(0,09)
<b>Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>			<b>117.914</b>	<b>100,00</b>
<b>Analisi del totale attività</b>				
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale				68,13
Organismi di investimento collettivo				31,82
Altre attività				0,05
<b>Totale attività</b>				<b>100,00</b>

<sup>1</sup>Una parte correlata al Fondo.

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI</b>				
<b>Titoli del debito societario (31 marzo 2022: 99,16%)</b>				
<b>Australia (31 marzo 2022: 1,72%)</b>				
200.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 2.00%, 22/03/2027	180	0,04
100.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 0.75%, 15/03/2029	78	0,02
100.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 2.00%, 15/07/2030	81	0,02
150.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 1.25%, 15/03/2033	104	0,02
100.000	EUR	Aurizon Network Pty. Ltd., 2.00%, 18/09/2024	96	0,02
100.000	EUR	Aurizon Network Pty. Ltd., 3.13%, 01/06/2026	96	0,02
100.000	EUR	Ausgrid Finance Pty. Ltd., 1.25%, 30/07/2025	93	0,02
100.000	EUR	Ausgrid Finance Pty. Ltd., 0.88%, 07/10/2031	72	0,01
100.000	EUR	AusNet Services Holdings Pty. Ltd., FRN, 3.00%, 13/02/2024	99	0,02
200.000	EUR	AusNet Services Holdings Pty. Ltd., FRN, 1.50%, 26/02/2027	181	0,04
100.000	EUR	AusNet Services Holdings Pty. Ltd., FRN, 0.63%, 25/08/2030	75	0,01
100.000	EUR	AusNet Services Holdings Pty. Ltd., FRN, 1.62%, 11/03/2081	78	0,02
250.000	EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 0.75%, 29/09/2026	226	0,05
250.000	EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 1.12%, 21/11/2029	230	0,05
150.000	EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 0.67%, 05/05/2031	126	0,03
100.000	EUR	Australia Pacific Airports Melbourne Pty. Ltd., 3.13%, 26/09/2023	100	0,02
150.000	EUR	Australia Pacific Airports Melbourne Pty. Ltd., 1.75%, 15/10/2024	144	0,03
150.000	EUR	BHP Billiton Finance Ltd., 3.00%, 29/05/2024	151	0,03
100.000	EUR	BHP Billiton Finance Ltd., 3.25%, 24/09/2027	98	0,02
150.000	EUR	BHP Billiton Finance Ltd., 1.50%, 29/04/2030	124	0,03
200.000	EUR	BHP Billiton Finance Ltd., 3.13%, 29/04/2033	178	0,04
100.000	EUR	CIMIC Finance Ltd., 1.50%, 28/05/2029	66	0,01
100.000	EUR	Commonwealth Bank of Australia, 1.13%, 18/01/2028	89	0,02
240.000	EUR	Commonwealth Bank of Australia, FRN, 1.94%, 03/10/2029	226	0,05
100.000	EUR	Macquarie Group Ltd., 0.63%, 03/02/2027	85	0,02
100.000	EUR	Macquarie Group Ltd., 0.35%, 03/03/2028	80	0,02
150.000	EUR	Macquarie Group Ltd., 0.94%, 19/01/2029	120	0,02
125.000	EUR	Macquarie Group Ltd., 0.95%, 21/05/2031	91	0,02
100.000	EUR	Macquarie Group Ltd., FRN, 1.25%, 05/03/2025	97	0,02
100.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 0.63%, 10/11/2023	98	0,02
100.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 0.25%, 20/05/2024	96	0,02
100.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 0.63%, 18/09/2024	96	0,02
250.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 1.25%, 18/05/2026	233	0,05
275.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 2.13%, 24/05/2028	253	0,05
200.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 1.38%, 30/08/2028	175	0,04
100.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 1.13%, 20/05/2031	81	0,02
200.000	EUR	Origin Energy Finance Ltd., 1.00%, 17/09/2029	147	0,03
200.000	EUR	Scentre Group Trust 1, REIT, 2.25%, 16/07/2024	195	0,04
100.000	EUR	Scentre Group Trust 1, REIT, 1.75%, 11/04/2028	85	0,02
150.000	EUR	Scentre Group Trust 1, REIT, 1.45%, 28/03/2029	120	0,02
100.000	EUR	Stockland Trust, REIT, 1.63%, 27/04/2026	91	0,02
100.000	EUR	Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd., 1.75%, 26/04/2028	89	0,02
300.000	EUR	Telstra Corp. Ltd., 2.50%, 15/09/2023	299	0,06
100.000	EUR	Telstra Corp. Ltd., 1.13%, 14/04/2026	93	0,02
250.000	EUR	Telstra Corp. Ltd., 1.00%, 23/04/2030	208	0,04
200.000	EUR	Toyota Finance Australia Ltd., 0.25%, 09/04/2024	192	0,04
100.000	EUR	Toyota Finance Australia Ltd., 0.06%, 13/01/2025	93	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	84	0,02
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 1.88%, 16/09/2024	97	0,02
200.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 2.00%, 28/08/2025	191	0,04
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 1.75%, 29/03/2028	88	0,02
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 1.45%, 16/05/2029	82	0,02
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 3.00%, 08/04/2030	89	0,02
100.000	EUR	Vicinity Centres Trust, REIT, 1.13%, 07/11/2029	74	0,02
100.000	EUR	Wesfarmers Ltd., 0.95%, 21/10/2033	70	0,01
100.000	EUR	Westpac Banking Corp., 0.75%, 17/10/2023	98	0,02
150.000	EUR	Westpac Banking Corp., 0.63%, 22/11/2024	142	0,03
150.000	EUR	Westpac Banking Corp., 1.13%, 05/09/2027	134	0,03
200.000	EUR	Westpac Banking Corp., 1.45%, 17/07/2028	176	0,04



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Australia (continua)</b>				
250.000	EUR	Westpac Banking Corp., FRN, 0.77%, 13/05/2031	212	0,04
200.000	EUR	Woolworths Group Ltd., FRN, 0.38%, 15/11/2028	157	0,03
		<b>Australia - Totale</b>	<b>7.990</b>	<b>1,69</b>
<b>Austria (31 marzo 2022: 1,13%)</b>				
100.000	EUR	BAWAG Group AG, FRN, 2.38%, 26/03/2029	94	0,02
100.000	EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 0.38%, 03/09/2027	83	0,02
100.000	EUR	CA Immobilien Anlagen AG, REIT, 1.00%, 27/10/2025	87	0,02
100.000	EUR	CA Immobilien Anlagen AG, REIT, 0.88%, 05/02/2027	76	0,02
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.38%, 16/04/2024	96	0,02
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, 1.50%, 07/04/2026	93	0,02
200.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.88%, 22/05/2026	178	0,04
300.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.88%, 13/05/2027	261	0,06
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.13%, 17/05/2028	80	0,02
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.25%, 14/09/2029	76	0,02
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.25%, 27/01/2031	72	0,01
200.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 0.10%, 16/11/2028	162	0,03
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 1.00%, 10/06/2030	86	0,02
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 1.62%, 08/09/2031	85	0,02
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 0.88%, 15/11/2032	77	0,02
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 4.00%, 07/06/2033	90	0,02
100.000	EUR	Mondi Finance Europe GmbH, 2.38%, 01/04/2028	89	0,02
150.000	EUR	OMV AG, 0.00%, 16/06/2023	147	0,03
150.000	EUR	OMV AG, 0.75%, 04/12/2023	146	0,03
100.000	EUR	OMV AG, 1.50%, 09/04/2024	98	0,02
150.000	EUR	OMV AG, 0.00%, 03/07/2025	138	0,03
225.000	EUR	OMV AG, 1.00%, 14/12/2026	205	0,04
100.000	EUR	OMV AG, 3.50%, 27/09/2027	101	0,02
175.000	EUR	OMV AG, 2.00%, 09/04/2028	163	0,03
100.000	EUR	OMV AG, 1.88%, 04/12/2028	91	0,02
175.000	EUR	OMV AG, 0.75%, 16/06/2030	142	0,03
100.000	EUR	OMV AG, 2.38%, 09/04/2032	88	0,02
100.000	EUR	OMV AG, 1.00%, 03/07/2034	70	0,01
100.000	EUR	OMV AG, FRN, 2.87%, 19/03/2024 <sup>1</sup>	95	0,02
150.000	EUR	OMV AG, FRN, 6.25%, 12/09/2025 <sup>1</sup>	153	0,03
200.000	EUR	OMV AG, FRN, 2.50%, 06/01/2026 <sup>1</sup>	171	0,04
100.000	EUR	OMV AG, FRN, 2.87%, 06/01/2029 <sup>1</sup>	79	0,02
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, 6.00%, 16/10/2023	102	0,02
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, 0.25%, 22/01/2025	91	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	168	0,04
200.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, 0.05%, 01/09/2027	157	0,03
200.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 1.50%, 12/03/2030	162	0,03
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 7.38%, 20/12/2032	96	0,02
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 1.37%, 17/06/2033	69	0,01
200.000	EUR	Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG, 0.25%, 16/04/2024	190	0,04
100.000	EUR	Telekom Finanzmanagement GmbH, 1.50%, 07/12/2026	93	0,02
100.000	EUR	UNIQA Insurance Group AG, 1.38%, 09/07/2030	79	0,02
100.000	EUR	UNIQA Insurance Group AG, FRN, 2.38%, 09/12/2041	69	0,01
100.000	EUR	UNIQA Insurance Group AG, FRN, 6.00%, 27/07/2046	100	0,02
100.000	EUR	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe, 1.00%, 26/03/2036	64	0,01
100.000	EUR	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe, FRN, 4.87%, 15/06/2042	87	0,02
50.000	EUR	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe, FRN, 3.75%, 02/03/2046	46	0,01
100.000	EUR	Volksbank Wien AG, 0.88%, 23/03/2026	88	0,02
		<b>Austria - Totale</b>	<b>5.432</b>	<b>1,15</b>

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Belgio (31 marzo 2022: 1,96%)</b>				
100.000	EUR	Aedifica SA, REIT, 0.75%, 09/09/2031	65	0,01
100.000	EUR	Ageas SA, FRN, 3.25%, 02/07/2049	84	0,02
100.000	EUR	Ageas SA, FRN, 1.88%, 24/11/2051	71	0,01
200.000	EUR	Aliaxis Finance SA, 0.88%, 08/11/2028	144	0,03
100.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.88%, 25/09/2024	100	0,02
200.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.70%, 31/03/2026	196	0,04
400.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 1.15%, 22/01/2027	363	0,08
200.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 1.13%, 01/07/2027	179	0,04
300.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.13%, 02/12/2027	279	0,06
450.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.00%, 17/03/2028	414	0,09
400.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 1.50%, 18/04/2030	339	0,07
250.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 1.65%, 28/03/2031	209	0,04
350.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.88%, 02/04/2032	318	0,07
100.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 3.25%, 24/01/2033	92	0,02
200.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.00%, 23/01/2035	156	0,03
480.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.75%, 17/03/2036	401	0,08
400.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 3.70%, 02/04/2040	365	0,08
100.000	EUR	Argenta Spaarbank NV, 1.00%, 06/02/2024	97	0,02
100.000	EUR	Argenta Spaarbank NV, 1.00%, 13/10/2026	88	0,02
100.000	EUR	Argenta Spaarbank NV, 1.00%, 29/01/2027	85	0,02
200.000	EUR	Argenta Spaarbank NV, FRN, 1.37%, 08/02/2029	162	0,03
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 1.00%, 26/10/2024	96	0,02
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 0.38%, 02/09/2025	91	0,02
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 0.01%, 15/10/2025	91	0,02
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 0.38%, 13/02/2026	89	0,02
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 3.13%, 11/05/2026	93	0,02
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 0.00%, 28/08/2026	87	0,02
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 0.38%, 08/06/2027	85	0,02
100.000	EUR	Belfius Bank SA, 0.13%, 08/02/2028	83	0,02
200.000	EUR	Belfius Bank SA, FRN, 1.25%, 06/04/2034	149	0,03
100.000	EUR	Brussels Airport Co. SA, 1.00%, 03/05/2024	95	0,02
100.000	EUR	Cofinimmo SA, REIT, 1.00%, 24/01/2028	82	0,02
100.000	EUR	Cofinimmo SA, REIT, 0.88%, 02/12/2030	71	0,01
100.000	EUR	Elia Group SA, 1.50%, 05/09/2028	89	0,02
100.000	EUR	Elia Group SA, FRN, 2.75%, 09/05/20231	96	0,02
100.000	EUR	Elia Transmission Belgium SA, 1.38%, 27/05/2024	97	0,02
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	94	0,02
100.000	EUR	Elia Transmission Belgium SA, 0.88%, 28/04/2030	80	0,02
100.000	EUR	Ethias SA, 5.00%, 14/01/2026	96	0,02
200.000	EUR	Euroclear Bank SA, 0.13%, 07/07/2025	184	0,04
200.000	EUR	Groupe Bruxelles Lambert NV, 1.38%, 23/05/2024	194	0,04
100.000	EUR	Groupe Bruxelles Lambert NV, 3.13%, 06/09/2029	95	0,02
100.000	EUR	Groupe Bruxelles Lambert NV, 0.13%, 28/01/2031	72	0,01
100.000	EUR	KBC Group NV, 0.88%, 27/06/2023	99	0,02
100.000	EUR	KBC Group NV, 0.75%, 18/10/2023	98	0,02
300.000	EUR	KBC Group NV, 1.13%, 25/01/2024	291	0,06
100.000	EUR	KBC Group NV, 0.63%, 10/04/2025	93	0,02
100.000	EUR	KBC Group NV, 0.75%, 24/01/2030	77	0,02
200.000	EUR	KBC Group NV, 3.00%, 25/08/2030	180	0,04
100.000	EUR	KBC Group NV, 0.75%, 31/05/2031	73	0,02
100.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 2.87%, 29/06/2025	98	0,02
200.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.13%, 10/09/2026	178	0,04
300.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.25%, 01/03/2027	262	0,06
100.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.38%, 16/06/2027	88	0,02
200.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.75%, 21/01/2028	171	0,04
200.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.13%, 14/01/2029	159	0,03
100.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 1.62%, 18/09/2029	92	0,02
100.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.50%, 03/12/2029	89	0,02



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Belgio (continua)</b>				
200.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.63%, 07/12/2031	160	0,03
150.000	EUR	Lonza Finance International NV, 1.63%, 21/04/2027	138	0,03
100.000	EUR	Solvay SA, 0.50%, 06/09/2029	74	0,02
100.000	EUR	Solvay SA, FRN, 2.75%, 02/12/2027	93	0,02
100.000	EUR	VGP NV, REIT, 1.63%, 17/01/2027	80	0,02
100.000	EUR	VGP NV, REIT, 1.50%, 08/04/2029	69	0,01
100.000	EUR	VGP NV, REIT, 2.25%, 17/01/2030	67	0,01
<b>Belgio - Totale</b>			<b>9.337</b>	<b>1,98</b>
<b>Isole Vergini britanniche (31 marzo 2022: 0,06%)</b>				
100.000	EUR	Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd., 1.00%, 12/12/2024	94	0,02
100.000	EUR	Global Switch Holdings Ltd., 1.50%, 31/01/2024	97	0,02
100.000	EUR	Global Switch Holdings Ltd., 2.25%, 31/05/2027	91	0,02
<b>Isole Vergini britanniche - Totale</b>			<b>282</b>	<b>0,06</b>
<b>Canada (31 marzo 2022: 0,57%)</b>				
200.000	EUR	Alimentation Couche-Tard, Inc., 1.88%, 06/05/2026	184	0,04
200.000	EUR	Bank of Montreal, 2.75%, 15/06/2027	188	0,04
100.000	EUR	Bank of Nova Scotia (The), 0.50%, 30/04/2024	96	0,02
200.000	EUR	Bank of Nova Scotia (The), 0.13%, 04/09/2026	172	0,03
100.000	EUR	Bank of Nova Scotia (The), 0.25%, 01/11/2028	79	0,02
150.000	EUR	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.38%, 03/05/2024	143	0,03
100.000	EUR	Fairfax Financial Holdings Ltd., 2.75%, 29/03/2028	88	0,02
200.000	EUR	Great-West Lifeco, Inc., 1.75%, 07/12/2026	184	0,04
100.000	EUR	Magna International, Inc., 1.90%, 24/11/2023	99	0,02
100.000	EUR	Magna International, Inc., 1.50%, 25/09/2027	88	0,02
100.000	EUR	Royal Bank of Canada, 0.25%, 02/05/2024	96	0,02
200.000	EUR	Royal Bank of Canada, 0.13%, 23/07/2024	189	0,04
340.000	EUR	Royal Bank of Canada, 2.13%, 26/04/2029	298	0,06
250.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 0.38%, 25/04/2024	239	0,05
178.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 0.50%, 18/01/2027	153	0,03
200.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 2.55%, 03/08/2027	186	0,04
350.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 1.95%, 08/04/2030	298	0,06
250.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 3.13%, 03/08/2032	226	0,05
400.000	EUR	TotalEnergies Capital Canada Ltd., 2.13%, 18/09/2029	365	0,08
<b>Canada - Totale</b>			<b>3.371</b>	<b>0,71</b>
<b>Isole Cayman (31 marzo 2022: 0,17%)</b>				
125.000	EUR	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd., 1.25%, 13/04/2025	118	0,03
100.000	EUR	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd., 2.00%, 13/04/2030	84	0,02
100.000	EUR	CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd., 0.75%, 02/11/2029	77	0,02
100.000	EUR	CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd., 1.00%, 02/11/2033	67	0,01
100.000	EUR	CK Hutchison Finance 16 II Ltd., 0.88%, 03/10/2024	95	0,02
122.000	EUR	CK Hutchison Finance 16 Ltd., 2.00%, 06/04/2028	109	0,02
<b>Isole Cayman - Totale</b>			<b>550</b>	<b>0,12</b>
<b>Repubblica ceca (31 marzo 2022: 0,11%)</b>				
100.000	EUR	Ceska sporitelna A/S, FRN, 0.50%, 13/09/2028	78	0,02
100.000	EUR	EP Infrastructure A/S, 1.66%, 26/04/2024	84	0,02
150.000	EUR	EP Infrastructure A/S, 1.70%, 30/07/2026	109	0,02
125.000	EUR	EP Infrastructure A/S, 2.05%, 09/10/2028	83	0,02
200.000	EUR	EP Infrastructure A/S, 1.82%, 02/03/2031	115	0,02
100.000	EUR	Raiffeisenbank A/S, FRN, 1.00%, 09/06/2028	78	0,01
<b>Repubblica Ceca - Totale</b>			<b>547</b>	<b>0,11</b>
<b>Danimarca (31 marzo 2022: 1,06%)</b>				
250.000	EUR	AP Moller - Maersk A/S, 1.75%, 16/03/2026	237	0,05
100.000	EUR	AP Moller - Maersk A/S, 0.75%, 25/11/2031	75	0,01
300.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 0.50%, 06/09/2023	293	0,06

NM1222U-2615757-57/212

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Danimarca (continua)</b>				
100.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 2.50%, 28/05/2024	99	0,02
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	124	0,03
100.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 0.63%, 09/03/2030	79	0,02
100.000	EUR	Danica Pension Livsforsikrings AB, FRN, 4.38%, 29/09/2045	95	0,02
100.000	EUR	Danske Bank A/S, 1.63%, 15/03/2024	97	0,02
200.000	EUR	Danske Bank A/S, 0.63%, 26/05/2025	186	0,04
300.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 0.01%, 10/11/2024	289	0,06
200.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 0.50%, 27/08/2025	187	0,04
200.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 1.37%, 17/02/2027	179	0,04
100.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 0.75%, 09/06/2029	79	0,02
100.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 2.50%, 21/06/2029	95	0,02
250.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 1.37%, 12/02/2030	224	0,05
100.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 1.50%, 02/09/2030	87	0,02
125.000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 1.00%, 15/05/2031	105	0,02
200.000	EUR	DSV A/S, 0.38%, 26/02/2027	175	0,04
150.000	EUR	H Lundbeck A/S, 0.88%, 14/10/2027	127	0,03
100.000	EUR	ISS Global A/S, 0.88%, 18/06/2026	88	0,02
125.000	EUR	ISS Global A/S, 1.50%, 31/08/2027	108	0,02
200.000	EUR	ISS Global A/S, FRN, 2.13%, 02/12/2024	196	0,04
150.000	EUR	Jyske Bank A/S, FRN, 0.38%, 15/10/2025	139	0,03
200.000	EUR	Jyske Bank A/S, FRN, 0.25%, 17/02/2028	169	0,03
100.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 0.13%, 10/07/2024	94	0,02
150.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 0.50%, 10/07/2025	138	0,03
175.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 0.25%, 13/01/2026	154	0,03
300.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 0.75%, 20/01/2027	258	0,05
100.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 1.38%, 12/07/2027	89	0,02
100.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 0.38%, 17/01/2028	80	0,02
100.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, FRN, 0.88%, 28/07/2031	84	0,02
200.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, FRN, 5.50%, 29/12/2032	195	0,04
100.000	EUR	Sydbank A/S, 1.38%, 18/09/2023	98	0,02
100.000	EUR	Sydbank A/S, FRN, 4.75%, 30/09/2025	100	0,02
100.000	EUR	Sydbank A/S, FRN, 0.50%, 10/11/2026	88	0,02
100.000	EUR	TDC Net A/S, 5.06%, 31/05/2028	93	0,02
<b>Danimarca - Totale</b>			<b>5.090</b>	<b>1,08</b>
<b>Estonia (31 marzo 2022: 0,00%)</b>				
150.000	EUR	Luminor Bank A/S, FRN, 0.54%, 23/09/2026	130	0,03
<b>Estonia - Totale</b>			<b>130</b>	<b>0,03</b>
<b>Finlandia (31 marzo 2022: 1,40%)</b>				
250.000	EUR	Balder Finland OYJ, REIT, 1.00%, 18/01/2027	195	0,04
175.000	EUR	Balder Finland OYJ, REIT, 1.00%, 20/01/2029	121	0,02
100.000	EUR	Balder Finland OYJ, REIT, 1.38%, 24/05/2030	66	0,01
125.000	EUR	Balder Finland OYJ, REIT, 2.00%, 18/01/2031	85	0,02
100.000	EUR	Castellum Helsinki Finance Holding Abp, REIT, 2.00%, 24/03/2025	89	0,02
100.000	EUR	Castellum Helsinki Finance Holding Abp, REIT, 0.88%, 17/09/2029	64	0,01
100.000	EUR	CRH Finland Services OYJ, 0.88%, 05/11/2023	97	0,02
100.000	EUR	Elenia Verkko OYJ, 0.38%, 06/02/2027	85	0,02
100.000	EUR	Elisa OYJ, 1.13%, 26/02/2026	93	0,02
100.000	EUR	Elisa OYJ, 0.25%, 15/09/2027	85	0,02
200.000	EUR	Hemso Treasury OYJ, REIT, 0.00%, 19/01/2028	152	0,03
200.000	EUR	Kojamo OYJ, REIT, 1.50%, 19/06/2024	187	0,04
100.000	EUR	Kojamo OYJ, REIT, 1.63%, 07/03/2025	91	0,02
100.000	EUR	Kojamo OYJ, REIT, 2.00%, 31/03/2026	88	0,02
100.000	EUR	Kojamo OYJ, REIT, 1.88%, 27/05/2027	84	0,02
100.000	EUR	Metso Outotec OYJ, 0.88%, 26/05/2028	78	0,02
100.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.38%, 28/05/2026	90	0,02
100.000	EUR	Nordea Bank Abp, 1.13%, 16/02/2027	89	0,02

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Finlandia (continua)</b>				
475.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.50%, 14/05/2027	415	0,09
200.000	EUR	Nordea Bank Abp, 1.13%, 27/09/2027	179	0,04
175.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.50%, 02/11/2028	141	0,03
350.000	EUR	Nordea Bank Abp, 2.50%, 23/05/2029	317	0,07
100.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.50%, 19/03/2031	75	0,02
200.000	EUR	Nordea Bank Abp, 2.88%, 24/08/2032	180	0,04
200.000	EUR	Nordea Bank Abp, FRN, 0.63%, 18/08/2031	169	0,04
200.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.13%, 01/07/2024	190	0,04
200.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 1.00%, 22/05/2025	188	0,04
400.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.50%, 12/08/2025	370	0,08
125.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.25%, 24/03/2026	110	0,02
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.60%, 18/01/2027	86	0,02
200.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.63%, 27/07/2027	168	0,03
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.10%, 16/11/2027	83	0,02
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.38%, 16/06/2028	80	0,02
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.63%, 12/11/2029	76	0,02
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.75%, 24/03/2031	72	0,01
225.000	EUR	OP Corporate Bank plc, FRN, 1.62%, 09/06/2030	203	0,04
100.000	EUR	Sampo OYJ, 2.25%, 27/09/2030	90	0,02
150.000	EUR	Sampo OYJ, FRN, 3.38%, 23/05/2049	128	0,03
200.000	EUR	Sampo OYJ, FRN, 2.50%, 03/09/2052	147	0,03
100.000	EUR	SATO OYJ, REIT, 1.38%, 24/02/2028	77	0,02
100.000	EUR	SBB Treasury OYJ, REIT, 0.75%, 14/12/2028	62	0,01
250.000	EUR	SBB Treasury OYJ, REIT, 1.13%, 26/11/2029	155	0,03
100.000	EUR	Stora Enso OYJ, 0.63%, 02/12/2030	74	0,01
200.000	EUR	UPM-Kymmene OYJ, 0.13%, 19/11/2028	159	0,03
100.000	EUR	UPM-Kymmene OYJ, 2.25%, 23/05/2029	89	0,02
150.000	EUR	UPM-Kymmene OYJ, 0.50%, 22/03/2031	107	0,02
		<b>Finlandia - Totale</b>	<b>6.029</b>	<b>1,28</b>
<b>Francia (31 marzo 2022: 19,87%)</b>				
200.000	EUR	ABEILLE VIE SA d'Assurances Vie et de Capitalisation SA, 6.25%, 09/09/2033	187	0,04
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 1.88%, 05/06/2024	98	0,02
200.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 0.75%, 13/06/2024	194	0,04
200.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 1.00%, 02/04/2025	191	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	269	0,06
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	81	0,02
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 0.38%, 27/05/2031	78	0,02
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 2.88%, 16/09/2032	95	0,02
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 0.38%, 20/09/2033	72	0,01
400.000	EUR	ALD SA, 0.38%, 19/10/2023	389	0,08
100.000	EUR	ALD SA, 1.25%, 02/03/2026	90	0,02
100.000	EUR	ALD SA, 4.00%, 05/07/2027	97	0,02
200.000	EUR	Alstom SA, 0.25%, 14/10/2026	176	0,04
100.000	EUR	Alstom SA, 0.13%, 27/07/2027	84	0,02
200.000	EUR	Alstom SA, 0.00%, 11/01/2029	154	0,03
100.000	EUR	Alstom SA, 0.50%, 27/07/2030	75	0,01
100.000	EUR	Altarea SCA, REIT, 1.75%, 16/01/2030	63	0,01
200.000	EUR	APRR SA, 1.25%, 14/01/2027	183	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	82	0,02
200.000	EUR	APRR SA, 1.88%, 03/01/2029	182	0,04
100.000	EUR	APRR SA, 0.13%, 18/01/2029	81	0,02
100.000	EUR	APRR SA, 1.50%, 25/01/2030	87	0,02
100.000	EUR	APRR SA, 1.88%, 06/01/2031	88	0,02
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

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Francia (continua)</b>				
100.000	EUR	APRR SA, FRN, 1.50%, 15/01/2024	98	0,02
200.000	EUR	APRR SA, FRN, 1.13%, 09/01/2026	188	0,04
100.000	EUR	ARGAN SA, REIT, 1.01%, 17/11/2026	84	0,02
200.000	EUR	Arkema SA, 1.50%, 20/01/2025	192	0,04
300.000	EUR	Arkema SA, 0.75%, 03/12/2029	235	0,05
200.000	EUR	Arkema SA, FRN, 2.75%, 17/06/2024 <sup>1</sup>	185	0,04
300.000	EUR	Arval Service Lease SA, 0.00%, 01/10/2025	264	0,05
100.000	EUR	Arval Service Lease SA, 4.00%, 22/09/2026	98	0,02
100.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 2.95%, 17/01/2024	100	0,02
100.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.13%, 20/04/2026	93	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	90	0,02
200.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.38%, 22/01/2030	176	0,04
200.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 2.75%, 02/09/2032	188	0,04
100.000	EUR	AXA SA, 1.13%, 15/05/2028	89	0,02
375.000	EUR	AXA SA, 3.25%, 28/05/2049	326	0,07
150.000	EUR	AXA SA, FRN, 3.94%, 11/07/2024 <sup>1</sup>	143	0,03
450.000	EUR	AXA SA, FRN, 3.88%, 10/08/2025 <sup>1</sup>	419	0,09
150.000	EUR	AXA SA, FRN, 1.37%, 07/10/2041	106	0,02
250.000	EUR	AXA SA, FRN, 1.88%, 10/07/2042	179	0,04
275.000	EUR	AXA SA, FRN, 4.25%, 10/03/2043	239	0,05
240.000	EUR	AXA SA, FRN, 3.38%, 06/07/2047	220	0,05
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.75%, 15/06/2023	296	0,06
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.00%, 28/11/2023	300	0,06
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.13%, 05/02/2024	288	0,06
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.63%, 18/03/2024	297	0,06
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.00%, 21/05/2024	198	0,04
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.25%, 14/01/2025	285	0,06
500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.01%, 07/03/2025	460	0,10
400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.00%, 23/05/2025	375	0,08
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.75%, 17/07/2025	93	0,02
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.00%, 11/09/2025	193	0,04
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.63%, 19/01/2026	187	0,04
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.38%, 24/03/2026	93	0,02
500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.01%, 11/05/2026	438	0,09
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.75%, 08/06/2026	269	0,06
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.13%, 12/09/2026	91	0,02
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.88%, 04/11/2026	90	0,02
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.63%, 31/03/2027	91	0,02
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.25%, 26/05/2027	178	0,04
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.13%, 14/09/2027	290	0,06
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.10%, 08/10/2027	167	0,03
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.63%, 15/11/2027	85	0,02
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.63%, 19/11/2027	83	0,02
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.50%, 25/05/2028	174	0,04
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.25%, 29/06/2028	82	0,02
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.38%, 16/07/2028	174	0,04
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.25%, 19/07/2028	236	0,05
400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.63%, 03/11/2028	318	0,07
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.75%, 15/03/2029	169	0,03
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.88%, 18/06/2029	80	0,02
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.63%, 06/11/2029	177	0,04
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.75%, 17/01/2030	230	0,05
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.25%, 03/06/2030	79	0,02
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.63%, 21/02/2031	146	0,03
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.13%, 19/11/2031	138	0,03
400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.13%, 19/01/2032	299	0,06
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, FRN, 3.88%, 16/06/2032	273	0,06
200.000	EUR	BNP Paribas Cardif SA, 1.00%, 29/11/2024	187	0,04

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Francia (continua)</b>				
200.000	EUR	BNP Paribas Cardif SA, FRN, 4.03%, 25/11/2025 <sup>1</sup>	186	0,04
400.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.00%, 17/04/2024	387	0,08
100.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.38%, 20/05/2024	99	0,02
100.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.00%, 27/06/2024	96	0,02
100.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.13%, 28/08/2024	96	0,02
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.38%, 17/02/2025	192	0,04
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.25%, 19/03/2025	189	0,04
300.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.50%, 17/11/2025	280	0,06
150.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.75%, 27/01/2026	141	0,03
250.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.63%, 23/02/2026	238	0,05
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.13%, 11/06/2026	180	0,04
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 0.13%, 04/09/2026	171	0,04
100.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.88%, 01/10/2026	93	0,02
300.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.25%, 11/01/2027	269	0,06
140.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.50%, 23/05/2028	119	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	244	0,05
400.000	EUR	BNP Paribas SA, 3.63%, 01/09/2029	374	0,08
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.63%, 02/07/2031	145	0,03
300.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.10%, 07/04/2032	239	0,05
300.000	EUR	BNP Paribas SA, 0.63%, 03/12/2032	202	0,04
300.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 15/07/2025	283	0,06
300.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 04/06/2026	274	0,06
600.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.13%, 23/01/2027	559	0,12
300.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.25%, 13/04/2027	260	0,05
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.38%, 14/10/2027	171	0,04
100.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 19/02/2028	84	0,02
300.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 30/05/2028	250	0,05
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.75%, 25/07/2028	184	0,04
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 01/09/2028	164	0,03
300.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 1.12%, 17/04/2029	248	0,05
300.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 19/01/2030	231	0,05
400.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.88%, 11/07/2030	310	0,07
300.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.38%, 20/11/2030	273	0,06
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 1.12%, 15/01/2032	163	0,03
300.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.50%, 31/03/2032	258	0,05
100.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.88%, 31/08/2033	74	0,02
100.000	EUR	Bouygues SA, 1.38%, 07/06/2027	92	0,02
200.000	EUR	Bouygues SA, 1.13%, 24/07/2028	175	0,04
200.000	EUR	Bouygues SA, 2.25%, 29/06/2029	181	0,04
200.000	EUR	Bouygues SA, 0.50%, 11/02/2030	157	0,03
200.000	EUR	Bouygues SA, 3.25%, 30/06/2037	172	0,04
200.000	EUR	BPCE SA, 0.38%, 05/10/2023	195	0,04
100.000	EUR	BPCE SA, 2.88%, 16/01/2024	100	0,02
100.000	EUR	BPCE SA, 0.88%, 31/01/2024	97	0,02
300.000	EUR	BPCE SA, 1.00%, 15/07/2024	289	0,06
200.000	EUR	BPCE SA, 3.00%, 19/07/2024	200	0,04
300.000	EUR	BPCE SA, 0.63%, 26/09/2024	284	0,06
100.000	EUR	BPCE SA, 0.13%, 04/12/2024	94	0,02
200.000	EUR	BPCE SA, 1.00%, 01/04/2025	187	0,04
200.000	EUR	BPCE SA, 0.63%, 28/04/2025	187	0,04
200.000	EUR	BPCE SA, 0.25%, 15/01/2026	180	0,04
300.000	EUR	BPCE SA, 0.38%, 02/02/2026	270	0,06
200.000	EUR	BPCE SA, 1.38%, 23/03/2026	183	0,04
100.000	EUR	BPCE SA, 2.88%, 22/04/2026	94	0,02
200.000	EUR	BPCE SA, 0.01%, 14/01/2027	171	0,04
200.000	EUR	BPCE SA, 0.50%, 24/02/2027	172	0,04
300.000	EUR	BPCE SA, 1.75%, 26/04/2027	275	0,06
100.000	EUR	BPCE SA, 1.63%, 31/01/2028	87	0,02
200.000	EUR	BPCE SA, 1.00%, 05/10/2028	171	0,04



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Francia (continua)</b>				
100.000	EUR	BPCE SA, 0.63%, 15/01/2030	79	0,02
400.000	EUR	BPCE SA, 0.25%, 14/01/2031	292	0,06
200.000	EUR	BPCE SA, 0.75%, 03/03/2031	148	0,03
200.000	EUR	BPCE SA, 1.00%, 14/01/2032	147	0,03
200.000	EUR	BPCE SA, 2.38%, 26/04/2032	171	0,04
300.000	EUR	BPCE SA, FRN, 0.50%, 15/09/2027	258	0,05
100.000	EUR	BPCE SA, FRN, 0.50%, 14/01/2028	85	0,02
100.000	EUR	BPCE SA, FRN, 1.62%, 02/03/2029	86	0,02
100.000	EUR	BPCE SA, FRN, 2.25%, 02/03/2032	87	0,02
200.000	EUR	BPCE SA, FRN, 1.75%, 02/02/2034	157	0,03
100.000	EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 6.00%, 23/01/2027	102	0,02
200.000	EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 0.75%, 07/07/2028	154	0,03
100.000	EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 3.38%, 24/09/2028	89	0,02
100.000	EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 2.13%, 16/09/2029	81	0,02
200.000	EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, FRN, 6.37%, 28/05/2024 <sup>1</sup>	197	0,04
200.000	EUR	Capgemini SE, 0.63%, 23/06/2025	187	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	91	0,02
300.000	EUR	Capgemini SE, 2.00%, 15/04/2029	272	0,06
200.000	EUR	Capgemini SE, 1.13%, 23/06/2030	165	0,03
200.000	EUR	Capgemini SE, 2.38%, 15/04/2032	174	0,04
200.000	EUR	Capgemini SE, FRN, 2.50%, 01/07/2023	200	0,04
200.000	EUR	Carmila SA, REIT, 2.38%, 18/09/2023	197	0,04
100.000	EUR	Carmila SA, REIT, 2.38%, 16/09/2024	96	0,02
100.000	EUR	Carmila SA, REIT, 1.63%, 30/05/2027	79	0,02
100.000	EUR	Carmila SA, REIT, 1.63%, 01/04/2029	71	0,01
200.000	EUR	Carrefour SA, 0.75%, 26/04/2024	192	0,04
100.000	EUR	Carrefour SA, 1.75%, 04/05/2026	93	0,02
200.000	EUR	Carrefour SA, 1.88%, 30/10/2026	186	0,04
100.000	EUR	Carrefour SA, 1.00%, 17/05/2027	88	0,02
200.000	EUR	Carrefour SA, 2.63%, 15/12/2027	188	0,04
200.000	EUR	Carrefour SA, 2.38%, 30/10/2029	175	0,04
250.000	EUR	Carrefour SA, FRN, 1.25%, 03/06/2025	236	0,05
200.000	EUR	Cie de Saint-Gobain, 0.88%, 21/09/2023	196	0,04
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain, 0.63%, 15/03/2024	97	0,02
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain, 1.63%, 10/08/2025	96	0,02
200.000	EUR	Cie de Saint-Gobain, 1.13%, 23/03/2026	185	0,04
200.000	EUR	Cie de Saint-Gobain, 1.38%, 14/06/2027	181	0,04
200.000	EUR	Cie de Saint-Gobain, 2.38%, 04/10/2027	189	0,04
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain, 2.13%, 10/06/2028	92	0,02
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain, 1.88%, 21/09/2028	90	0,02
200.000	EUR	Cie de Saint-Gobain, 1.88%, 15/03/2031	169	0,03
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain, 2.63%, 10/08/2032	87	0,02
100.000	EUR	Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA, 0.38%, 07/02/2025	94	0,02
200.000	EUR	Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA, 1.13%, 13/10/2027	180	0,04
200.000	EUR	Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA, 0.75%, 09/09/2028	173	0,04
100.000	EUR	Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA, 1.00%, 19/05/2031	82	0,02
100.000	EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 1.75%, 28/05/2027	94	0,02
400.000	EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.00%, 02/11/2028	326	0,07
100.000	EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.25%, 02/11/2032	71	0,01
200.000	EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 2.50%, 03/09/2038	161	0,03
100.000	EUR	CNP Assurances, 0.38%, 08/03/2028	78	0,02
100.000	EUR	CNP Assurances, 1.25%, 27/01/2029	79	0,02
100.000	EUR	CNP Assurances, 2.75%, 05/02/2029	87	0,02
100.000	EUR	CNP Assurances, FRN, 4.00%, 18/11/2024 <sup>1</sup>	96	0,02

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Francia (continua)</b>				
200.000	EUR	CNP Assurances, FRN, 4.25%, 05/06/2045	195	0,04
100.000	EUR	CNP Assurances, FRN, 4.50%, 10/06/2047	97	0,02
100.000	EUR	CNP Assurances, FRN, 2.00%, 27/07/2050	78	0,02
200.000	EUR	CNP Assurances, FRN, 2.50%, 30/06/2051	158	0,03
100.000	EUR	CNP Assurances, FRN, 1.88%, 12/10/2053	69	0,01
100.000	EUR	Covivio, REIT, 1.63%, 17/10/2024	97	0,02
100.000	EUR	Covivio, REIT, 1.88%, 20/05/2026	94	0,02
200.000	EUR	Covivio, REIT, 1.50%, 21/06/2027	178	0,04
100.000	EUR	Covivio, REIT, 1.63%, 23/06/2030	80	0,02
200.000	EUR	Covivio, REIT, 1.13%, 17/09/2031	148	0,03
100.000	EUR	Covivio Hotels SACA, REIT, 1.88%, 24/09/2025	94	0,02
100.000	EUR	Covivio Hotels SACA, REIT, 1.00%, 27/07/2029	77	0,02
100.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, 2.00%, 17/07/2030	77	0,02
300.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, 1.50%, 06/10/2031	213	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, FRN, 4.25%, 13/01/2025 <sup>1</sup>	191	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, FRN, 4.50%, 14/10/2025 <sup>1</sup>	189	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, FRN, 2.63%, 29/01/2048	167	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, FRN, 4.75%, 27/09/2048	185	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.13%, 17/07/2023	201	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.38%, 20/05/2024	198	0,04
300.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.50%, 24/06/2024	286	0,06
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.00%, 16/09/2024	194	0,04
300.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.38%, 13/03/2025	286	0,06
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.00%, 18/09/2025	187	0,04
100.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.38%, 21/10/2025	91	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	278	0,06
300.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.88%, 20/12/2026	276	0,06
400.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.63%, 17/03/2027	363	0,08
400.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.38%, 03/05/2027	364	0,08
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.13%, 09/12/2027	162	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.38%, 20/04/2028	161	0,03
100.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.13%, 24/02/2029	85	0,02
400.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.75%, 05/03/2029	342	0,07
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.00%, 25/03/2029	163	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.00%, 03/07/2029	166	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.50%, 29/08/2029	183	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.88%, 14/01/2032	146	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.13%, 12/07/2032	148	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.50%, 22/04/2034	164	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 1.00%, 22/04/2026	186	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 1.88%, 22/04/2027	185	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 0.63%, 12/01/2028	171	0,04
300.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 0.50%, 21/09/2029	238	0,05
300.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 1.62%, 05/06/2030	271	0,06
100.000	EUR	Credit Logement SA, FRN, 1.35%, 28/11/2029	92	0,02
100.000	EUR	Credit Logement SA, FRN, 1.08%, 15/02/2034	75	0,02
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.88%, 05/10/2023	98	0,02
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.25%, 31/05/2024	193	0,04
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.01%, 28/01/2026	177	0,04
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.63%, 15/04/2026	184	0,04
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.88%, 07/05/2027	88	0,02
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.38%, 03/10/2028	81	0,02
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.50%, 09/02/2029	90	0,02
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.13%, 23/05/2029	82	0,02
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.75%, 18/01/2030	78	0,02
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.38%, 11/03/2031	85	0,02
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.88%, 25/10/2031	146	0,03
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.88%, 11/03/2033	139	0,03
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, FRN, 1.25%, 11/06/2029	168	0,04

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Francia (continua)</b>				
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, FRN, 1.88%, 25/10/2029	93	0,02
100.000	EUR	Danone SA, 2.60%, 28/06/2023	100	0,02
100.000	EUR	Danone SA, 1.25%, 30/05/2024	97	0,02
200.000	EUR	Danone SA, 0.71%, 03/11/2024	192	0,04
100.000	EUR	Danone SA, 1.13%, 14/01/2025	96	0,02
200.000	EUR	Danone SA, 1.00%, 26/03/2025	191	0,04
100.000	EUR	Danone SA, 0.00%, 01/12/2025	91	0,02
400.000	EUR	Danone SA, 0.57%, 17/03/2027	356	0,07
200.000	EUR	Danone SA, 1.21%, 03/11/2028	175	0,04
200.000	EUR	Danone SA, 0.40%, 10/06/2029	163	0,03
100.000	EUR	Danone SA, 0.52%, 09/11/2030	79	0,02
200.000	EUR	Danone SA, 3.07%, 07/09/2032	189	0,04
100.000	EUR	Danone SA, FRN, 1.00%, 16/09/2026 <sup>1</sup>	82	0,02
100.000	EUR	Edenred, 1.38%, 10/03/2025	95	0,02
100.000	EUR	Edenred, 1.88%, 06/03/2026	96	0,02
100.000	EUR	Edenred, 1.88%, 30/03/2027	94	0,02
100.000	EUR	Edenred, 1.38%, 18/06/2029	85	0,02
300.000	EUR	ELO SACA, 2.88%, 29/01/2026	279	0,06
100.000	EUR	ELO SACA, 3.25%, 23/07/2027	90	0,02
300.000	EUR	ELO SACA, FRN, 2.63%, 30/01/2024	293	0,06
100.000	EUR	ELO SACA, FRN, 2.38%, 25/04/2025	95	0,02
100.000	EUR	Engie SA, 0.88%, 27/03/2024	97	0,02
200.000	EUR	Engie SA, 1.38%, 27/03/2025	191	0,04
100.000	EUR	Engie SA, 0.88%, 19/09/2025	93	0,02
100.000	EUR	Engie SA, 1.00%, 13/03/2026	92	0,02
100.000	EUR	Engie SA, 2.38%, 19/05/2026	96	0,02
200.000	EUR	Engie SA, 0.00%, 04/03/2027	171	0,04
200.000	EUR	Engie SA, 0.38%, 11/06/2027	172	0,04
300.000	EUR	Engie SA, 0.38%, 21/06/2027	260	0,05
200.000	EUR	Engie SA, 1.50%, 27/03/2028	179	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	88	0,02
200.000	EUR	Engie SA, 1.38%, 28/02/2029	172	0,04
100.000	EUR	Engie SA, 3.50%, 27/09/2029	98	0,02
200.000	EUR	Engie SA, 0.38%, 26/10/2029	157	0,03
200.000	EUR	Engie SA, 2.13%, 30/03/2032	168	0,03
100.000	EUR	Engie SA, 1.88%, 19/09/2033	77	0,02
100.000	EUR	Engie SA, 1.50%, 13/03/2035	71	0,01
200.000	EUR	Engie SA, 1.00%, 26/10/2036	125	0,03
200.000	EUR	Engie SA, 2.00%, 28/09/2037	141	0,03
100.000	EUR	Engie SA, 1.38%, 21/06/2039	62	0,01
200.000	EUR	Engie SA, 1.25%, 24/10/2041	114	0,02
45.000	EUR	Engie SA, 5.95%, 16/03/2111	46	0,01
300.000	EUR	Engie SA, FRN, 1.62%, 04/08/2025 <sup>1</sup>	263	0,06
200.000	EUR	Engie SA, FRN, 1.50%, 30/05/2028 <sup>1</sup>	153	0,03
200.000	EUR	Engie SA, FRN, 1.88%, 01/02/2031 <sup>1</sup>	137	0,03
100.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 2.63%, 10/02/2024	100	0,02
100.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 2.38%, 09/04/2024	100	0,02
300.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.13%, 27/05/2025	279	0,06
400.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.38%, 05/01/2026	368	0,08
300.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.38%, 27/11/2027	261	0,05
200.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.50%, 05/06/2028	172	0,04
200.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.75%, 27/11/2031	157	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	87	0,02
100.000	EUR	Eutelsat SA, 1.50%, 13/10/2028	80	0,02
200.000	EUR	Firmenich Productions Participations SAS, 1.38%, 30/10/2026	181	0,04
100.000	EUR	Firmenich Productions Participations SAS, 1.75%, 30/04/2030	83	0,02
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.50%, 20/01/2025	96	0,02
200.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.38%, 30/06/2027	181	0,04



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Francia (continua)</b>				
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.38%, 26/01/2028	89	0,02
200.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.00%, 30/01/2029	168	0,03
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.63%, 14/03/2030	85	0,02
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 2.00%, 30/06/2032	83	0,02
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 0.88%, 25/01/2033	73	0,01
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.63%, 29/05/2034	76	0,01
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	142	0,03
100.000	EUR	Groupe VYV, 1.63%, 02/07/2029	84	0,02
100.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 2.25%, 24/03/2025	96	0,02
200.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 2.50%, 04/05/2027	185	0,04
100.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1.63%, 27/11/2027	87	0,02
100.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 0.63%, 14/09/2028	80	0,02
100.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1.63%, 18/09/2029	82	0,02
300.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1.48%, 18/01/2031	227	0,05
200.000	EUR	Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement, 0.13%, 16/09/2025	176	0,04
100.000	EUR	Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement, 0.63%, 16/09/2028	78	0,02
100.000	EUR	HSBC Continental Europe SA, 0.25%, 17/05/2024	96	0,02
300.000	EUR	HSBC Continental Europe SA, 0.10%, 03/09/2027	253	0,05
100.000	EUR	HSBC Continental Europe SA, 1.38%, 04/09/2028	88	0,02
200.000	EUR	Icade, REIT, 1.13%, 17/11/2025	184	0,04
100.000	EUR	Icade, REIT, 1.75%, 10/06/2026	92	0,02
100.000	EUR	Icade, REIT, 1.50%, 13/09/2027	88	0,02
100.000	EUR	Icade, REIT, 1.63%, 28/02/2028	87	0,02
100.000	EUR	Icade, REIT, 1.00%, 19/01/2030	76	0,02
100.000	EUR	Icade, REIT, 0.63%, 18/01/2031	70	0,01
100.000	EUR	Icade Sante SACA, REIT, 0.88%, 04/11/2029	77	0,02
200.000	EUR	Icade Sante SACA, REIT, 1.38%, 17/09/2030	153	0,03
100.000	EUR	Imerys SA, FRN, 2.00%, 10/12/2024	96	0,02
100.000	EUR	Imerys SA, FRN, 1.50%, 15/01/2027	87	0,02
100.000	EUR	Imerys SA, FRN, 1.00%, 15/07/2031	63	0,01
100.000	EUR	Indigo Group SAS, REIT, 2.13%, 16/04/2025	97	0,02
100.000	EUR	Indigo Group SAS, REIT, 1.63%, 19/04/2028	86	0,02
100.000	EUR	In'li SA, REIT, 1.13%, 02/07/2029	78	0,02
100.000	EUR	JCDecaux SE, 1.00%, 01/06/2023	99	0,02
100.000	EUR	JCDecaux SE, 2.00%, 24/10/2024	96	0,02
100.000	EUR	JCDecaux SE, 2.63%, 24/04/2028	86	0,02
100.000	EUR	JCDecaux SE, 1.63%, 07/02/2030	76	0,02
100.000	EUR	Kering SA, 1.25%, 05/05/2025	96	0,02
100.000	EUR	Kering SA, 1.25%, 10/05/2026	94	0,02
100.000	EUR	Kering SA, 1.50%, 05/04/2027	93	0,02
100.000	EUR	Kering SA, 0.75%, 13/05/2028	87	0,02
200.000	EUR	Kering SA, 1.88%, 05/05/2030	178	0,04
200.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 2.00%, 12/05/2029	164	0,03
200.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 0.63%, 01/07/2030	140	0,03
100.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 0.88%, 17/02/2031	70	0,01
100.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 1.25%, 29/09/2031	71	0,01
100.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 1.63%, 13/12/2032	70	0,01
100.000	EUR	La Mondiale SAM, 0.75%, 20/04/2026	87	0,02
100.000	EUR	La Mondiale SAM, 2.13%, 23/06/2031	74	0,01
100.000	EUR	La Mondiale SAM, FRN, 5.05%, 17/12/2025 <sup>1</sup>	95	0,02
100.000	EUR	Legrand SA, 0.50%, 09/10/2023	98	0,02
200.000	EUR	Legrand SA, 0.75%, 06/07/2024	194	0,04
100.000	EUR	Legrand SA, 0.63%, 24/06/2028	85	0,02
100.000	EUR	Legrand SA, 0.75%, 20/05/2030	81	0,02
100.000	EUR	Legrand SA, 0.38%, 06/10/2031	74	0,01
100.000	EUR	Legrand SA, 1.88%, 06/07/2032	84	0,02
200.000	EUR	L'Oreal SA, 0.38%, 29/03/2024	194	0,04

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Francia (continua)</b>				
200.000	EUR	L'Oreal SA, 0.88%, 29/06/2026	186	0,04
300.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.75%, 26/05/2024	293	0,06
200.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.75%, 07/04/2025	191	0,04
500.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.00%, 11/02/2026	455	0,10
200.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.13%, 11/02/2028	172	0,04
300.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.38%, 11/02/2031	235	0,05
100.000	EUR	Mercialys SA, REIT, 1.80%, 27/02/2026	87	0,02
100.000	EUR	Mercialys SA, REIT, 4.63%, 07/07/2027	92	0,02
100.000	EUR	Mercialys SA, REIT, 2.50%, 28/02/2029	79	0,02
100.000	EUR	Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal, 0.63%, 21/06/2027	81	0,02
200.000	EUR	Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal, FRN, 2.13%, 21/06/2052	133	0,03
200.000	EUR	Nerval SAS, REIT, 2.88%, 14/04/2032	164	0,03
100.000	EUR	New Immo Holding SA, REIT, 2.75%, 26/11/2026	84	0,02
100.000	EUR	Orange SA, 0.75%, 11/09/2023	98	0,02
100.000	EUR	Orange SA, 3.13%, 09/01/2024	100	0,02
200.000	EUR	Orange SA, 1.13%, 15/07/2024	193	0,04
200.000	EUR	Orange SA, 1.00%, 12/05/2025	190	0,04
300.000	EUR	Orange SA, 0.00%, 29/06/2026	267	0,06
100.000	EUR	Orange SA, 0.00%, 04/09/2026	88	0,02
100.000	EUR	Orange SA, 0.88%, 03/02/2027	90	0,02
200.000	EUR	Orange SA, 1.25%, 07/07/2027	182	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	0,06
200.000	EUR	Orange SA, 2.00%, 15/01/2029	185	0,04
100.000	EUR	Orange SA, 0.13%, 16/09/2029	80	0,02
200.000	EUR	Orange SA, 1.38%, 16/01/2030	174	0,04
200.000	EUR	Orange SA, 1.88%, 12/09/2030	177	0,04
200.000	EUR	Orange SA, 1.63%, 07/04/2032	168	0,03
100.000	EUR	Orange SA, 2.38%, 18/05/2032	90	0,02
200.000	EUR	Orange SA, 0.50%, 04/09/2032	147	0,03
300.000	EUR	Orange SA, 8.13%, 28/01/2033	396	0,08
300.000	EUR	Orange SA, 0.63%, 16/12/2033	214	0,04
100.000	EUR	Orange SA, 0.75%, 29/06/2034	71	0,01
200.000	EUR	Orange SA, 1.38%, 04/09/2049	130	0,03
100.000	EUR	Orange SA, FRN, 5.25%, 02/07/2024 <sup>1</sup>	100	0,02
200.000	EUR	Orange SA, FRN, 2.38%, 15/01/2025 <sup>1</sup>	185	0,04
200.000	EUR	Orange SA, FRN, 5.00%, 10/01/2026 <sup>1</sup>	198	0,04
100.000	EUR	Orange SA, FRN, 1.75%, 19/12/2026 <sup>1</sup>	85	0,02
100.000	EUR	Orange SA, FRN, 1.75%, 15/07/2028 <sup>1</sup>	78	0,02
200.000	EUR	Orange SA, FRN, 1.37%, 02/11/2029 <sup>1</sup>	150	0,03
200.000	EUR	Pernod Ricard SA, 0.00%, 24/10/2023	194	0,04
200.000	EUR	Pernod Ricard SA, 2.13%, 27/09/2024	197	0,04
200.000	EUR	Pernod Ricard SA, 1.13%, 07/04/2025	191	0,04
200.000	EUR	Pernod Ricard SA, 0.50%, 24/10/2027	175	0,04
100.000	EUR	Pernod Ricard SA, 1.38%, 07/04/2029	88	0,02
100.000	EUR	Pernod Ricard SA, 0.13%, 04/10/2029	79	0,02
200.000	EUR	Pernod Ricard SA, 1.75%, 08/04/2030	177	0,04
100.000	EUR	Pernod Ricard SA, 0.88%, 24/10/2031	78	0,02
100.000	EUR	PSA Banque France SA, 0.75%, 19/04/2023	99	0,02
100.000	EUR	PSA Banque France SA, 0.63%, 21/06/2024	95	0,02
100.000	EUR	PSA Banque France SA, 0.00%, 22/01/2025	92	0,02
100.000	EUR	PSA Tresorerie GIE, 6.00%, 19/09/2033	105	0,02
100.000	EUR	Publicis Groupe SA, 0.50%, 03/11/2023	97	0,02
200.000	EUR	Publicis Groupe SA, 1.63%, 16/12/2024	193	0,04
100.000	EUR	RCI Banque SA, 0.50%, 15/09/2023	97	0,02
200.000	EUR	RCI Banque SA, 1.38%, 08/03/2024	193	0,04
250.000	EUR	RCI Banque SA, 2.00%, 11/07/2024	242	0,05
225.000	EUR	RCI Banque SA, 0.50%, 14/07/2025	201	0,04

NM1222U-2615757-66/212

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Francia (continua)</b>				
100.000	EUR	RCI Banque SA, 1.75%, 10/04/2026	90	0,02
200.000	EUR	RCI Banque SA, 1.63%, 26/05/2026	178	0,04
200.000	EUR	RCI Banque SA, 1.13%, 15/01/2027	171	0,04
75.000	EUR	RCI Banque SA, 4.75%, 06/07/2027	74	0,01
100.000	EUR	RCI Banque SA, 4.88%, 21/09/2028	97	0,02
300.000	EUR	Safran SA, 0.13%, 16/03/2026	266	0,06
100.000	EUR	Safran SA, 0.75%, 17/03/2031	78	0,02
100.000	EUR	SANEF SA, 1.88%, 16/03/2026	94	0,02
100.000	EUR	Sanofi, 2.50%, 14/11/2023	100	0,02
100.000	EUR	Sanofi, 0.63%, 05/04/2024	97	0,02
200.000	EUR	Sanofi, 1.00%, 01/04/2025	191	0,04
100.000	EUR	Sanofi, 0.88%, 06/04/2025	96	0,02
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	285	0,06
100.000	EUR	Sanofi, 0.50%, 13/01/2027	90	0,02
400.000	EUR	Sanofi, 1.13%, 05/04/2028	358	0,07
100.000	EUR	Sanofi, 0.88%, 21/03/2029	86	0,02
200.000	EUR	Sanofi, 1.25%, 06/04/2029	177	0,04
400.000	EUR	Sanofi, 1.38%, 21/03/2030	350	0,07
200.000	EUR	Sanofi, 1.50%, 01/04/2030	177	0,04
100.000	EUR	Sanofi, 1.25%, 21/03/2034	78	0,02
200.000	EUR	Sanofi, 1.88%, 21/03/2038	158	0,03
200.000	EUR	Schlumberger Finance France SAS, 1.00%, 18/02/2026	186	0,04
500.000	EUR	Schneider Electric SE, 0.88%, 13/12/2026	456	0,10
200.000	EUR	Schneider Electric SE, 1.38%, 21/06/2027	184	0,04
100.000	EUR	Schneider Electric SE, 1.50%, 15/01/2028	92	0,02
200.000	EUR	Schneider Electric SE, 0.25%, 11/03/2029	164	0,03
200.000	EUR	Schneider Electric SE, FRN, 0.25%, 09/09/2024	191	0,04
100.000	EUR	SCOR SE, FRN, 3.63%, 27/05/2048	90	0,02
100.000	EUR	SCOR SE, FRN, 1.37%, 17/09/2051	70	0,01
200.000	EUR	Societe Fonciere Lyonnaise SA, REIT, 1.50%, 05/06/2027	178	0,04
100.000	EUR	Societe Generale SA, 0.75%, 26/05/2023	99	0,02
300.000	EUR	Societe Generale SA, 1.25%, 15/02/2024	291	0,06
200.000	EUR	Societe Generale SA, 1.13%, 23/01/2025	189	0,04
200.000	EUR	Societe Generale SA, 2.63%, 27/02/2025	191	0,04
400.000	EUR	Societe Generale SA, 0.13%, 24/02/2026	357	0,07
100.000	EUR	Societe Generale SA, 0.88%, 01/07/2026	88	0,02
300.000	EUR	Societe Generale SA, 0.75%, 25/01/2027	256	0,05
300.000	EUR	Societe Generale SA, 0.25%, 08/07/2027	255	0,05
100.000	EUR	Societe Generale SA, 1.38%, 13/01/2028	85	0,02
300.000	EUR	Societe Generale SA, 0.13%, 18/02/2028	246	0,05
200.000	EUR	Societe Generale SA, 2.13%, 27/09/2028	173	0,04
200.000	EUR	Societe Generale SA, 1.75%, 22/03/2029	167	0,03
200.000	EUR	Societe Generale SA, 2.63%, 30/05/2029	185	0,04
100.000	EUR	Societe Generale SA, 0.88%, 24/09/2029	77	0,02
300.000	EUR	Societe Generale SA, 1.25%, 12/06/2030	231	0,05
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 1.50%, 30/05/2025	194	0,04
100.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 1.12%, 21/04/2026	93	0,02
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 0.13%, 17/11/2026	179	0,04
300.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 0.63%, 02/12/2027	255	0,05
300.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 0.88%, 22/09/2028	251	0,05
300.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 0.50%, 12/06/2029	236	0,05
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 1.00%, 24/11/2030	170	0,04
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 1.12%, 30/06/2031	165	0,03
100.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 5.25%, 06/09/2032	97	0,02
200.000	EUR	Sodexo SA, 0.75%, 27/04/2025	187	0,04
100.000	EUR	Sodexo SA, 1.13%, 22/05/2025	94	0,02
100.000	EUR	Sodexo SA, 2.50%, 24/06/2026	95	0,02
150.000	EUR	Sodexo SA, 0.75%, 14/04/2027	131	0,03

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Francia (continua)</b>				
100.000	EUR	Sodexo SA, 1.00%, 17/07/2028	84	0,02
150.000	EUR	Sodexo SA, 1.00%, 27/04/2029	123	0,02
200.000	EUR	Sogecap SA, FRN, 4.13%, 18/02/2026 <sup>1</sup>	184	0,04
100.000	EUR	Suez SA, 2.75%, 09/10/2023	100	0,02
100.000	EUR	Suez SA, 1.00%, 03/04/2025	95	0,02
100.000	EUR	Suez SA, 1.75%, 10/09/2025	96	0,02
300.000	EUR	Suez SA, 0.00%, 09/06/2026	265	0,06
200.000	EUR	Suez SA, 1.25%, 02/04/2027	182	0,04
300.000	EUR	Suez SA, 1.50%, 03/04/2029	262	0,05
100.000	EUR	Suez SA, 1.63%, 17/09/2030	85	0,02
100.000	EUR	Suez SA, 0.50%, 14/10/2031	73	0,01
200.000	EUR	Suez SA, 1.63%, 21/09/2032	159	0,03
100.000	EUR	Suez SA, 1.25%, 14/05/2035	70	0,01
100.000	EUR	Suez SA, FRN, 2.87%, 19/01/2024 <sup>1</sup>	94	0,02
100.000	EUR	Suez SA, FRN, 1.62%, 06/01/2026 <sup>1</sup>	83	0,02
300.000	EUR	Suez SACA, 1.88%, 24/05/2027	273	0,06
300.000	EUR	Suez SACA, 2.88%, 24/05/2034	249	0,05
200.000	EUR	TDF Infrastructure SASU, 1.75%, 01/12/2029	154	0,03
100.000	EUR	TDF Infrastructure SASU, FRN, 2.50%, 07/04/2026	90	0,02
100.000	EUR	Teleperformance, 0.25%, 26/11/2027	83	0,02
200.000	EUR	Teleperformance, 3.75%, 24/06/2029	191	0,04
100.000	EUR	Teleperformance, FRN, 1.88%, 02/07/2025	96	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	72	0,01
100.000	EUR	Terega SASU, 0.63%, 27/02/2028	76	0,02
100.000	EUR	Tikehau Capital SCA, 2.25%, 14/10/2026	90	0,02
100.000	EUR	Tikehau Capital SCA, 1.63%, 31/03/2029	74	0,01
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 0.63%, 04/10/2024	96	0,02
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.38%, 19/03/2025	97	0,02
300.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 2.88%, 19/11/2025	296	0,06
200.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 2.50%, 25/03/2026	196	0,04
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.02%, 04/03/2027	91	0,02
300.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.49%, 08/04/2027	278	0,06
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	259	0,05
200.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.38%, 04/10/2029	174	0,04
200.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.49%, 04/09/2030	171	0,04
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 0.95%, 18/05/2031	80	0,02
400.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.99%, 08/04/2032	344	0,07
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.54%, 31/05/2039	70	0,01
200.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.62%, 18/05/2040	138	0,03
100.000	EUR	TotalEnergies Capital SA, 5.13%, 26/03/2024	104	0,02
230.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 1.75%, 04/04/2024 <sup>1</sup>	212	0,04
500.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 2.63%, 26/02/2025 <sup>1</sup>	458	0,10
300.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 3.37%, 10/06/2026 <sup>1</sup>	276	0,06
375.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 2.00%, 17/01/2027 <sup>1</sup>	308	0,06
300.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 1.62%, 25/10/2027 <sup>1</sup>	234	0,05
200.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 2.00%, 06/04/2030 <sup>1</sup>	147	0,03
250.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 2.13%, 25/07/2032 <sup>1</sup>	170	0,03
150.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 3.25%, 17/07/2036 <sup>1</sup>	104	0,02
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.50%, 12/06/2023	100	0,02
300.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.88%, 21/02/2025	276	0,06
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.00%, 14/03/2025	92	0,02
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.13%, 09/04/2025	189	0,04
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.38%, 09/03/2026	179	0,04
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.50%, 04/06/2026	92	0,02
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.00%, 27/02/2027	85	0,02
150.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.13%, 28/04/2027	127	0,03
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.63%, 04/05/2027	82	0,02
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.50%, 22/02/2028	83	0,02

NM1222U-2615757-68/212

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Francia (continua)</b>				
300.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.75%, 25/10/2028	231	0,05
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.63%, 09/04/2030	164	0,03
150.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.38%, 15/04/2030	111	0,02
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.88%, 15/01/2031	150	0,03
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.38%, 04/12/2031	140	0,03
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.88%, 29/03/2032	129	0,03
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.00%, 29/06/2032	146	0,03
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.75%, 27/02/2034	66	0,01
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.00%, 28/04/2036	65	0,01
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.00%, 29/05/2037	62	0,01
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.25%, 14/05/2038	123	0,03
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.75%, 01/07/2049	48	0,01
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, FRN, 2.13%, 25/07/2023 <sup>1</sup>	174	0,04
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, FRN, 2.87%, 25/01/2026 <sup>1</sup>	78	0,02
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.31%, 04/10/2023	98	0,02
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.89%, 14/01/2024	97	0,02
200.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.00%, 14/01/2027	173	0,04
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 4.63%, 30/03/2027	104	0,02
300.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.59%, 10/01/2028	270	0,06
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.25%, 15/04/2028	88	0,02
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.93%, 04/01/2029	85	0,02
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.94%, 07/01/2030	88	0,02
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.66%, 15/01/2031	77	0,02
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.80%, 15/01/2032	75	0,01
150.000	EUR	Veolia Environnement SA, 6.13%, 25/11/2033	171	0,04
200.000	EUR	Vinci SA, 1.00%, 26/09/2025	189	0,04
200.000	EUR	Vinci SA, 0.00%, 27/11/2028	166	0,03
200.000	EUR	Vinci SA, 1.63%, 18/01/2029	181	0,04
300.000	EUR	Vinci SA, 1.75%, 26/09/2030	269	0,06
300.000	EUR	Vinci SA, 0.50%, 09/01/2032	232	0,05
100.000	EUR	Vivendi SE, 1.13%, 24/11/2023	98	0,02
300.000	EUR	Vivendi SE, 0.88%, 18/09/2024	287	0,06
100.000	EUR	Vivendi SE, 0.63%, 11/06/2025	93	0,02
200.000	EUR	Vivendi SE, 1.13%, 11/12/2028	169	0,03
100.000	EUR	Wendel SE, 1.38%, 26/04/2026	90	0,02
100.000	EUR	Wendel SE, 2.50%, 09/02/2027	91	0,02
100.000	EUR	Wendel SE, 1.00%, 01/06/2031	70	0,01
100.000	EUR	Wendel SE, 1.38%, 18/01/2034	64	0,01
200.000	EUR	Worldline SA, 0.25%, 18/09/2024	186	0,04
100.000	EUR	Worldline SA, 0.88%, 30/06/2027	86	0,02
100.000	EUR	WPP Finance SA, 2.25%, 22/09/2026	94	0,02
200.000	EUR	WPP Finance SA, 2.38%, 19/05/2027	186	0,04
<b>Francia - Totale</b>			<b>93.928</b>	<b>19,91</b>
<b>Germania (31 marzo 2022: 8,80%)</b>				
200.000	EUR	Aareal Bank AG, 0.38%, 10/04/2024	188	0,04
100.000	EUR	Aareal Bank AG, 0.05%, 02/09/2026	81	0,02
100.000	EUR	Aareal Bank AG, 0.25%, 23/11/2027	75	0,02
200.000	EUR	Aareal Bank AG, 0.75%, 18/04/2028	151	0,03
200.000	EUR	adidas AG, 0.00%, 09/09/2024	190	0,04
100.000	EUR	adidas AG, 0.63%, 10/09/2035	68	0,01
100.000	EUR	Albemarle New Holding GmbH, 1.13%, 25/11/2025	90	0,02
100.000	EUR	Albemarle New Holding GmbH, 1.63%, 25/11/2028	83	0,02
300.000	EUR	Allianz SE, FRN, 4.75%, 24/10/2023 <sup>1</sup>	296	0,06
300.000	EUR	Allianz SE, FRN, 3.38%, 18/09/2024 <sup>1</sup>	284	0,06
300.000	EUR	Allianz SE, FRN, 4.60%, 07/09/2038	289	0,06
200.000	EUR	Allianz SE, FRN, 2.24%, 07/07/2045	186	0,04
300.000	EUR	Allianz SE, FRN, 3.10%, 06/07/2047	275	0,06
200.000	EUR	Allianz SE, FRN, 1.30%, 25/09/2049	151	0,03
100.000	EUR	Allianz SE, FRN, 2.12%, 08/07/2050	78	0,02



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Germania (continua)</b>				
300.000	EUR	Allianz SE, FRN, 4.25%, 05/07/2052	268	0,06
100.000	EUR	alstria office REIT-AG, 1.50%, 23/06/2026	79	0,02
100.000	EUR	alstria office REIT-AG, 1.50%, 15/11/2027	73	0,01
100.000	EUR	alstria office REIT-AG, FRN, 2.13%, 12/04/2023	98	0,02
100.000	EUR	Amphenol Technologies Holding GmbH, 0.75%, 04/05/2026	91	0,02
100.000	EUR	Amphenol Technologies Holding GmbH, 2.00%, 08/10/2028	90	0,02
200.000	EUR	Amprion GmbH, 3.45%, 22/09/2027	196	0,04
200.000	EUR	Amprion GmbH, 3.97%, 22/09/2032	197	0,04
200.000	EUR	Amprion GmbH, 0.63%, 23/09/2033	138	0,03
100.000	EUR	BASF SE, 2.50%, 22/01/2024	100	0,02
150.000	EUR	BASF SE, 0.88%, 22/05/2025	142	0,03
400.000	EUR	BASF SE, 0.75%, 17/03/2026	366	0,08
200.000	EUR	BASF SE, 0.25%, 05/06/2027	172	0,04
50.000	EUR	BASF SE, 0.88%, 15/11/2027	44	0,01
200.000	EUR	BASF SE, 3.13%, 29/06/2028	193	0,04
200.000	EUR	BASF SE, 1.50%, 22/05/2030	168	0,04
300.000	EUR	BASF SE, 1.50%, 17/03/2031	243	0,05
100.000	EUR	BASF SE, 0.88%, 06/10/2031	75	0,02
100.000	EUR	BASF SE, 3.75%, 29/06/2032	95	0,02
100.000	EUR	BASF SE, 1.63%, 15/11/2037	70	0,01
600.000	EUR	Bayer AG, 0.38%, 06/07/2024	572	0,12
300.000	EUR	Bayer AG, 0.75%, 06/01/2027	264	0,06
300.000	EUR	Bayer AG, 0.38%, 12/01/2029	234	0,05
300.000	EUR	Bayer AG, 1.13%, 06/01/2030	238	0,05
200.000	EUR	Bayer AG, 0.63%, 12/07/2031	145	0,03
300.000	EUR	Bayer AG, 1.38%, 06/07/2032	224	0,05
200.000	EUR	Bayer AG, 1.00%, 12/01/2036	127	0,03
100.000	EUR	Berlin Hyp AG, 1.25%, 22/01/2025	95	0,02
200.000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.38%, 25/01/2027	176	0,04
100.000	EUR	Berlin Hyp AG, 1.13%, 25/10/2027	87	0,02
200.000	EUR	Berlin Hyp AG, 1.50%, 18/04/2028	172	0,04
200.000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.38%, 21/04/2031	149	0,03
100.000	EUR	Bertelsmann SE & Co. KGaA, 1.25%, 29/09/2025	96	0,02
200.000	EUR	Bertelsmann SE & Co. KGaA, 1.13%, 27/04/2026	188	0,04
200.000	EUR	Bertelsmann SE & Co. KGaA, 2.00%, 01/04/2028	184	0,04
100.000	EUR	Bertelsmann SE & Co. KGaA, 1.50%, 15/05/2030	85	0,02
100.000	EUR	Clearstream Banking AG, 0.00%, 01/12/2025	91	0,02
200.000	EUR	Commerzbank AG, 1.25%, 23/10/2023	195	0,04
325.000	EUR	Commerzbank AG, 0.63%, 28/08/2024	309	0,06
100.000	EUR	Commerzbank AG, 0.25%, 16/09/2024	93	0,02
200.000	EUR	Commerzbank AG, 0.10%, 11/09/2025	180	0,04
100.000	EUR	Commerzbank AG, 1.13%, 19/09/2025	90	0,02
300.000	EUR	Commerzbank AG, 1.00%, 04/03/2026	274	0,06
100.000	EUR	Commerzbank AG, 1.13%, 22/06/2026	87	0,02
100.000	EUR	Commerzbank AG, 0.50%, 04/12/2026	88	0,02
100.000	EUR	Commerzbank AG, 0.88%, 22/01/2027	85	0,02
175.000	EUR	Commerzbank AG, 0.38%, 01/09/2027	149	0,03
100.000	EUR	Commerzbank AG, 1.88%, 28/02/2028	85	0,02
100.000	EUR	Commerzbank AG, 1.50%, 28/08/2028	88	0,02
100.000	EUR	Commerzbank AG, FRN, 0.75%, 24/03/2026	91	0,02
200.000	EUR	Commerzbank AG, FRN, 3.00%, 14/09/2027	185	0,04
200.000	EUR	Continental AG, 0.00%, 12/09/2023	194	0,04
210.000	EUR	Continental AG, 0.38%, 27/06/2025	193	0,04
150.000	EUR	Continental AG, 2.50%, 27/08/2026	144	0,03
75.000	EUR	Covestro AG, 1.75%, 25/09/2024	72	0,01
100.000	EUR	Covestro AG, 0.88%, 03/02/2026	90	0,02
100.000	EUR	Covestro AG, 1.38%, 12/06/2030	78	0,02
150.000	EUR	Deutsche Bank AG, 1.13%, 30/08/2023	148	0,03
200.000	EUR	Deutsche Bank AG, 1.13%, 17/03/2025	187	0,04
200.000	EUR	Deutsche Bank AG, 2.63%, 12/02/2026	185	0,04

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Germania (continua)</b>				
400.000	EUR	Deutsche Bank AG, 1.63%, 20/01/2027	340	0,07
200.000	EUR	Deutsche Bank AG, 1.75%, 17/01/2028	164	0,03
400.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.00%, 19/11/2025	369	0,08
100.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.37%, 10/06/2026	94	0,02
200.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.37%, 03/09/2026	179	0,04
100.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 0.75%, 17/02/2027	86	0,02
400.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.88%, 23/02/2028	341	0,07
100.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 3.25%, 24/05/2028	90	0,02
200.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 5.00%, 05/09/2030	188	0,04
600.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.75%, 19/11/2030	454	0,10
400.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.37%, 17/02/2032	281	0,06
300.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 1.63%, 08/10/2025	292	0,06
100.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 0.13%, 22/02/2031	75	0,02
100.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 1.50%, 04/04/2032	82	0,02
100.000	EUR	Deutsche Boerse AG, FRN, 1.25%, 16/06/2047	83	0,02
100.000	EUR	Deutsche Boerse AG, FRN, 2.00%, 23/06/2048	83	0,02
100.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.75%, 07/02/2023	99	0,02
100.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.13%, 05/09/2024	92	0,02
200.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.25%, 17/01/2025	181	0,04
100.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.25%, 27/10/2025	86	0,02
100.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.10%, 02/02/2026	85	0,02
100.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 4.38%, 28/08/2026	97	0,02
100.000	EUR	Deutsche Post AG, 2.88%, 11/12/2024	100	0,02
200.000	EUR	Deutsche Post AG, 1.25%, 01/04/2026	189	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	171	0,04
150.000	EUR	Deutsche Post AG, 1.00%, 20/05/2032	118	0,02
100.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 0.88%, 25/03/2026	93	0,02
300.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 0.50%, 05/07/2027	264	0,06
200.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 1.75%, 25/03/2031	174	0,04
200.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 1.38%, 05/07/2034	155	0,03
100.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 2.25%, 29/03/2039	78	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
200.000	EUR	Deutsche Wohnen SE, REIT, 1.50%, 30/04/2030	161	0,03
100.000	EUR	Deutsche Wohnen SE, REIT, 1.30%, 07/04/2041	54	0,01
200.000	EUR	DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH, REIT, FRN, 2.50%, 25/01/2027	151	0,03
200.000	EUR	E.ON SE, 0.00%, 18/12/2023	193	0,04
100.000	EUR	E.ON SE, 0.88%, 22/05/2024	96	0,02
200.000	EUR	E.ON SE, 0.00%, 28/08/2024	189	0,04
25.000	EUR	E.ON SE, 0.88%, 08/01/2025	24	–
100.000	EUR	E.ON SE, 1.00%, 07/10/2025	94	0,02
200.000	EUR	E.ON SE, 0.13%, 18/01/2026	180	0,04
300.000	EUR	E.ON SE, 0.25%, 24/10/2026	264	0,06
165.000	EUR	E.ON SE, 0.38%, 29/09/2027	141	0,03
100.000	EUR	E.ON SE, 0.75%, 20/02/2028	86	0,02
200.000	EUR	E.ON SE, 2.88%, 26/08/2028	190	0,04
225.000	EUR	E.ON SE, 0.10%, 19/12/2028	177	0,04
150.000	EUR	E.ON SE, 1.63%, 22/05/2029	128	0,03
150.000	EUR	E.ON SE, 0.35%, 28/02/2030	114	0,02
100.000	EUR	E.ON SE, 0.75%, 18/12/2030	76	0,02
250.000	EUR	E.ON SE, 1.63%, 29/03/2031	205	0,04
70.000	EUR	E.ON SE, 0.88%, 20/08/2031	54	0,01
50.000	EUR	E.ON SE, 0.63%, 07/11/2031	36	0,01
175.000	EUR	E.ON SE, 0.60%, 01/10/2032	124	0,03
125.000	EUR	E.ON SE, 0.88%, 18/10/2034	85	0,02
100.000	EUR	EEW Energy from Waste GmbH, 0.36%, 30/06/2026	85	0,02

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Germania (continua)</b>				
100.000	EUR	Eurogrid GmbH, 1.63%, 03/11/2023	99	0,02
200.000	EUR	Eurogrid GmbH, 1.88%, 10/06/2025	193	0,04
100.000	EUR	Eurogrid GmbH, 1.50%, 18/04/2028	89	0,02
200.000	EUR	Eurogrid GmbH, 3.28%, 05/09/2031	192	0,04
100.000	EUR	Eurogrid GmbH, 1.11%, 15/05/2032	78	0,02
100.000	EUR	Eurogrid GmbH, 0.74%, 21/04/2033	72	0,01
150.000	EUR	Evonik Industries AG, 0.38%, 07/09/2024	142	0,03
200.000	EUR	Evonik Industries AG, 0.63%, 18/09/2025	183	0,04
200.000	EUR	Evonik Industries AG, 2.25%, 25/09/2027	182	0,04
75.000	EUR	Evonik Industries AG, 0.75%, 07/09/2028	61	0,01
50.000	EUR	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA, 0.25%, 29/11/2023	48	0,01
150.000	EUR	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA, 1.50%, 11/07/2025	142	0,03
100.000	EUR	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA, 1.00%, 29/05/2026	90	0,02
225.000	EUR	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA, 0.63%, 30/11/2026	196	0,04
100.000	EUR	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA, 3.88%, 20/09/2027	96	0,02
50.000	EUR	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA, 1.25%, 29/11/2029	39	0,01
200.000	EUR	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA, 1.50%, 29/05/2030	156	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, 0.38%, 28/09/2026	88	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	85	0,02
175.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 2.88%, 15/02/2029	161	0,03
150.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 2.88%, 24/05/2030	135	0,03
150.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 1.13%, 28/01/2033	105	0,02
100.000	EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 0.75%, 23/11/2023	97	0,02
200.000	EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 0.38%, 09/03/2026	169	0,04
100.000	EUR	Hamburg Commercial Bank AG, FRN, 0.50%, 22/09/2026	85	0,02
100.000	EUR	Hannover Rueck SE, 1.13%, 18/04/2028	89	0,02
100.000	EUR	Hannover Rueck SE, FRN, 3.38%, 26/06/20251	93	0,02
300.000	EUR	Hannover Rueck SE, FRN, 1.12%, 09/10/2039	225	0,05
100.000	EUR	Hannover Rueck SE, FRN, 1.75%, 08/10/2040	76	0,01
100.000	EUR	Hannover Rueck SE, FRN, 1.37%, 30/06/2042	70	0,01
250.000	EUR	HeidelbergCement AG, 2.25%, 03/06/2024	246	0,05
175.000	EUR	HeidelbergCement AG, 1.50%, 07/02/2025	168	0,04
100.000	EUR	Hella GmbH & Co. KGaA, 1.00%, 17/05/2024	96	0,02
100.000	EUR	Hella GmbH & Co. KGaA, 0.50%, 26/01/2027	84	0,02
100.000	EUR	Henkel AG & Co. KGaA, 2.63%, 13/09/2027	97	0,02
100.000	EUR	Henkel AG & Co. KGaA, 0.50%, 17/11/2032	73	0,02
100.000	EUR	Heraeus Finance GmbH, 2.63%, 09/06/2027	92	0,02
250.000	EUR	Hochtief AG, 1.75%, 03/07/2025	235	0,05
50.000	EUR	Hochtief AG, 0.50%, 03/09/2027	40	0,01
175.000	EUR	Hochtief AG, 0.63%, 26/04/2029	124	0,03
400.000	EUR	Infineon Technologies AG, 0.63%, 17/02/2025	377	0,08
100.000	EUR	Infineon Technologies AG, 1.13%, 24/06/2026	92	0,02
200.000	EUR	Infineon Technologies AG, 1.63%, 24/06/2029	173	0,04
100.000	EUR	Infineon Technologies AG, 2.00%, 24/06/2032	83	0,02
200.000	EUR	KION Group AG, 1.63%, 24/09/2025	153	0,03
75.000	EUR	Knorr-Bremse AG, 1.13%, 13/06/2025	71	0,01
200.000	EUR	Knorr-Bremse AG, 3.25%, 21/09/2027	196	0,04
300.000	EUR	Lanxess AG, 1.13%, 16/05/2025	285	0,06
75.000	EUR	Lanxess AG, 0.00%, 08/09/2027	60	0,01
100.000	EUR	Lanxess AG, 1.75%, 22/03/2028	85	0,02
100.000	EUR	Lanxess AG, 0.63%, 01/12/2029	74	0,02
100.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 1.25%, 23/01/2024	96	0,02
200.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 0.38%, 17/01/2026	174	0,04
200.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 0.88%, 28/11/2027	165	0,03
100.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 0.75%, 30/06/2031	70	0,01
100.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 1.00%, 19/11/2032	64	0,01
100.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 0.88%, 30/03/2033	63	0,01



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Germania (continua)</b>				
200.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 1.50%, 17/01/2034	132	0,03
200.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.40%, 12/01/2024	196	0,04
175.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.00%, 15/11/2027	156	0,03
350.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.38%, 11/05/2028	314	0,07
250.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.50%, 03/07/2029	220	0,05
150.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.75%, 08/02/2030	123	0,03
175.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 2.38%, 22/05/2030	160	0,03
200.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.75%, 10/09/2030	161	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	238	0,05
200.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.75%, 11/03/2033	147	0,03
100.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.13%, 08/08/2034	74	0,02
225.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 2.13%, 03/07/2037	180	0,04
100.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.01%, 15/12/2023	97	0,02
200.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.13%, 16/07/2025	186	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	85	0,02
200.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 2.38%, 15/06/2030	185	0,04
200.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.88%, 05/07/2031	160	0,03
100.000	EUR	Merck KGaA, FRN, 1.62%, 25/06/2079	92	0,02
200.000	EUR	Merck KGaA, FRN, 2.87%, 25/06/2079	171	0,03
200.000	EUR	Merck KGaA, FRN, 1.62%, 09/09/2080	173	0,04
100.000	EUR	Metro AG, 1.13%, 06/03/2023	96	0,02
100.000	EUR	Metro AG, 1.50%, 19/03/2025	95	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	94	0,02
100.000	EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.50%, 08/06/2026	90	0,02
100.000	EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.38%, 09/03/2029	79	0,02
300.000	EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG, FRN, 1.25%, 26/05/2041	214	0,04
200.000	EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG, FRN, 1.00%, 26/05/2042	134	0,03
200.000	EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG, FRN, 3.25%, 26/05/2049	175	0,04
200.000	EUR	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH, FRN, 1.75%, 05/07/2025	190	0,04
300.000	EUR	Robert Bosch GmbH, 1.75%, 08/07/2024	294	0,06
300.000	EUR	RWE AG, 2.50%, 24/08/2025	292	0,06
225.000	EUR	RWE AG, 2.13%, 24/05/2026	212	0,04
200.000	EUR	RWE AG, 0.50%, 26/11/2028	163	0,03
175.000	EUR	RWE AG, 2.75%, 24/05/2030	158	0,03
100.000	EUR	RWE AG, 0.63%, 11/06/2031	74	0,02
150.000	EUR	RWE AG, 1.00%, 26/11/2033	104	0,02
200.000	EUR	Santander Consumer Bank AG, 0.25%, 15/10/2024	188	0,04
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
100.000	EUR	SAP SE, 1.00%, 13/03/2026	94	0,02
200.000	EUR	SAP SE, 0.13%, 18/05/2026	181	0,04
100.000	EUR	SAP SE, 1.75%, 22/02/2027	95	0,02
200.000	EUR	SAP SE, 1.25%, 10/03/2028	182	0,04
200.000	EUR	SAP SE, 0.38%, 18/05/2029	167	0,03
100.000	EUR	SAP SE, 1.38%, 13/03/2030	87	0,02
200.000	EUR	SAP SE, 1.63%, 10/03/2031	174	0,04
100.000	EUR	Talanx AG, 3.13%, 13/02/2023	100	0,02
100.000	EUR	Talanx AG, 2.50%, 23/07/2026	97	0,02
100.000	EUR	Talanx AG, FRN, 1.75%, 01/12/2042	71	0,01
100.000	EUR	Talanx AG, FRN, 2.25%, 05/12/2047	86	0,02
200.000	EUR	Vantage Towers AG, 0.00%, 31/03/2025	183	0,04
200.000	EUR	Vantage Towers AG, 0.38%, 31/03/2027	171	0,04
200.000	EUR	Vantage Towers AG, 0.75%, 31/03/2030	154	0,03

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Germania (continua)</b>				
100.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 3.13%, 10/07/2023	99	0,02
200.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 2.88%, 12/06/2025	194	0,04
100.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 4.00%, 26/09/2027	98	0,02
100.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 1.50%, 25/09/2028	84	0,02
100.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 0.13%, 10/09/2029	73	0,01
100.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 4.63%, 26/09/2032	98	0,02
100.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 0.50%, 10/09/2034	60	0,01
150.000	EUR	Volkswagen Bank GmbH, 0.75%, 15/06/2023	147	0,03
200.000	EUR	Volkswagen Bank GmbH, 1.88%, 31/01/2024	195	0,04
200.000	EUR	Volkswagen Bank GmbH, 1.25%, 10/06/2024	193	0,04
200.000	EUR	Volkswagen Bank GmbH, 1.25%, 15/12/2025	185	0,04
200.000	EUR	Volkswagen Bank GmbH, 2.50%, 31/07/2026	188	0,04
100.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.88%, 12/04/2023	99	0,02
200.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 1.50%, 01/10/2024	192	0,04
200.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.25%, 31/01/2025	185	0,04
300.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.00%, 12/02/2025	274	0,06
200.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 3.00%, 06/04/2025	197	0,04
200.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 2.25%, 16/10/2026	188	0,04
275.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.13%, 12/02/2027	231	0,05
100.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 2.25%, 01/10/2027	91	0,02
175.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.88%, 31/01/2028	147	0,03
125.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 3.38%, 06/04/2028	120	0,02
200.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.38%, 12/02/2030	148	0,03
125.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.00%, 12/07/2023	122	0,03
200.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 2.63%, 15/01/2024	198	0,04
200.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 1.13%, 04/04/2024	193	0,04
200.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.00%, 19/07/2024	188	0,04
100.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 1.38%, 20/01/2025	95	0,02
400.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.25%, 12/01/2026	357	0,08
100.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 1.50%, 19/06/2026	92	0,02
175.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.38%, 20/07/2026	153	0,03
100.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.50%, 12/01/2029	79	0,02
200.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.63%, 19/07/2029	155	0,03
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.00%, 01/09/2023	97	0,02
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.00%, 16/09/2024	93	0,02
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.00%, 01/12/2025	87	0,02
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.38%, 28/01/2026	91	0,02
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.38%, 16/06/2027	163	0,03
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.88%, 28/06/2028	85	0,02
300.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.25%, 01/09/2028	229	0,05
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.63%, 14/12/2029	145	0,03
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.63%, 24/03/2031	138	0,03
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 2.38%, 25/03/2032	158	0,03
300.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.75%, 01/09/2032	196	0,04
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.00%, 16/06/2033	128	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	94	0,02
200.000	EUR	WPP Finance Deutschland GmbH, 1.63%, 23/03/2030	163	0,03
<b>Germania - Totale</b>			<b>43.350</b>	<b>9,19</b>
<b>Guernsey (31 marzo 2022: 0,06%)</b>				
100.000	EUR	Globalworth Real Estate Investments Ltd., REIT, 3.00%, 29/03/2025	88	0,02
100.000	EUR	Globalworth Real Estate Investments Ltd., REIT, 2.95%, 29/07/2026	82	0,02
100.000	EUR	Sirius Real Estate Ltd., REIT, 1.75%, 24/11/2028	67	0,01
<b>Guernsey - Totale</b>			<b>237</b>	<b>0,05</b>
<b>Hong Kong (31 marzo 2022: 0,04%)</b>				
200.000	EUR	AIA Group Ltd., FRN, 0.88%, 09/09/2033	154	0,03
<b>Hong Kong - Totale</b>			<b>154</b>	<b>0,03</b>

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
		<b>Ungheria (31 marzo 2022: 0,06%)</b>		
100.000	EUR	MOL Hungarian Oil & Gas plc, 1.50%, 08/10/2027	82	0,02
		<b>Ungheria - Totale</b>	<b>82</b>	<b>0,02</b>
		<b>Islanda (31 marzo 2022: 0,07%)</b>		
125.000	EUR	Arion Banki HF, 0.38%, 14/07/2025	108	0,02
		<b>Islanda - Totale</b>	<b>108</b>	<b>0,02</b>
		<b>Irlanda (31 marzo 2022: 1,90%)</b>		
300.000	EUR	Abbott Ireland Financing DAC, 0.88%, 27/09/2023	295	0,06
230.000	EUR	Abbott Ireland Financing DAC, 1.50%, 27/09/2026	216	0,05
150.000	EUR	Abbott Ireland Financing DAC, 0.38%, 19/11/2027	131	0,03
300.000	EUR	AIB Group plc, 1.25%, 28/05/2024	288	0,06
100.000	EUR	AIB Group plc, 2.25%, 03/07/2025	94	0,02
300.000	EUR	AIB Group plc, FRN, 3.63%, 04/07/2026	291	0,06
100.000	EUR	AIB Group plc, FRN, 0.50%, 17/11/2027	84	0,02
125.000	EUR	AIB Group plc, FRN, 2.25%, 04/04/2028	110	0,02
100.000	EUR	Atlas Copco Finance DAC, 0.75%, 08/02/2032	75	0,02
200.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, 1.38%, 29/08/2023	196	0,04
100.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 1.00%, 25/11/2025	93	0,02
125.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 1.88%, 05/06/2026	116	0,03
200.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 0.38%, 10/05/2027	170	0,04
150.000	EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.50%, 06/09/2029	120	0,02
225.000	EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.88%, 06/05/2033	161	0,03
200.000	EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 1.50%, 06/05/2041	127	0,03
150.000	EUR	CRH Finance DAC, 1.38%, 18/10/2028	130	0,03
100.000	EUR	CRH Finance DAC, FRN, 3.13%, 03/04/2023	100	0,02
150.000	EUR	CRH SMW Finance DAC, 1.25%, 05/11/2026	137	0,03
100.000	EUR	Dell Bank International DAC, 1.63%, 24/06/2024	97	0,02
100.000	EUR	Dell Bank International DAC, 0.50%, 27/10/2026	87	0,02
150.000	EUR	DXC Capital Funding DAC, 0.45%, 15/09/2027	124	0,03
175.000	EUR	DXC Capital Funding DAC, 0.95%, 15/09/2031	126	0,03
200.000	EUR	Eaton Capital Unlimited Co., 0.75%, 20/09/2024	191	0,04
100.000	EUR	Eaton Capital Unlimited Co., 0.70%, 14/05/2025	94	0,02
200.000	EUR	Eaton Capital Unlimited Co., 0.13%, 08/03/2026	178	0,04
100.000	EUR	Eaton Capital Unlimited Co., 0.58%, 08/03/2030	78	0,02
200.000	EUR	Experian Europe DAC, 1.56%, 16/05/2031	164	0,03
300.000	EUR	Fresenius Finance Ireland plc, 1.50%, 30/01/2024	293	0,06
100.000	EUR	Fresenius Finance Ireland plc, 0.00%, 01/10/2025	90	0,02
150.000	EUR	Fresenius Finance Ireland plc, 2.13%, 01/02/2027	141	0,03
250.000	EUR	Fresenius Finance Ireland plc, 0.88%, 01/10/2031	180	0,04
50.000	EUR	GE Capital European Funding Unlimited Co., 4.63%, 22/02/2027	51	0,01
200.000	EUR	Glencore Capital Finance DAC, 1.13%, 10/03/2028	162	0,03
150.000	EUR	Glencore Capital Finance DAC, 0.75%, 01/03/2029	113	0,02
100.000	EUR	Glencore Capital Finance DAC, 1.25%, 01/03/2033	66	0,01
100.000	EUR	Grenke Finance plc, 1.63%, 05/04/2024	94	0,02
50.000	EUR	Grenke Finance plc, 0.63%, 09/01/2025	44	0,01
100.000	EUR	Hammerson Ireland Finance DAC, REIT, 1.75%, 03/06/2027	73	0,01
100.000	EUR	Johnson Controls International plc, 1.00%, 15/09/2023	98	0,02
100.000	EUR	Johnson Controls International plc, 1.38%, 25/02/2025	95	0,02
150.000	EUR	Johnson Controls International plc, 0.38%, 15/09/2027	127	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	94	0,02
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	79	0,02
200.000	EUR	Kerry Group Financial Services Unlimited Co., 0.88%, 01/12/2031	149	0,03
100.000	EUR	Liberty Mutual Finance Europe DAC, 1.75%, 27/03/2024	98	0,02
200.000	EUR	Linde plc, 0.00%, 30/09/2026	176	0,04
100.000	EUR	Linde plc, 1.00%, 31/03/2027	90	0,02
100.000	EUR	Linde plc, 1.38%, 31/03/2031	84	0,02

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Irlanda (continua)</b>				
300.000	EUR	Linde plc, 0.38%, 30/09/2033	208	0,04
200.000	EUR	Linde plc, 1.63%, 31/03/2035	155	0,03
100.000	EUR	Linde plc, 1.00%, 30/09/2051	50	0,01
200.000	EUR	PartnerRe Ireland Finance DAC, 1.25%, 15/09/2026	182	0,04
100.000	EUR	Roadster Finance DAC, FRN, 1.63%, 09/12/2029	90	0,02
100.000	EUR	Ryanair DAC, 1.13%, 15/08/2023	98	0,02
200.000	EUR	Ryanair DAC, 2.88%, 15/09/2025	192	0,04
300.000	EUR	Ryanair DAC, 0.88%, 25/05/2026	262	0,06
100.000	EUR	Smurfit Kappa Acquisitions ULC, 2.88%, 15/01/2026	97	0,02
200.000	EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC, 1.50%, 15/09/2027	176	0,04
100.000	EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC, 0.50%, 22/09/2029	76	0,02
100.000	EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC, 1.00%, 22/09/2033	68	0,01
100.000	EUR	Transmission Finance DAC, 0.38%, 18/06/2028	79	0,02
100.000	EUR	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co., 1.63%, 17/06/2039	69	0,01
200.000	EUR	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co., FRN, 1.88%, 17/09/2050	152	0,03
100.000	EUR	Zurich Insurance Co. Ltd., 1.75%, 16/09/2024	97	0,02
100.000	EUR	Zurich Insurance Co. Ltd., FRN, 4.25%, 02/10/2043	100	0,02
<b>Irlanda - Totale</b>			<b>8.911</b>	<b>1,89</b>
<b>Italia (31 marzo 2022: 4,12%)</b>				
100.000	EUR	2i Rete Gas SpA, 3.00%, 16/07/2024	100	0,02
200.000	EUR	2i Rete Gas SpA, 2.20%, 11/09/2025	189	0,04
200.000	EUR	2i Rete Gas SpA, 1.61%, 31/10/2027	173	0,04
100.000	EUR	Aeroporti di Roma SpA, 1.63%, 02/02/2029	80	0,02
100.000	EUR	Aeroporti di Roma SpA, 1.75%, 30/07/2031	72	0,01
150.000	EUR	Anima Holding SpA, 1.50%, 22/04/2028	120	0,03
350.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.13%, 16/09/2024	361	0,08
200.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 4.13%, 04/05/2026	196	0,04
100.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 3.88%, 29/01/2029	89	0,02
150.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 2.12%, 01/10/2030	112	0,02
100.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 2.43%, 14/07/2031	74	0,02
150.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 1.71%, 30/06/2032	100	0,02
200.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.80%, 06/07/2032	189	0,04
300.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, FRN, 4.60%, 21/11/2025 <sup>1</sup>	277	0,06
200.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, FRN, 5.50%, 27/10/2047	192	0,04
100.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, FRN, 5.00%, 08/06/2048	93	0,02
250.000	EUR	ASTM SpA, 1.00%, 25/11/2026	217	0,05
100.000	EUR	ASTM SpA, 1.63%, 08/02/2028	83	0,02
250.000	EUR	ASTM SpA, 1.50%, 25/01/2030	190	0,04
200.000	EUR	ASTM SpA, 2.38%, 25/11/2033	141	0,03
100.000	EUR	ASTM SpA, FRN, 3.38%, 13/02/2024	99	0,02
125.000	EUR	Azimut Holding SpA, 1.63%, 12/12/2024	119	0,02
200.000	EUR	Credito Emiliano SpA, FRN, 1.12%, 19/01/2028	166	0,03
90.000	EUR	Enel SpA, 5.25%, 20/05/2024	93	0,02
100.000	EUR	Enel SpA, 5.63%, 21/06/2027	106	0,02
230.000	EUR	Enel SpA, FRN, 3.50%, 24/02/2025 <sup>1</sup>	210	0,04
150.000	EUR	Enel SpA, FRN, 3.38%, 24/08/2026 <sup>1</sup>	128	0,03
200.000	EUR	Enel SpA, FRN, 2.25%, 12/10/2026 <sup>1</sup>	161	0,03
300.000	EUR	Enel SpA, FRN, 1.37%, 06/08/2027 <sup>1</sup>	223	0,05
150.000	EUR	Enel SpA, FRN, 1.88%, 06/08/2030 <sup>1</sup>	99	0,02
200.000	EUR	Eni SpA, 1.75%, 18/01/2024	197	0,04
100.000	EUR	Eni SpA, 0.63%, 19/09/2024	95	0,02
150.000	EUR	Eni SpA, 1.00%, 14/03/2025	143	0,03
250.000	EUR	Eni SpA, 3.75%, 12/09/2025	251	0,05
200.000	EUR	Eni SpA, 1.50%, 02/02/2026	188	0,04
200.000	EUR	Eni SpA, 1.25%, 18/05/2026	186	0,04
150.000	EUR	Eni SpA, 1.50%, 17/01/2027	138	0,03
100.000	EUR	Eni SpA, 1.63%, 17/05/2028	89	0,02
300.000	EUR	Eni SpA, 0.38%, 14/06/2028	246	0,05
100.000	EUR	Eni SpA, 1.13%, 19/09/2028	86	0,02

NM1222U-2615757-76/212

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Italia (continua)</b>				
150.000	EUR	Eni SpA, 3.63%, 29/01/2029	145	0,03
200.000	EUR	Eni SpA, 0.63%, 23/01/2030	154	0,03
300.000	EUR	Eni SpA, 2.00%, 18/05/2031	250	0,05
140.000	EUR	Eni SpA, 1.00%, 11/10/2034	97	0,02
325.000	EUR	Eni SpA, FRN, 2.63%, 13/10/2025 <sup>1</sup>	279	0,06
300.000	EUR	Eni SpA, FRN, 2.00%, 02/11/2027 <sup>1</sup>	233	0,05
325.000	EUR	Eni SpA, FRN, 3.38%, 13/07/2029 <sup>1</sup>	245	0,05
200.000	EUR	Eni SpA, FRN, 2.75%, 02/11/2030 <sup>1</sup>	141	0,03
200.000	EUR	ERG SpA, 1.88%, 11/04/2025	192	0,04
100.000	EUR	ERG SpA, 0.88%, 15/09/2031	72	0,02
200.000	EUR	FCA Bank SpA, 0.13%, 16/11/2023	193	0,04
300.000	EUR	FCA Bank SpA, 0.00%, 16/04/2024	284	0,06
100.000	EUR	FCA Bank SpA, 0.50%, 13/09/2024	94	0,02
100.000	EUR	FinecoBank Banca Fineco SpA, FRN, 0.50%, 21/10/2027	84	0,02
200.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.38%, 18/01/2024	195	0,04
400.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.00%, 04/07/2024	381	0,08
300.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.75%, 04/12/2024	282	0,06
250.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.63%, 21/04/2025	232	0,05
250.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 2.13%, 26/05/2025	238	0,05
450.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.00%, 19/11/2026	391	0,08
300.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.75%, 06/09/2027	292	0,06
300.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.75%, 16/03/2028	241	0,05
150.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.75%, 20/03/2028	128	0,03
100.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.75%, 04/07/2029	82	0,02
250.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.35%, 24/02/2031	174	0,04
100.000	EUR	Iren SpA, 0.88%, 04/11/2024	94	0,02
300.000	EUR	Iren SpA, 1.95%, 19/09/2025	284	0,06
100.000	EUR	Iren SpA, 0.88%, 14/10/2029	76	0,02
100.000	EUR	Iren SpA, 1.00%, 01/07/2030	74	0,02
100.000	EUR	Iren SpA, 0.25%, 17/01/2031	68	0,01
200.000	EUR	Italgas SpA, 1.63%, 19/01/2027	182	0,04
200.000	EUR	Italgas SpA, 0.00%, 16/02/2028	159	0,03
100.000	EUR	Italgas SpA, 1.63%, 18/01/2029	84	0,02
200.000	EUR	Italgas SpA, 0.88%, 24/04/2030	150	0,03
150.000	EUR	Italgas SpA, 0.50%, 16/02/2033	96	0,02
200.000	EUR	Leasys SpA, 0.00%, 22/07/2024	187	0,04
250.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.13%, 23/04/2025	231	0,05
100.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.13%, 15/07/2025	92	0,02
150.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 0.88%, 15/01/2026	133	0,03
200.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.00%, 08/09/2027	168	0,04
175.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, FRN, 1.00%, 17/07/2029	139	0,03
100.000	EUR	Snam SpA, 1.00%, 18/09/2023	98	0,02
200.000	EUR	Snam SpA, 0.00%, 12/05/2024	190	0,04
100.000	EUR	Snam SpA, 0.00%, 15/08/2025	90	0,02
200.000	EUR	Snam SpA, 1.25%, 28/08/2025	187	0,04
150.000	EUR	Snam SpA, 0.88%, 25/10/2026	133	0,03
100.000	EUR	Snam SpA, 1.38%, 25/10/2027	89	0,02
250.000	EUR	Snam SpA, 0.00%, 07/12/2028	190	0,04
200.000	EUR	Snam SpA, 0.75%, 20/06/2029	156	0,03
100.000	EUR	Snam SpA, 0.75%, 17/06/2030	75	0,02
100.000	EUR	Snam SpA, 0.63%, 30/06/2031	71	0,01
200.000	EUR	Snam SpA, 1.25%, 20/06/2034	136	0,03
100.000	EUR	Snam SpA, 1.00%, 12/09/2034	64	0,01
200.000	EUR	Societa Cattolica Di Assicurazione SpA, FRN, 4.25%, 14/12/2047	182	0,04
250.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.00%, 23/07/2023	246	0,05
100.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.13%, 25/07/2025	91	0,02
100.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.00%, 10/04/2026	92	0,02
200.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.38%, 26/07/2027	179	0,04
100.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.00%, 11/10/2028	84	0,02
200.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.38%, 23/06/2029	157	0,03



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Italia (continua)</b>				
125.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.38%, 25/09/2030	92	0,02
100.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.75%, 24/07/2032	72	0,01
100.000	EUR	UniCredit SpA, 0.50%, 09/04/2025	91	0,02
300.000	EUR	UniCredit SpA, 0.33%, 19/01/2026	261	0,06
150.000	EUR	UniCredit SpA, 2.13%, 24/10/2026	137	0,03
400.000	EUR	UniCredit SpA, 0.85%, 19/01/2031	275	0,06
100.000	EUR	UniCredit SpA, 1.63%, 18/01/2032	71	0,01
250.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 1.25%, 25/06/2025	237	0,05
250.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 1.62%, 03/07/2025	236	0,05
400.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 1.20%, 20/01/2026	364	0,08
105.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 1.25%, 16/06/2026	96	0,02
250.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 2.20%, 22/07/2027	219	0,05
200.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 0.93%, 18/01/2028	167	0,04
250.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 0.80%, 05/07/2029	194	0,04
<b>Italia - Totale</b>			<b>18.409</b>	<b>3,91</b>
<b>Giappone (31 marzo 2022: 1,36%)</b>				
100.000	EUR	Asahi Group Holdings Ltd., 0.01%, 19/04/2024	95	0,02
200.000	EUR	Asahi Group Holdings Ltd., 0.16%, 23/10/2024	188	0,04
400.000	EUR	Asahi Group Holdings Ltd., 0.54%, 23/10/2028	329	0,07
100.000	EUR	East Japan Railway Co., 2.61%, 08/09/2025	98	0,02
100.000	EUR	East Japan Railway Co., 1.85%, 13/04/2033	83	0,02
100.000	EUR	East Japan Railway Co., 0.77%, 15/09/2034	70	0,01
200.000	EUR	East Japan Railway Co., 1.10%, 15/09/2039	130	0,03
200.000	EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 0.34%, 19/07/2024	189	0,04
150.000	EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 0.87%, 07/09/2024	143	0,03
200.000	EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 0.85%, 19/07/2029	160	0,03
200.000	EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 3.56%, 15/06/2032	184	0,04
200.000	EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., FRN, 2.26%, 14/06/2025	195	0,04
200.000	EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., FRN, 3.27%, 19/09/2025	198	0,04
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 1.02%, 11/10/2023	98	0,02
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.52%, 10/06/2024	95	0,02
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.12%, 06/09/2024	94	0,02
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.96%, 16/10/2024	95	0,02
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.21%, 07/10/2025	90	0,02
150.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.18%, 13/04/2026	131	0,03
200.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 1.63%, 08/04/2027	179	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	87	0,02
200.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.40%, 06/09/2029	151	0,03
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.80%, 15/04/2030	77	0,02
125.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.69%, 07/10/2030	93	0,02
200.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 2.10%, 08/04/2032	161	0,03
150.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 4.03%, 05/09/2032	143	0,03
200.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.84%, 12/04/2033	139	0,03
200.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., FRN, 0.47%, 06/09/2029	157	0,03
100.000	EUR	Nissan Motor Co. Ltd., 1.94%, 15/09/2023	98	0,02
200.000	EUR	Nissan Motor Co. Ltd., 2.65%, 17/03/2026	184	0,04
150.000	EUR	Nissan Motor Co. Ltd., 3.20%, 17/09/2028	129	0,03
500.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.01%, 03/03/2025	466	0,10
100.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.08%, 13/12/2025	91	0,02
100.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.40%, 13/12/2028	83	0,02
150.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.34%, 03/03/2030	119	0,02
350.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 0.47%, 30/05/2024	334	0,07
200.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 0.93%, 11/10/2024	191	0,04
150.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 1.55%, 15/06/2026	138	0,03
100.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 1.41%, 14/06/2027	88	0,02
150.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 0.30%, 28/10/2027	123	0,03
250.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 0.63%, 23/10/2029	192	0,04
300.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 2.25%, 21/11/2026	287	0,06

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Giappone (continua)</b>				
200.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 0.75%, 09/07/2027	176	0,04
200.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 1.00%, 09/07/2029	167	0,03
200.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 1.38%, 09/07/2032	158	0,03
275.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 2.00%, 09/07/2040	197	0,04
300.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., FRN, 3.00%, 21/11/2030	280	0,06
<b>Giappone - Totale</b>			<b>7.498</b>	<b>1,58</b>
<b>Jersey (31 marzo 2022: 0,36%)</b>				
250.000	EUR	Aptiv plc, 1.50%, 10/03/2025	234	0,05
250.000	EUR	Glencore Finance Europe Ltd., 1.88%, 13/09/2023	246	0,05
150.000	EUR	Glencore Finance Europe Ltd., 0.63%, 11/09/2024	141	0,03
200.000	EUR	Glencore Finance Europe Ltd., 1.75%, 17/03/2025	189	0,04
100.000	EUR	Glencore Finance Europe Ltd., 3.75%, 01/04/2026	98	0,02
250.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.50%, 12/10/2027	231	0,05
100.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.50%, 11/02/2030	82	0,02
100.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.88%, 12/07/2032	76	0,01
100.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.13%, 08/10/2032	77	0,02
200.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.88%, 14/03/2036	141	0,03
100.000	EUR	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd., REIT, 3.25%, 12/11/2025	85	0,02
<b>Jersey - Totale</b>			<b>1.600</b>	<b>0,34</b>
<b>Liechtenstein (31 marzo 2022: 0,04%)</b>				
200.000	EUR	Swiss Life Finance I Ltd., 3.25%, 31/08/2029	187	0,04
200.000	EUR	Swiss Life Finance I Ltd., 0.50%, 15/09/2031	142	0,03
<b>Totale Liechtenstein</b>			<b>329</b>	<b>0,07</b>
<b>Lussemburgo (31 marzo 2022: 5,11%)</b>				
200.000	EUR	Acef Holding SCA, REIT, 1.25%, 26/04/2030	147	0,03
200.000	EUR	ArcelorMittal SA, 1.00%, 19/05/2023	197	0,04
100.000	EUR	ArcelorMittal SA, 2.25%, 17/01/2024	98	0,02
100.000	EUR	ArcelorMittal SA, 1.75%, 19/11/2025	92	0,02
100.000	EUR	ArcelorMittal SA, 4.88%, 26/09/2026	99	0,02
300.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, 1.00%, 07/01/2025	271	0,06
100.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, 0.63%, 09/07/2025	86	0,02
200.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, 1.50%, 28/05/2026	169	0,04
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	79	0,02
200.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, 1.45%, 09/07/2028	150	0,03
200.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, FRN, 2.13%, 17/01/2024 <sup>1</sup>	147	0,03
100.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, FRN, 2.87%, 01/12/2025 <sup>1</sup>	65	0,01
200.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, FRN, 1.62%, 15/04/2026 <sup>1</sup>	134	0,03
150.000	EUR	AXA Logistics Europe Master SCA, REIT, 0.88%, 15/11/2029	110	0,02
200.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.21%, 04/06/2026	184	0,04
125.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 0.33%, 13/08/2028	102	0,02
200.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.21%, 12/02/2036	135	0,03
200.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.34%, 13/08/2041	121	0,03
100.000	EUR	Bevco Lux Sarl, 1.50%, 16/09/2027	85	0,02
125.000	EUR	Bevco Lux Sarl, 1.00%, 16/01/2030	90	0,02
100.000	EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 0.50%, 12/09/2023	96	0,02
100.000	EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 2.00%, 15/02/2024	96	0,02
200.000	EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 2.20%, 24/07/2025	182	0,04
250.000	EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 1.00%, 20/10/2026	208	0,04
100.000	EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 1.25%, 26/04/2027	81	0,02



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Lussemburgo (continua)</b>				
100.000	EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 1.00%, 04/05/2028	76	0,02
100.000	EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 1.75%, 12/03/2029	77	0,02
200.000	EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 3.63%, 29/10/2029	171	0,04
150.000	EUR	CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund, 0.90%, 12/10/2029	113	0,02
200.000	EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 0.38%, 17/10/2023	194	0,04
250.000	EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 0.75%, 17/04/2026	223	0,05
200.000	EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 1.13%, 17/10/2028	163	0,03
100.000	EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 1.50%, 17/10/2031	74	0,02
100.000	EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 2.88%, 17/05/2023	100	0,02
125.000	EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 0.00%, 01/04/2024	119	0,02
100.000	EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.75%, 12/09/2025	95	0,02
150.000	EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.88%, 19/01/2026	141	0,03
100.000	EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.75%, 25/03/2027	92	0,02
200.000	EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.63%, 03/07/2029	169	0,04
200.000	EUR	CPI Property Group SA, REIT, 2.75%, 12/05/2026	173	0,04
150.000	EUR	CPI Property Group SA, REIT, 1.75%, 14/01/2030	104	0,02
200.000	EUR	CPI Property Group SA, REIT, 1.50%, 27/01/2031	128	0,03
100.000	EUR	CPI Property Group SA, REIT, FRN, 1.63%, 23/04/2027	79	0,02
125.000	EUR	Cromwell Ereit Lux Finco Sarl, REIT, FRN, 2.13%, 19/11/2025	99	0,02
200.000	EUR	Czech Gas Networks Investments Sarl, 1.00%, 16/07/2027	151	0,03
100.000	EUR	Czech Gas Networks Investments Sarl, 0.45%, 08/09/2029	63	0,01
200.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.20%, 18/03/2026	180	0,04
300.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.45%, 18/03/2028	254	0,05
300.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.75%, 18/09/2031	231	0,05
405.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 1.35%, 18/09/2039	267	0,06
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	180	0,04
100.000	EUR	Euroclear Investments SA, 1.13%, 07/12/2026	91	0,02
100.000	EUR	Euroclear Investments SA, 1.50%, 11/04/2030	84	0,02
100.000	EUR	Euroclear Investments SA, FRN, 2.63%, 11/04/2048	88	0,02
100.000	EUR	Euroclear Investments SA, FRN, 1.37%, 16/06/2051	72	0,02
200.000	EUR	Eurofins Scientific SE, 2.13%, 25/07/2024	195	0,04
100.000	EUR	Eurofins Scientific SE, 4.00%, 06/07/2029	96	0,02
200.000	EUR	Eurofins Scientific SE, 0.88%, 19/05/2031	143	0,03
200.000	EUR	GELF Bond Issuer I SA, REIT, 1.13%, 18/07/2029	153	0,03
300.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, 1.38%, 03/08/2026	259	0,05
100.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, 1.50%, 22/02/2027	86	0,02
200.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, 0.13%, 11/01/2028	149	0,03
100.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, FRN, 2.50%, 24/07/20231	82	0,02
100.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, FRN, 1.50%, 03/11/20261	70	0,01
100.000	EUR	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA, 2.50%, 09/10/2024	99	0,02
200.000	EUR	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA, 1.63%, 07/04/2026	186	0,04
100.000	EUR	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA, 1.50%, 14/06/2027	90	0,02
250.000	EUR	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA, 1.13%, 01/12/2027	217	0,05
100.000	EUR	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA, 1.75%, 24/04/2028	88	0,02
100.000	EUR	Helvetia Europe SA, FRN, 2.75%, 30/09/2041	76	0,02
100.000	EUR	Highland Holdings Sarl, 0.32%, 15/12/2026	86	0,02
150.000	EUR	Highland Holdings Sarl, 0.93%, 15/12/2031	111	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	175	0,04
300.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 2.25%, 26/05/2028	272	0,06
150.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 1.75%, 29/08/2029	126	0,03
150.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.63%, 06/04/2030	112	0,02
250.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.50%, 03/09/2030	183	0,04
100.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.50%, 23/04/2031	71	0,01
100.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.63%, 19/01/2033	66	0,01

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Lussemburgo (continua)</b>				
150.000	EUR	John Deere Cash Management SA, 1.85%, 02/04/2028	139	0,03
100.000	EUR	John Deere Cash Management SARL, 0.50%, 15/09/2023	98	0,02
150.000	EUR	John Deere Cash Management SARL, 1.38%, 02/04/2024	146	0,03
100.000	EUR	John Deere Cash Management SARL, 2.20%, 02/04/2032	89	0,02
100.000	EUR	John Deere Cash Management SARL, 1.65%, 13/06/2039	73	0,01
200.000	EUR	Logicor Financing Sarl, REIT, 2.25%, 13/05/2025	187	0,04
100.000	EUR	Logicor Financing Sarl, REIT, 1.50%, 13/07/2026	87	0,02
200.000	EUR	Logicor Financing Sarl, REIT, 1.63%, 15/07/2027	168	0,03
100.000	EUR	Logicor Financing Sarl, REIT, 3.25%, 13/11/2028	88	0,02
200.000	EUR	Logicor Financing Sarl, REIT, 1.63%, 17/01/2030	151	0,03
100.000	EUR	Logicor Financing Sarl, REIT, 0.88%, 14/01/2031	67	0,01
200.000	EUR	Logicor Financing Sarl, REIT, 2.00%, 17/01/2034	131	0,03
150.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.25%, 02/07/2025	139	0,03
125.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.00%, 15/10/2025	114	0,02
200.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 2.63%, 15/10/2025	197	0,04
300.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.13%, 07/03/2027	273	0,06
200.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.38%, 15/10/2028	167	0,03
150.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.00%, 15/10/2028	146	0,03
100.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.63%, 07/03/2031	86	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	143	0,03
200.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.75%, 15/10/2032	151	0,03
200.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.38%, 15/10/2034	190	0,04
300.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 2.25%, 07/03/2039	236	0,05
200.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.50%, 02/07/2039	138	0,03
275.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.38%, 15/10/2040	182	0,04
150.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.75%, 02/07/2049	95	0,02
225.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.63%, 15/10/2050	135	0,03
100.000	EUR	Mohawk Capital Finance SA, 1.75%, 12/06/2027	87	0,02
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.00%, 12/11/2024	95	0,02
200.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.00%, 03/12/2025	183	0,04
250.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.13%, 01/04/2026	236	0,05
125.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.00%, 14/06/2026	112	0,02
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	195	0,04
275.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.25%, 14/06/2029	228	0,05
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.25%, 02/11/2029	88	0,02
125.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.50%, 01/04/2030	111	0,02
200.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.25%, 29/03/2031	170	0,04
225.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.38%, 12/05/2032	170	0,04
150.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.00%, 03/03/2033	105	0,02
75.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.63%, 14/02/2034	55	0,01
175.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.50%, 29/03/2035	141	0,03
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.75%, 02/11/2037	80	0,02
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.38%, 03/12/2040	59	0,01
175.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.88%, 14/06/2041	113	0,02
250.000	EUR	Novartis Finance SA, 1.63%, 09/11/2026	238	0,05
100.000	EUR	Novartis Finance SA, 1.13%, 30/09/2027	91	0,02
550.000	EUR	Novartis Finance SA, 0.00%, 23/09/2028	455	0,10
250.000	EUR	Novartis Finance SA, 1.38%, 14/08/2030	216	0,05
100.000	EUR	Novartis Finance SA, 1.70%, 14/08/2038	77	0,02
200.000	EUR	P3 Group Sarl, REIT, 0.88%, 26/01/2026	168	0,03
100.000	EUR	P3 Group Sarl, REIT, 1.63%, 26/01/2029	74	0,02
150.000	EUR	Prologis International Funding II SA, REIT, 1.88%, 17/04/2025	143	0,03
100.000	EUR	Prologis International Funding II SA, REIT, 3.63%, 07/03/2030	95	0,02
175.000	EUR	Prologis International Funding II SA, REIT, 2.38%, 14/11/2030	150	0,03
200.000	EUR	Prologis International Funding II SA, REIT, 3.13%, 01/06/2031	178	0,04
125.000	EUR	Prologis International Funding II SA, REIT, 0.75%, 23/03/2033	82	0,02
200.000	EUR	Repsol Europe Finance Sarl, 0.38%, 06/07/2029	159	0,03
200.000	EUR	Repsol Europe Finance Sarl, 0.88%, 06/07/2033	141	0,03

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Lussemburgo (continua)</b>				
300.000	EUR	Richemont International Holding SA, 1.00%, 26/03/2026	280	0,06
100.000	EUR	Richemont International Holding SA, 0.75%, 26/05/2028	87	0,02
300.000	EUR	Richemont International Holding SA, 1.50%, 26/03/2030	260	0,05
100.000	EUR	Richemont International Holding SA, 1.13%, 26/05/2032	80	0,02
300.000	EUR	Richemont International Holding SA, 2.00%, 26/03/2038	231	0,05
100.000	EUR	Richemont International Holding SA, 1.63%, 26/05/2040	69	0,01
100.000	EUR	Segro Capital Sarl, REIT, 1.25%, 23/03/2026	90	0,02
100.000	EUR	Segro Capital Sarl, REIT, 1.88%, 23/03/2030	82	0,02
100.000	EUR	Segro Capital Sarl, REIT, 0.50%, 22/09/2031	69	0,01
100.000	EUR	SELP Finance Sarl, REIT, 1.50%, 20/11/2025	89	0,02
200.000	EUR	SELP Finance Sarl, REIT, 1.50%, 20/12/2026	171	0,04
100.000	EUR	SELP Finance Sarl, REIT, 3.75%, 10/08/2027	92	0,02
100.000	EUR	SELP Finance Sarl, REIT, 0.88%, 27/05/2029	74	0,02
150.000	EUR	SES SA, 1.63%, 22/03/2026	137	0,03
250.000	EUR	SES SA, 2.00%, 02/07/2028	212	0,04
100.000	EUR	SES SA, 3.50%, 14/01/2029	90	0,02
200.000	EUR	Simon International Finance SCA, REIT, 1.13%, 19/03/2033	138	0,03
200.000	EUR	Swiss Re Finance Luxembourg SA, FRN, 2.53%, 30/04/2050	160	0,03
100.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 0.00%, 14/06/2024	94	0,02
200.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 0.13%, 10/11/2024	185	0,04
200.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 0.75%, 24/03/2029	158	0,03
300.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 1.25%, 24/03/2033	206	0,04
100.000	EUR	Tyco Electronics Group SA, 0.00%, 16/02/2029	79	0,02
200.000	EUR	Tyco Electronics Group SA, FRN, 0.00%, 14/02/2025	186	0,04
200.000	EUR	Whirlpool Finance Luxembourg Sarl, 1.25%, 02/11/2026	181	0,04
150.000	EUR	Whirlpool Finance Luxembourg Sarl, 1.10%, 09/11/2027	129	0,03
<b>Lussemburgo - Totale</b>			<b>23.338</b>	<b>4,95</b>
<b>Mexico (31 March 2022: 0.22%)</b>				
100.000	EUR	America Movil SAB de CV, 3.26%, 22/07/2023	100	0,02
150.000	EUR	America Movil SAB de CV, 1.50%, 10/03/2024	147	0,03
100.000	EUR	America Movil SAB de CV, 0.75%, 26/06/2027	88	0,02
100.000	EUR	America Movil SAB de CV, 2.13%, 10/03/2028	92	0,02
200.000	EUR	Fomento Economico Mexicano SAB de CV, 0.50%, 28/05/2028	162	0,04
100.000	EUR	Fomento Economico Mexicano SAB de CV, 1.00%, 28/05/2033	67	0,01
150.000	EUR	Sigma Alimentos SA de CV, 2.63%, 07/02/2024	145	0,03
<b>Messico - Totale</b>			<b>801</b>	<b>0,17</b>
<b>Paesi Bassi (31 marzo 2022: 17,60%)</b>				
200.000	EUR	ABB Finance BV, 0.75%, 16/05/2024	193	0,04
200.000	EUR	ABB Finance BV, 0.00%, 19/01/2030	151	0,03
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.88%, 15/01/2024	195	0,04
300.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.00%, 16/04/2025	287	0,06
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.88%, 22/04/2025	190	0,04
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.25%, 28/05/2025	189	0,04
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.50%, 15/04/2026	183	0,04
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.60%, 15/01/2027	175	0,04
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 2.38%, 01/06/2027	186	0,04
300.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.50%, 23/09/2029	233	0,05
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.00%, 01/06/2032	178	0,04
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.00%, 02/06/2033	142	0,03
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.25%, 20/01/2034	141	0,03
150.000	EUR	Achmea BV, 1.50%, 26/05/2027	137	0,03
150.000	EUR	Achmea BV, FRN, 4.25%, 02/04/2025 <sup>1</sup>	142	0,03
150.000	EUR	Adecco International Financial Services BV, 1.00%, 02/12/2024	142	0,03
200.000	EUR	Adecco International Financial Services BV, 0.13%, 21/09/2028	158	0,03
100.000	EUR	Adecco International Financial Services BV, 0.50%, 21/09/2031	70	0,01
100.000	EUR	Adecco International Financial Services BV, FRN, 1.00%, 21/03/2082	72	0,01
100.000	EUR	Aegon Bank NV, 0.63%, 21/06/2024	95	0,02

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Paesi Bassi (continua)</b>				
200.000	EUR	Aegon NV, FRN, 4.00%, 25/04/2044	192	0,04
100.000	EUR	AGCO International Holdings BV, 0.80%, 06/10/2028	77	0,02
100.000	EUR	Airbus SE, 2.38%, 02/04/2024	100	0,02
200.000	EUR	Airbus SE, 1.63%, 07/04/2025	193	0,04
200.000	EUR	Airbus SE, 0.88%, 13/05/2026	185	0,04
200.000	EUR	Airbus SE, 1.38%, 09/06/2026	188	0,04
100.000	EUR	Airbus SE, 2.00%, 07/04/2028	93	0,02
150.000	EUR	Airbus SE, 2.13%, 29/10/2029	136	0,03
450.000	EUR	Airbus SE, 1.63%, 09/06/2030	389	0,08
200.000	EUR	Airbus SE, 2.38%, 07/04/2032	176	0,04
200.000	EUR	Airbus SE, 2.38%, 09/06/2040	151	0,03
100.000	EUR	Akelius Residential Property Financing BV, REIT, 1.00%, 17/01/2028	80	0,02
125.000	EUR	Akelius Residential Property Financing BV, REIT, 1.13%, 11/01/2029	97	0,02
100.000	EUR	Akelius Residential Property Financing BV, REIT, 0.75%, 22/02/2030	71	0,01
300.000	EUR	Akzo Nobel NV, 1.75%, 07/11/2024	294	0,06
100.000	EUR	Akzo Nobel NV, 1.50%, 28/03/2028	88	0,02
150.000	EUR	Akzo Nobel NV, 1.63%, 14/04/2030	124	0,03
100.000	EUR	Akzo Nobel NV, 2.00%, 28/03/2032	81	0,02
100.000	EUR	Alcon Finance BV, 2.38%, 31/05/2028	92	0,02
200.000	EUR	Allianz Finance II BV, 0.25%, 06/06/2023	197	0,04
200.000	EUR	Allianz Finance II BV, 0.88%, 15/01/2026	187	0,04
300.000	EUR	Allianz Finance II BV, 0.00%, 22/11/2026	264	0,06
200.000	EUR	Allianz Finance II BV, 3.00%, 13/03/2028	198	0,04
200.000	EUR	Allianz Finance II BV, 1.50%, 15/01/2030	175	0,04
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	84	0,02
200.000	EUR	Allianz Finance II BV, 0.50%, 22/11/2033	143	0,03
300.000	EUR	American Medical Systems Europe BV, 0.75%, 08/03/2025	282	0,06
200.000	EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.38%, 08/03/2028	177	0,04
200.000	EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.88%, 08/03/2034	159	0,03
100.000	EUR	ASML Holding NV, 3.38%, 19/09/2023	101	0,02
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	94	0,02
200.000	EUR	ASML Holding NV, 0.63%, 07/05/2029	168	0,03
125.000	EUR	ASML Holding NV, 0.25%, 25/02/2030	100	0,02
100.000	EUR	ASML Holding NV, 2.25%, 17/05/2032	90	0,02
150.000	EUR	ASR Nederland NV, FRN, 5.13%, 29/09/2045	146	0,03
100.000	EUR	ASR Nederland NV, FRN, 3.38%, 02/05/2049	83	0,02
100.000	EUR	Athora Netherlands NV, FRN, 2.25%, 15/07/2031	80	0,02
175.000	EUR	Athora Netherlands NV, FRN, 5.38%, 31/08/2032	159	0,03
100.000	EUR	BASF Finance Europe NV, 0.75%, 10/11/2026	91	0,02
100.000	EUR	Bayer Capital Corp. BV, 1.25%, 13/11/2023	98	0,02
300.000	EUR	Bayer Capital Corp. BV, 1.50%, 26/06/2026	276	0,06
300.000	EUR	Bayer Capital Corp. BV, 2.13%, 15/12/2029	258	0,05
200.000	EUR	BMW Finance NV, 0.38%, 10/07/2023	196	0,04
300.000	EUR	BMW Finance NV, 0.63%, 06/10/2023	293	0,06
300.000	EUR	BMW Finance NV, 2.63%, 17/01/2024	300	0,06
200.000	EUR	BMW Finance NV, 0.75%, 12/07/2024	193	0,04
250.000	EUR	BMW Finance NV, 1.00%, 14/11/2024	241	0,05
50.000	EUR	BMW Finance NV, 1.00%, 21/01/2025	48	0,01
125.000	EUR	BMW Finance NV, 0.50%, 22/02/2025	118	0,02
150.000	EUR	BMW Finance NV, 0.88%, 03/04/2025	143	0,03
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	226	0,05
100.000	EUR	BMW Finance NV, 1.13%, 22/05/2026	93	0,02
150.000	EUR	BMW Finance NV, 0.75%, 13/07/2026	138	0,03
150.000	EUR	BMW Finance NV, 0.38%, 14/01/2027	134	0,03
150.000	EUR	BMW Finance NV, 0.38%, 24/09/2027	131	0,03
100.000	EUR	BMW Finance NV, 1.13%, 10/01/2028	90	0,02
200.000	EUR	BMW Finance NV, 1.00%, 22/05/2028	176	0,04



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Paesi Bassi (continua)</b>				
250.000	EUR	BMW Finance NV, 1.50%, 06/02/2029	223	0,05
100.000	EUR	BMW Finance NV, 0.88%, 14/01/2032	78	0,02
100.000	EUR	BMW Finance NV, 0.20%, 11/01/2033	70	0,01
100.000	EUR	BP Capital Markets BV, 0.93%, 04/12/2040	57	0,01
100.000	EUR	BP Capital Markets BV, 1.47%, 21/09/2041	62	0,01
200.000	EUR	Brenntag Finance BV, 1.13%, 27/09/2025	184	0,04
100.000	EUR	CETIN Group NV, 3.13%, 14/04/2027	89	0,02
100.000	EUR	Citycon Treasury BV, REIT, 2.50%, 01/10/2024	95	0,02
100.000	EUR	Citycon Treasury BV, REIT, 1.25%, 08/09/2026	79	0,02
100.000	EUR	Citycon Treasury BV, REIT, 1.63%, 12/03/2028	75	0,02
100.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 1.88%, 11/11/2024	97	0,02
100.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 2.75%, 23/09/2025	99	0,02
150.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 1.00%, 14/05/2027	134	0,03
100.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 0.63%, 21/11/2029	79	0,02
100.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 1.63%, 14/05/2031	81	0,02
300.000	EUR	Coloplast Finance BV, 2.75%, 19/05/2030	277	0,06
200.000	EUR	Compass Group Finance Netherlands BV, 0.63%, 03/07/2024	192	0,04
100.000	EUR	Compass Group Finance Netherlands BV, 1.50%, 05/09/2028	89	0,02
100.000	EUR	Compass Group Finance Netherlands BV, 3.00%, 08/03/2030	95	0,02
100.000	EUR	Conti-Gummi Finance BV, 2.13%, 27/11/2023	99	0,02
25.000	EUR	Conti-Gummi Finance BV, 1.13%, 25/09/2024	24	—
400.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.63%, 27/02/2024	387	0,08
350.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 4.13%, 14/07/2025	361	0,08
360.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.25%, 23/03/2026	340	0,07
500.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.38%, 03/02/2027	464	0,10
300.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.13%, 07/05/2031	234	0,05
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.63%, 25/02/2033	140	0,03
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 0.38%, 01/12/2027	172	0,04
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 0.88%, 05/05/2028	173	0,04
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 3.88%, 30/11/2032	189	0,04
100.000	EUR	CRH Funding BV, 1.63%, 05/05/2030	83	0,02
150.000	EUR	CRH Funding BV, FRN, 1.88%, 09/01/2024	147	0,03
100.000	EUR	CTP NV, REIT, 0.63%, 27/11/2023	94	0,02
100.000	EUR	CTP NV, REIT, 0.50%, 21/06/2025	86	0,02
300.000	EUR	CTP NV, REIT, 0.88%, 20/01/2026	254	0,05
100.000	EUR	CTP NV, REIT, 0.63%, 27/09/2026	81	0,02
100.000	EUR	CTP NV, REIT, 1.25%, 21/06/2029	70	0,01
100.000	EUR	CTP NV, REIT, 1.50%, 27/09/2031	62	0,01
100.000	EUR	Daimler Truck International Finance BV, 1.25%, 06/04/2025	95	0,02
100.000	EUR	Daimler Truck International Finance BV, 1.63%, 06/04/2027	90	0,02
200.000	EUR	Danfoss Finance I BV, 0.38%, 28/10/2028	161	0,03
200.000	EUR	Danfoss Finance II BV, 0.75%, 28/04/2031	150	0,03
100.000	EUR	de Volksbank NV, 0.75%, 25/06/2023	99	0,02
200.000	EUR	de Volksbank NV, 0.01%, 16/09/2024	188	0,04
100.000	EUR	de Volksbank NV, 0.38%, 03/03/2028	80	0,02
200.000	EUR	de Volksbank NV, FRN, 2.38%, 04/05/2027	186	0,04
100.000	EUR	de Volksbank NV, FRN, 1.75%, 22/10/2030	89	0,02
200.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 0.88%, 30/01/2024	195	0,04
100.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 0.63%, 13/12/2024	95	0,02
400.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.38%, 01/12/2025	380	0,08
200.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.13%, 22/05/2026	186	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	149	0,03
400.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.50%, 03/04/2028	363	0,08
300.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 2.00%, 01/12/2029	272	0,06
100.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 4.50%, 28/10/2030	105	0,02
100.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, FRN, 7.50%, 24/01/2033	129	0,03
200.000	EUR	Diageo Capital BV, 0.13%, 28/09/2028	165	0,03
100.000	EUR	Diageo Capital BV, 1.50%, 08/06/2029	88	0,02
500.000	EUR	Diageo Capital BV, 1.88%, 08/06/2034	408	0,09

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Paesi Bassi (continua)</b>				
300.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 0.63%, 15/07/2025	269	0,06
200.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 1.50%, 15/03/2030	153	0,03
200.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 1.25%, 01/02/2031	144	0,03
100.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 1.00%, 15/01/2032	68	0,01
100.000	EUR	Digital Intrepid Holding BV, REIT, 0.63%, 15/07/2031	67	0,01
150.000	EUR	Digital Intrepid Holding BV, REIT, 1.38%, 18/07/2032	102	0,02
200.000	EUR	DSV Finance BV, 1.38%, 16/03/2030	166	0,03
100.000	EUR	DSV Finance BV, 0.50%, 03/03/2031	75	0,02
150.000	EUR	DSV Finance BV, 0.88%, 17/09/2036	94	0,02
100.000	EUR	E.ON International Finance BV, 3.00%, 17/01/2024	100	0,02
75.000	EUR	E.ON International Finance BV, 1.00%, 13/04/2025	71	0,01
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	156	0,03
280.000	EUR	E.ON International Finance BV, 1.50%, 31/07/2029	237	0,05
100.000	EUR	E.ON International Finance BV, 5.75%, 14/02/2033	110	0,02
250.000	EUR	easyJet FinCo. BV, 1.88%, 03/03/2028	194	0,04
100.000	EUR	EDP Finance BV, 1.88%, 29/09/2023	99	0,02
175.000	EUR	EDP Finance BV, 1.13%, 12/02/2024	171	0,04
150.000	EUR	EDP Finance BV, 2.00%, 22/04/2025	145	0,03
100.000	EUR	EDP Finance BV, 1.88%, 13/10/2025	96	0,02
150.000	EUR	EDP Finance BV, 1.63%, 26/01/2026	141	0,03
250.000	EUR	EDP Finance BV, 0.38%, 16/09/2026	222	0,05
300.000	EUR	EDP Finance BV, 1.88%, 21/09/2029	262	0,05
100.000	EUR	ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG, FRN, 3.38%, 29/09/2047	88	0,02
100.000	EUR	ELM BV for Swiss Life Insurance & Pension Group, FRN, 4.50%, 19/05/2027 <sup>1</sup>	91	0,02
400.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.00%, 17/06/2024	380	0,08
100.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.00%, 16/09/2024	96	0,02
200.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.97%, 27/01/2025	194	0,04
150.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.50%, 21/07/2025	142	0,03
100.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.25%, 17/11/2025	90	0,02
325.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.00%, 28/05/2026	281	0,06
300.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.38%, 01/06/2026	274	0,06
200.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.13%, 16/09/2026	181	0,04
150.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.00%, 17/06/2027	124	0,03
200.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.38%, 17/06/2027	169	0,04
100.000	EUR	Enel Finance International NV, 3.88%, 09/03/2029	96	0,02
200.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.38%, 28/05/2029	152	0,03
250.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.50%, 17/06/2030	184	0,04
100.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.88%, 17/01/2031	74	0,02
325.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.88%, 28/09/2034	205	0,04
200.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.13%, 17/10/2034	132	0,03
125.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.25%, 17/01/2035	82	0,02
250.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.88%, 17/06/2036	148	0,03
250.000	EUR	Essity Capital BV, 0.25%, 15/09/2029	193	0,04
200.000	EUR	Euronext NV, 0.13%, 17/05/2026	176	0,04
200.000	EUR	Euronext NV, 1.13%, 12/06/2029	165	0,03
100.000	EUR	Euronext NV, 0.75%, 17/05/2031	76	0,02
100.000	EUR	Euronext NV, 1.50%, 17/05/2041	60	0,01
140.000	EUR	EXOR NV, 2.50%, 08/10/2024	139	0,03
100.000	EUR	EXOR NV, 2.25%, 29/04/2030	86	0,02
100.000	EUR	EXOR NV, 0.88%, 19/01/2031	75	0,02
100.000	EUR	EXOR NV, 1.75%, 14/10/2034	71	0,01
200.000	EUR	Givaudan Finance Europe BV, 1.63%, 22/04/2032	165	0,03
200.000	EUR	Givaudan SA, 1.13%, 17/09/2025	189	0,04
200.000	EUR	Global Switch Finance BV, 1.38%, 07/10/2030	165	0,03
200.000	EUR	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV, 1.25%, 29/03/2026	184	0,04
150.000	EUR	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV, 1.75%, 29/03/2030	127	0,03
200.000	EUR	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV, 2.13%, 29/03/2034	157	0,03

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Paesi Bassi (continua)</b>				
200.000	EUR	H&M Finance BV, 0.25%, 25/08/2029	149	0,03
300.000	EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, REIT, 0.25%, 13/10/2024	271	0,06
300.000	EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, REIT, 0.63%, 24/07/2025	260	0,05
250.000	EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, REIT, 1.38%, 03/03/2027	206	0,04
125.000	EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, REIT, 1.00%, 13/04/2028	96	0,02
200.000	EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, REIT, 0.75%, 06/09/2029	138	0,03
125.000	EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, REIT, 1.63%, 13/10/2031	82	0,02
100.000	EUR	Heineken NV, 3.50%, 19/03/2024	101	0,02
150.000	EUR	Heineken NV, 1.63%, 30/03/2025	145	0,03
150.000	EUR	Heineken NV, 2.88%, 04/08/2025	149	0,03
200.000	EUR	Heineken NV, 1.00%, 04/05/2026	185	0,04
150.000	EUR	Heineken NV, 1.38%, 29/01/2027	138	0,03
100.000	EUR	Heineken NV, 1.25%, 17/03/2027	92	0,02
310.000	EUR	Heineken NV, 1.50%, 03/10/2029	271	0,06
150.000	EUR	Heineken NV, 2.25%, 30/03/2030	136	0,03
150.000	EUR	Heineken NV, 1.75%, 17/03/2031	130	0,03
100.000	EUR	Heineken NV, 1.25%, 07/05/2033	78	0,02
200.000	EUR	Heineken NV, 1.75%, 07/05/2040	138	0,03
100.000	EUR	Iberdrola International BV, 0.38%, 15/09/2025	93	0,02
300.000	EUR	Iberdrola International BV, 1.13%, 21/04/2026	282	0,06
100.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 2.63%, 26/12/2023 <sup>1</sup>	95	0,02
300.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 3.25%, 11/12/2024 <sup>1</sup>	283	0,06
300.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.87%, 28/01/2026 <sup>1</sup>	255	0,05
200.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.45%, 11/09/2026 <sup>1</sup>	162	0,03
300.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 2.25%, 28/01/2029 <sup>1</sup>	226	0,05
100.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.83%, 08/09/2029 <sup>1</sup>	72	0,01
100.000	EUR	IMCD NV, 2.13%, 31/03/2027	89	0,02
100.000	EUR	ING Groep NV, 1.00%, 20/09/2023	98	0,02
100.000	EUR	ING Groep NV, 1.13%, 14/02/2025	95	0,02
200.000	EUR	ING Groep NV, 2.13%, 10/01/2026	189	0,04
200.000	EUR	ING Groep NV, 1.38%, 11/01/2028	173	0,04
300.000	EUR	ING Groep NV, 2.00%, 20/09/2028	262	0,05
200.000	EUR	ING Groep NV, 2.50%, 15/11/2030	175	0,04
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.10%, 03/09/2025	186	0,04
400.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.13%, 29/11/2025	369	0,08
300.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 2.13%, 23/05/2026	285	0,06
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 1.25%, 16/02/2027	180	0,04
300.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.38%, 29/09/2028	244	0,05
100.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 2.50%, 15/02/2029	96	0,02
300.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.25%, 18/02/2029	237	0,05
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 1.62%, 26/09/2029	185	0,04
400.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.25%, 01/02/2030	302	0,06
100.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 2.00%, 22/03/2030	91	0,02
100.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 1.00%, 13/11/2030	86	0,02
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.88%, 29/11/2030	153	0,03
300.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 1.75%, 16/02/2031	243	0,05
400.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 2.13%, 26/05/2031	357	0,07
400.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 1.00%, 16/11/2032	316	0,07
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 4.13%, 24/08/2033	185	0,04
100.000	EUR	ISS Finance BV, 1.25%, 07/07/2025	94	0,02
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.75%, 25/05/2023	99	0,02
200.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.25%, 22/05/2024	191	0,04
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.63%, 30/04/2025	94	0,02
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.75%, 25/06/2026	91	0,02
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 2.50%, 17/04/2027	92	0,02
200.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.00%, 20/12/2027	166	0,03
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 2.00%, 18/05/2028	86	0,02
200.000	EUR	JAB Holdings BV, 2.50%, 25/06/2029	170	0,04
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.00%, 14/07/2031	70	0,01
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 4.75%, 29/06/2032	94	0,02



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Paesi Bassi (continua)</b>				
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 3.38%, 17/04/2035	78	0,02
200.000	EUR	JAB Holdings BV, 2.25%, 19/12/2039	121	0,03
100.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.24%, 16/01/2025	92	0,02
200.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.00%, 16/01/2026	174	0,04
100.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.63%, 09/02/2028	81	0,02
200.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.50%, 16/01/2029	152	0,03
100.000	EUR	JDE Peet's NV, 1.13%, 16/06/2033	66	0,01
100.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 0.88%, 19/09/2024	96	0,02
200.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 0.25%, 26/06/2025	185	0,04
100.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1.13%, 19/03/2026	93	0,02
200.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1.75%, 02/04/2027	185	0,04
100.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 0.38%, 18/03/2030	77	0,02
100.000	EUR	Koninklijke DSM NV, 1.00%, 09/04/2025	95	0,02
100.000	EUR	Koninklijke DSM NV, 0.25%, 23/06/2028	82	0,02
100.000	EUR	Koninklijke DSM NV, 0.63%, 23/06/2032	73	0,01
100.000	EUR	Koninklijke DSM NV, FRN, 2.38%, 03/04/2024	99	0,02
100.000	EUR	Koninklijke DSM NV, FRN, 0.75%, 28/09/2026	90	0,02
200.000	EUR	Koninklijke KPN NV, 0.63%, 09/04/2025	187	0,04
100.000	EUR	Koninklijke KPN NV, 1.13%, 11/09/2028	87	0,02
100.000	EUR	Koninklijke KPN NV, 0.88%, 14/12/2032	73	0,01
200.000	EUR	Koninklijke KPN NV, 0.88%, 15/11/2033	141	0,03
350.000	EUR	Koninklijke Philips NV, 0.50%, 22/05/2026	316	0,07
300.000	EUR	Koninklijke Philips NV, 1.88%, 05/05/2027	276	0,06
100.000	EUR	Koninklijke Philips NV, 1.38%, 02/05/2028	87	0,02
100.000	EUR	Koninklijke Philips NV, 2.13%, 05/11/2029	88	0,02
100.000	EUR	Koninklijke Philips NV, 2.00%, 30/03/2030	86	0,02
100.000	EUR	Koninklijke Philips NV, 2.63%, 05/05/2033	85	0,02
200.000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 1.00%, 02/05/2023	198	0,04
150.000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 0.13%, 13/09/2023	145	0,03
100.000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 3.50%, 09/04/2025	98	0,02
100.000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 2.13%, 06/05/2025	95	0,02
125.000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 0.25%, 23/02/2026	109	0,02
250.000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 0.25%, 07/09/2026	212	0,04
100.000	EUR	Linde Finance BV, 1.88%, 22/05/2024	99	0,02
100.000	EUR	Linde Finance BV, 0.25%, 19/05/2027	87	0,02
150.000	EUR	Linde Finance BV, 1.00%, 20/04/2028	134	0,03
100.000	EUR	Linde Finance BV, 0.55%, 19/05/2032	74	0,02
200.000	EUR	Louis Dreyfus Co. Finance BV, 2.38%, 27/11/2025	189	0,04
100.000	EUR	Louis Dreyfus Co. Finance BV, 1.63%, 28/04/2028	81	0,02
100.000	EUR	Lseg Netherlands BV, 0.00%, 06/04/2025	92	0,02
100.000	EUR	Lseg Netherlands BV, 0.25%, 06/04/2028	83	0,02
100.000	EUR	Lseg Netherlands BV, 0.75%, 06/04/2033	72	0,01
100.000	EUR	LYB International Finance II BV, 0.88%, 17/09/2026	87	0,02
100.000	EUR	LYB International Finance II BV, 1.63%, 17/09/2031	78	0,02
150.000	EUR	Madrilena Red de Gas Finance BV, 2.25%, 11/04/2029	123	0,03
400.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.25%, 06/11/2023	389	0,08
100.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.00%, 08/02/2024	96	0,02
200.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.88%, 09/04/2024	194	0,04
150.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.85%, 28/02/2025	143	0,03
350.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 2.63%, 07/04/2025	347	0,07
250.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.00%, 11/11/2025	235	0,05
500.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.50%, 09/03/2026	474	0,10
300.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.38%, 26/06/2026	281	0,06
225.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 2.00%, 22/08/2026	216	0,05
150.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.38%, 08/11/2026	134	0,03
25.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.50%, 09/02/2027	23	–
300.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.63%, 06/05/2027	266	0,06
200.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.00%, 22/09/2026	174	0,04
100.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.25%, 09/09/2029	78	0,02
200.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.38%, 22/09/2029	158	0,03

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Paesi Bassi (continua)</b>				
100.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.88%, 01/10/2031	77	0,02
200.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.63%, 09/09/2032	146	0,03
250.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 1.25%, 09/09/2041	151	0,03
100.000	EUR	Nationale-Nederlanden Bank NV (The) Netherlands, 0.50%, 21/09/2028	80	0,02
200.000	EUR	Naturgy Finance BV, 2.88%, 11/03/2024	198	0,04
100.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.38%, 21/01/2025	95	0,02
100.000	EUR	Naturgy Finance BV, 0.88%, 15/05/2025	93	0,02
300.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.25%, 15/01/2026	275	0,06
100.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.25%, 19/04/2026	91	0,02
300.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.38%, 19/01/2027	269	0,06
100.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.50%, 29/01/2028	88	0,02
200.000	EUR	Naturgy Finance BV, 0.75%, 28/11/2029	158	0,03
200.000	EUR	NE Property BV, REIT, 1.75%, 23/11/2024	184	0,04
100.000	EUR	NE Property BV, REIT, 3.38%, 14/07/2027	85	0,02
100.000	EUR	NE Property BV, REIT, 2.00%, 20/01/2030	70	0,01
100.000	EUR	NE Property BV, REIT, FRN, 1.88%, 09/10/2026	82	0,02
150.000	EUR	NIBC Bank NV, 1.13%, 19/04/2023	149	0,03
100.000	EUR	NIBC Bank NV, 0.88%, 08/07/2025	91	0,02
100.000	EUR	NIBC Bank NV, 0.25%, 09/09/2026	83	0,02
200.000	EUR	NIBC Bank NV, 0.88%, 24/06/2027	163	0,03
200.000	EUR	NN Group NV, 1.63%, 01/06/2027	182	0,04
200.000	EUR	NN Group NV, 0.88%, 23/11/2031	149	0,03
200.000	EUR	NN Group NV, FRN, 4.38%, 13/06/2024 <sup>1</sup>	190	0,04
200.000	EUR	NN Group NV, FRN, 4.50%, 15/01/2026 <sup>1</sup>	186	0,04
100.000	EUR	NN Group NV, FRN, 5.25%, 01/03/2043	91	0,02
250.000	EUR	NN Group NV, FRN, 4.62%, 08/04/2044	242	0,05
100.000	EUR	NN Group NV, FRN, 4.62%, 13/01/2048	91	0,02
200.000	EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 0.00%, 04/06/2024	192	0,04
200.000	EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 1.13%, 30/09/2027	181	0,04
100.000	EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 0.13%, 04/06/2028	84	0,02
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	88	0,02
150.000	EUR	PostNL NV, 0.63%, 23/09/2026	134	0,03
100.000	EUR	Prosus NV, 1.21%, 19/01/2026	84	0,02
125.000	EUR	Prosus NV, 1.54%, 03/08/2028	95	0,02
100.000	EUR	Prosus NV, 1.29%, 13/07/2029	70	0,01
350.000	EUR	Prosus NV, 2.03%, 03/08/2032	225	0,05
200.000	EUR	Prosus NV, 1.99%, 13/07/2033	123	0,03
100.000	EUR	Prosus NV, 2.78%, 19/01/2034	69	0,01
200.000	EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV, 0.38%, 19/05/2026	181	0,04
200.000	EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV, 0.75%, 19/05/2030	163	0,03
100.000	EUR	Redexis Gas Finance BV, 1.88%, 28/05/2025	94	0,02
100.000	EUR	Redexis Gas Finance BV, 1.88%, 27/04/2027	89	0,02
200.000	EUR	RELX Finance BV, 0.00%, 18/03/2024	191	0,04
150.000	EUR	RELX Finance BV, 1.50%, 13/05/2027	138	0,03
200.000	EUR	RELX Finance BV, 0.50%, 10/03/2028	169	0,04
100.000	EUR	RELX Finance BV, 0.88%, 10/03/2032	76	0,02
200.000	EUR	Ren Finance BV, 1.75%, 01/06/2023	198	0,04
100.000	EUR	Ren Finance BV, 0.50%, 16/04/2029	79	0,02
100.000	EUR	Rentokil Initial Finance BV, 3.88%, 27/06/2027	98	0,02
200.000	EUR	Rentokil Initial Finance BV, 4.38%, 27/06/2030	198	0,04
200.000	EUR	Repsol International Finance BV, 0.13%, 05/10/2024	190	0,04
200.000	EUR	Repsol International Finance BV, 2.00%, 15/12/2025	194	0,04
100.000	EUR	Repsol International Finance BV, 2.25%, 10/12/2026	96	0,02
100.000	EUR	Repsol International Finance BV, 0.25%, 02/08/2027	87	0,02
100.000	EUR	Repsol International Finance BV, 2.63%, 15/04/2030	93	0,02
100.000	EUR	Robert Bosch Investment Nederland BV, 2.63%, 24/05/2028	96	0,02
300.000	EUR	Roche Finance Europe BV, 0.88%, 25/02/2025	289	0,06
225.000	EUR	Sagax Euro Mtn NL BV, REIT, 1.00%, 17/05/2029	151	0,03
100.000	EUR	Schlumberger Finance BV, 0.00%, 15/10/2024	94	0,02

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Paesi Bassi (continua)</b>				
350.000	EUR	Schlumberger Finance BV, 1.38%, 28/10/2026	325	0,07
100.000	EUR	Schlumberger Finance BV, 0.25%, 15/10/2027	86	0,02
100.000	EUR	Schlumberger Finance BV, 0.50%, 15/10/2031	75	0,02
200.000	EUR	Schlumberger Finance BV, 2.00%, 06/05/2032	171	0,04
300.000	EUR	SGS Nederland Holding BV, 0.13%, 21/04/2027	254	0,05
200.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.13%, 07/04/2024	195	0,04
150.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.75%, 12/05/2024	145	0,03
200.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.38%, 15/02/2025	188	0,04
300.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.88%, 15/09/2025	291	0,06
100.000	EUR	Shell International Finance BV, 2.50%, 24/03/2026	98	0,02
200.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.63%, 20/01/2027	188	0,04
100.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.13%, 08/11/2027	86	0,02
200.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.50%, 07/04/2028	182	0,04
400.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.25%, 12/05/2028	358	0,08
125.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.75%, 15/08/2028	108	0,02
225.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.50%, 08/11/2031	171	0,04
200.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.88%, 07/04/2032	171	0,04
400.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.25%, 11/11/2032	317	0,07
250.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.88%, 08/11/2039	152	0,03
75.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.30%, 28/02/2024	73	0,01
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.25%, 05/06/2024	192	0,04
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.00%, 05/09/2024	95	0,02
300.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.25%, 10/03/2025	295	0,06
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.00%, 20/02/2026	181	0,04
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.38%, 05/06/2026	181	0,04
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.63%, 25/02/2027	90	0,02
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.00%, 06/09/2027	91	0,02
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.50%, 08/09/2027	97	0,02
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.90%, 28/02/2028	88	0,02
250.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.88%, 10/03/2028	245	0,05
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.25%, 20/02/2029	164	0,03
175.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.13%, 05/09/2029	140	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	173	0,04
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.75%, 09/09/2030	189	0,04
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.25%, 28/02/2031	167	0,03
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.50%, 20/02/2032	76	0,02
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.00%, 08/09/2033	188	0,04
150.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.50%, 05/09/2034	104	0,02
300.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.25%, 25/02/2035	225	0,05
150.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.75%, 28/02/2039	112	0,02
200.000	EUR	Signify NV, 2.00%, 11/05/2024	195	0,04
100.000	EUR	Signify NV, 2.38%, 11/05/2027	91	0,02
100.000	EUR	Sika Capital BV, 0.88%, 29/04/2027	88	0,02
100.000	EUR	Sika Capital BV, 1.50%, 29/04/2031	81	0,02
100.000	EUR	Stellantis NV, 2.00%, 23/03/2024	98	0,02
300.000	EUR	Stellantis NV, 3.75%, 29/03/2024	301	0,06
100.000	EUR	Stellantis NV, 2.00%, 20/03/2025	96	0,02
300.000	EUR	Stellantis NV, 3.88%, 05/01/2026	298	0,06
300.000	EUR	Stellantis NV, 2.75%, 15/05/2026	285	0,06
200.000	EUR	Stellantis NV, 0.63%, 30/03/2027	170	0,04
250.000	EUR	Stellantis NV, 4.50%, 07/07/2028	246	0,05
300.000	EUR	Stellantis NV, 0.75%, 18/01/2029	234	0,05
100.000	EUR	Stellantis NV, 1.13%, 18/09/2029	82	0,02
200.000	EUR	Stellantis NV, 2.75%, 01/04/2032	163	0,03
275.000	EUR	Stellantis NV, 1.25%, 20/06/2033	184	0,04
100.000	EUR	STG Global Finance BV, 1.38%, 24/09/2025	92	0,02
50.000	EUR	Sudzucker International Finance BV, 1.25%, 29/11/2023	49	0,01
150.000	EUR	Sudzucker International Finance BV, 1.00%, 28/11/2025	138	0,03
200.000	EUR	Swiss Life AG, FRN, 4.38%, 16/06/2025 <sup>1</sup>	187	0,04

NM1222U-2615757-89/212

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Paesi Bassi (continua)</b>				
200.000	EUR	Swiss Reinsurance Co. Ltd., FRN, 2.60%, 09/01/2025 <sup>1</sup>	181	0,04
100.000	EUR	Technip Energies NV, 1.13%, 28/05/2028	78	0,02
100.000	EUR	Telefonica Europe BV, 5.88%, 14/02/2033	111	0,02
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.00%, 18/11/2023	97	0,02
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.00%, 18/11/2025	91	0,02
550.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.80%, 18/10/2030	443	0,09
350.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 1.13%, 18/10/2033	266	0,06
300.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 1.63%, 18/10/2041	199	0,04
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 2.00%, 18/10/2051	63	0,01
150.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 0.63%, 26/09/2023	147	0,03
200.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 0.00%, 27/10/2025	181	0,04
125.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 0.50%, 12/08/2023	123	0,03
200.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 0.50%, 29/04/2024	194	0,04
100.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.25%, 25/03/2025	96	0,02
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	139	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	138	0,03
100.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.38%, 31/07/2029	88	0,02
200.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.75%, 25/03/2030	179	0,04
100.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.38%, 04/09/2030	87	0,02
300.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.25%, 28/02/2031	254	0,05
200.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.63%, 12/02/2033	166	0,03
150.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 2.25%, 16/05/2034	131	0,03
100.000	EUR	Universal Music Group NV, 3.00%, 30/06/2027	96	0,02
100.000	EUR	Universal Music Group NV, 3.75%, 30/06/2032	94	0,02
150.000	EUR	Upjohn Finance BV, 1.02%, 23/06/2024	143	0,03
200.000	EUR	Upjohn Finance BV, 1.36%, 23/06/2027	169	0,04
250.000	EUR	Upjohn Finance BV, 1.91%, 23/06/2032	177	0,04
200.000	EUR	Vestas Wind Systems Finance BV, 2.00%, 15/06/2034	157	0,03
200.000	EUR	Vesteda Finance BV, REIT, 2.00%, 10/07/2026	187	0,04
200.000	EUR	Vesteda Finance BV, REIT, 0.75%, 18/10/2031	147	0,03
150.000	EUR	VIA Outlets BV, REIT, 1.75%, 15/11/2028	114	0,02
150.000	EUR	Viterra Finance BV, 0.38%, 24/09/2025	130	0,03
150.000	EUR	Viterra Finance BV, 1.00%, 24/09/2028	113	0,02
500.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.13%, 02/10/2023	489	0,10
100.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.13%, 28/03/2025	98	0,02
400.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.88%, 30/03/2027	362	0,08
200.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.75%, 28/09/2027	196	0,04
200.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 2.63%, 16/11/2027	186	0,04
300.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 0.88%, 22/09/2028	247	0,05
200.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.63%, 16/01/2030	168	0,04
100.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.25%, 18/11/2030	91	0,02
200.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.25%, 23/09/2032	152	0,03
100.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.30%, 22/03/2033	88	0,02
300.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 4.13%, 16/11/2038	273	0,06
100.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.50%, 21/01/2041	60	0,01
200.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 3.38%, 27/06/2024 <sup>1</sup>	188	0,04
400.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 3.50%, 17/06/2025 <sup>1</sup>	364	0,08
300.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 4.62%, 24/03/2026 <sup>1</sup>	281	0,06
400.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 3.88%, 14/06/2027 <sup>1</sup>	344	0,07
200.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 3.75%, 28/12/2027 <sup>1</sup>	169	0,04
300.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 4.62%, 27/06/2028 <sup>1</sup>	261	0,05
300.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 3.88%, 17/06/2029 <sup>1</sup>	243	0,05
330.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 3.50%, 20/03/2030 <sup>1</sup>	262	0,06
300.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 4.38%, 28/03/2031 <sup>1</sup>	235	0,05
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 0.13%, 06/04/2023	98	0,02
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 2.25%, 15/12/2023	98	0,02



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Paesi Bassi (continua)</b>				
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 0.75%, 15/01/2024	97	0,02
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.63%, 07/04/2024	97	0,02
400.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.25%, 06/12/2024	378	0,08
200.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.80%, 29/06/2025	187	0,04
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.13%, 08/09/2025	91	0,02
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.50%, 22/03/2026	90	0,02
200.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.50%, 10/06/2026	179	0,04
200.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 0.63%, 09/07/2026	173	0,04
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 0.63%, 07/10/2027	82	0,02
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.50%, 14/01/2028	85	0,02
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 0.50%, 14/09/2029	74	0,02
400.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 2.25%, 07/04/2030	327	0,07
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.00%, 09/07/2030	73	0,01
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.13%, 14/09/2034	62	0,01
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.63%, 07/10/2039	56	0,01
100.000	EUR	Vonovia Finance BV, REIT, 1.00%, 28/01/2041	49	0,01
100.000	EUR	Wabtec Transportation Netherlands BV, 1.25%, 03/12/2027	81	0,02
200.000	EUR	Wintershall Dea Finance BV, 0.84%, 25/09/2025	181	0,04
200.000	EUR	Wintershall Dea Finance BV, 1.33%, 25/09/2028	163	0,03
200.000	EUR	Wintershall Dea Finance BV, 1.82%, 25/09/2031	150	0,03
200.000	EUR	Wizz Air Finance Co. BV, 1.35%, 19/01/2024	186	0,04
100.000	EUR	Wizz Air Finance Co. BV, 1.00%, 19/01/2026	80	0,02
200.000	EUR	Wolters Kluwer NV, 1.50%, 22/03/2027	184	0,04
100.000	EUR	Wolters Kluwer NV, 0.75%, 03/07/2030	79	0,02
100.000	EUR	WPC Eurobond BV, REIT, 2.25%, 19/07/2024	96	0,02
150.000	EUR	WPC Eurobond BV, REIT, 2.25%, 09/04/2026	138	0,03
100.000	EUR	WPC Eurobond BV, REIT, 2.13%, 15/04/2027	89	0,02
100.000	EUR	WPC Eurobond BV, REIT, 1.35%, 15/04/2028	82	0,02
100.000	EUR	WPC Eurobond BV, REIT, 0.95%, 01/06/2030	71	0,01
200.000	EUR	Wurth Finance International BV, 1.00%, 26/05/2025	188	0,04
75.000	EUR	Wurth Finance International BV, 0.75%, 22/11/2027	65	0,01
100.000	EUR	Wurth Finance International BV, 2.13%, 23/08/2030	87	0,02
200.000	EUR	Zurich Insurance Co. Ltd., FRN, 3.50%, 01/10/2046	188	0,04
100.000	EUR	Zurich Insurance Co. Ltd., FRN, 2.75%, 19/02/2049	85	0,02
<b>Paesi Bassi - Totale</b>			<b>81.971</b>	<b>17,38</b>
<b>Nuova Zelanda (31 marzo 2022: 0,37%)</b>				
200.000	EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd., 1.13%, 20/03/2025	190	0,04
200.000	EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd., 0.38%, 17/09/2029	155	0,03
100.000	EUR	ASB Finance Ltd., 0.75%, 13/03/2024	97	0,02
100.000	EUR	ASB Finance Ltd., 0.25%, 08/09/2028	80	0,02
100.000	EUR	ASB Finance Ltd., 0.50%, 24/09/2029	78	0,02
200.000	EUR	BNZ International Funding Ltd., 0.50%, 13/05/2023	198	0,04
100.000	EUR	BNZ International Funding Ltd., 0.38%, 14/09/2024	95	0,02
200.000	EUR	Chorus Ltd., FRN, 0.88%, 05/12/2026	178	0,04
100.000	EUR	Chorus Ltd., FRN, 3.63%, 07/09/2029	97	0,02
150.000	EUR	Fonterra Co-operative Group Ltd., 0.75%, 08/11/2024	143	0,03
150.000	EUR	Westpac Securities NZ Ltd., 1.10%, 24/03/2026	137	0,03
300.000	EUR	Westpac Securities NZ Ltd., 0.43%, 14/12/2026	261	0,05
100.000	EUR	Westpac Securities NZ Ltd., 0.10%, 13/07/2027	83	0,02
<b>Nuova Zelanda - Totale</b>			<b>1.792</b>	<b>0,38</b>
<b>Norvegia (31 marzo 2022: 0,60%)</b>				
200.000	EUR	Aker BP ASA, 1.13%, 12/05/2029	160	0,03
100.000	EUR	DNB Bank ASA, 0.60%, 25/09/2023	98	0,02
400.000	EUR	DNB Bank ASA, 0.05%, 14/11/2023	387	0,08
100.000	EUR	DNB Bank ASA, 0.25%, 09/04/2024	96	0,02
219.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 1.62%, 31/05/2026	209	0,04
100.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 3.12%, 21/09/2027	98	0,02

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Norvegia (continua)</b>				
375.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 0.38%, 18/01/2028	326	0,07
100.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 0.25%, 23/02/2029	81	0,02
100.000	EUR	Norsk Hydro ASA, 2.00%, 11/04/2029	82	0,02
100.000	EUR	Santander Consumer Bank A/S, 0.13%, 11/09/2024	94	0,02
100.000	EUR	Santander Consumer Bank A/S, 0.50%, 11/08/2025	91	0,02
100.000	EUR	Santander Consumer Bank A/S, 0.13%, 14/04/2026	88	0,02
100.000	EUR	Sparebank 1 Oestlandet, 0.25%, 30/09/2024	94	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	82	0,02
150.000	EUR	SpareBank 1 SMN, 0.13%, 11/09/2026	131	0,03
100.000	EUR	SpareBank 1 SMN, 0.01%, 18/02/2028	81	0,01
240.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 0.63%, 25/03/2024	231	0,05
100.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 2.88%, 20/09/2025	98	0,02
100.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 0.25%, 09/11/2026	87	0,02
100.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, FRN, 0.38%, 15/07/2027	87	0,02
100.000	EUR	Storebrand Livsforsikring A/S, FRN, 1.88%, 30/09/2051	70	0,01
<b>Norvegia - Totale</b>			<b>2.863</b>	<b>0,60</b>
<b>Polonia (31 marzo 2022: 0,08%)</b>				
200.000	EUR	mBank SA, FRN, 0.97%, 21/09/2027	152	0,03
250.000	EUR	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA, 1.13%, 27/05/2028	194	0,04
<b>Polonia - Totale</b>			<b>346</b>	<b>0,07</b>
<b>Portogallo (31 marzo 2022: 0,12%)</b>				
200.000	EUR	Cia de Seguros Fidelidade SA, FRN, 4.25%, 04/09/2031	164	0,03
100.000	EUR	EDP - Energias de Portugal SA, 2.38%, 27/11/2023	99	0,02
100.000	EUR	EDP - Energias de Portugal SA, 2.88%, 01/06/2026	97	0,02
100.000	EUR	EDP - Energias de Portugal SA, 1.63%, 15/04/2027	91	0,02
<b>Portogallo - Totale</b>			<b>451</b>	<b>0,09</b>
<b>Singapore (31 marzo 2022: 0,05%)</b>				
150.000	EUR	CapitalLand Ascendas REIT, 0.75%, 23/06/2028	115	0,02
<b>Singapore - Totale</b>			<b>115</b>	<b>0,02</b>
<b>Slovacchia (31 marzo 2022: 0,00%)</b>				
100.000	EUR	Tatra Banka as, FRN, 0.50%, 23/04/2028	76	0,02
<b>Slovacchia - Totale</b>			<b>76</b>	<b>0,02</b>
<b>Corea del Sud (31 marzo 2022: 0,04%)</b>				
100.000	EUR	Shinhan Bank Co. Ltd., 0.25%, 16/10/2024	94	0,02
<b>Corea del Sud - Totale</b>			<b>94</b>	<b>0,02</b>
<b>Spagna (31 marzo 2022: 4,91%)</b>				
100.000	EUR	Abanca Corp. Bancaria SA, FRN, 0.50%, 08/09/2027	82	0,02
100.000	EUR	Abanca Corp. Bancaria SA, FRN, 5.25%, 14/09/2028	98	0,02
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 3.75%, 20/06/2023	201	0,04
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 0.63%, 15/07/2025	92	0,02
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.38%, 20/05/2026	183	0,04
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.00%, 27/02/2027	87	0,02
300.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 2.38%, 27/09/2027	275	0,06
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.25%, 07/02/2028	84	0,02
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.13%, 26/03/2028	167	0,03
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 2.25%, 29/03/2029	172	0,04
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.63%, 15/07/2029	82	0,02
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 3.00%, 27/03/2031	174	0,04
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.88%, 26/03/2032	78	0,02
200.000	EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 0.38%, 07/10/2027	169	0,04
200.000	EUR	ACS Servicios Comunicaciones y Energia SA, 1.88%, 20/04/2026	183	0,04

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Spagna (continua)</b>				
100.000	EUR	Amadeus IT Group SA, 0.88%, 18/09/2023	98	0,02
100.000	EUR	Amadeus IT Group SA, 2.50%, 20/05/2024	99	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	95	0,02
200.000	EUR	Amadeus IT Group SA, 1.88%, 24/09/2028	174	0,04
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.13%, 28/02/2024	194	0,04
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.38%, 02/10/2024	189	0,04
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.38%, 14/05/2025	189	0,04
100.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.75%, 04/06/2025	94	0,02
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.75%, 26/11/2025	189	0,04
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.00%, 21/06/2026	270	0,06
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.38%, 15/11/2026	260	0,05
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.50%, 14/01/2027	171	0,04
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 3.50%, 10/02/2027	188	0,04
100.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 3.38%, 20/09/2027	97	0,02
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 0.13%, 24/03/2027	263	0,05
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 0.88%, 14/01/2029	163	0,03
100.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 2.57%, 22/02/2029	96	0,02
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 1.00%, 16/01/2030	265	0,06
300.000	EUR	Banco de Sabadell SA, 0.88%, 22/07/2025	272	0,06
100.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 0.63%, 07/11/2025	92	0,02
200.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 1.12%, 11/03/2027	178	0,04
300.000	EUR	Banco Santander SA, 0.25%, 19/06/2024	286	0,06
300.000	EUR	Banco Santander SA, 1.13%, 17/01/2025	283	0,06
400.000	EUR	Banco Santander SA, 2.50%, 18/03/2025	381	0,08
200.000	EUR	Banco Santander SA, 1.38%, 05/01/2026	183	0,04
200.000	EUR	Banco Santander SA, 3.25%, 04/04/2026	189	0,04
100.000	EUR	Banco Santander SA, 0.30%, 04/10/2026	87	0,02
200.000	EUR	Banco Santander SA, 3.13%, 19/01/2027	184	0,04
300.000	EUR	Banco Santander SA, 0.50%, 04/02/2027	254	0,05
300.000	EUR	Banco Santander SA, 1.13%, 23/06/2027	261	0,05
300.000	EUR	Banco Santander SA, 2.13%, 08/02/2028	256	0,05
300.000	EUR	Banco Santander SA, 0.20%, 11/02/2028	244	0,05
200.000	EUR	Banco Santander SA, 1.63%, 22/10/2030	146	0,03
200.000	EUR	Banco Santander SA, 1.00%, 04/11/2031	146	0,03
300.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 0.10%, 26/01/2025	287	0,06
100.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 3.63%, 27/09/2026	99	0,02
300.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 0.50%, 24/03/2027	263	0,06
200.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 0.63%, 24/06/2029	161	0,03
200.000	EUR	Bankinter SA, 0.88%, 08/07/2026	174	0,04
200.000	EUR	Bankinter SA, 0.63%, 06/10/2027	163	0,03
100.000	EUR	Bankinter SA, FRN, 1.25%, 23/12/2032	77	0,02
100.000	EUR	CaixaBank SA, 0.75%, 18/04/2023	99	0,02
200.000	EUR	CaixaBank SA, 1.75%, 24/10/2023	197	0,04
300.000	EUR	CaixaBank SA, 2.38%, 01/02/2024	295	0,06
400.000	EUR	CaixaBank SA, 1.13%, 17/05/2024	386	0,08
100.000	EUR	CaixaBank SA, 1.00%, 25/06/2024	96	0,02
100.000	EUR	CaixaBank SA, 0.63%, 01/10/2024	94	0,02
200.000	EUR	CaixaBank SA, 0.38%, 03/02/2025	186	0,04
200.000	EUR	CaixaBank SA, 1.13%, 27/03/2026	180	0,04
300.000	EUR	CaixaBank SA, 1.38%, 19/06/2026	265	0,06
200.000	EUR	CaixaBank SA, 0.75%, 09/07/2026	175	0,04
200.000	EUR	CaixaBank SA, 1.13%, 12/11/2026	173	0,04
200.000	EUR	CaixaBank SA, 3.75%, 07/09/2029	192	0,04
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 1.62%, 13/04/2026	185	0,04
300.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.75%, 10/07/2026	273	0,06
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.38%, 18/11/2026	175	0,04
300.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.63%, 21/01/2028	257	0,05
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.75%, 26/05/2028	165	0,03
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.50%, 09/02/2029	158	0,03



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Spagna (continua)</b>				
100.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 3.75%, 15/02/2029	97	0,02
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 2.25%, 17/04/2030	179	0,04
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 1.25%, 18/06/2031	165	0,03
100.000	EUR	Criteria Caixa SA, 1.50%, 10/05/2023	99	0,02
100.000	EUR	Criteria Caixa SA, 1.38%, 10/04/2024	97	0,02
100.000	EUR	Criteria Caixa SA, 0.88%, 28/10/2027	84	0,02
200.000	EUR	Enagas Financiaciones SA, 1.25%, 06/02/2025	190	0,04
100.000	EUR	Enagas Financiaciones SA, 0.75%, 27/10/2026	89	0,02
100.000	EUR	Enagas Financiaciones SA, 1.38%, 05/05/2028	88	0,02
100.000	EUR	Enagas Financiaciones SA, 0.38%, 05/11/2032	70	0,01
200.000	EUR	FCC Aqualia SA, 2.63%, 08/06/2027	181	0,04
200.000	EUR	FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU, 0.82%, 04/12/2023	194	0,04
100.000	EUR	FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU, 1.66%, 04/12/2026	90	0,02
100.000	EUR	Ferrovial Emisiones SA, 2.50%, 15/07/2024	99	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	93	0,02
100.000	EUR	Ferrovial Emisiones SA, 0.54%, 12/11/2028	80	0,02
200.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.00%, 07/03/2024	196	0,04
100.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.00%, 07/03/2025	96	0,02
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, 1.62%, 29/11/2029	90	0,02
300.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.38%, 11/03/2032	246	0,05
300.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, FRN, 1.58%, 16/11/20271	231	0,05
100.000	EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, REIT, 1.35%, 14/10/2028	83	0,02
200.000	EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, REIT, 0.75%, 22/06/2029	153	0,03
300.000	EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, REIT, FRN, 1.63%, 28/11/2025	279	0,06
100.000	EUR	Kutxabank SA, 0.50%, 25/09/2024	94	0,02
100.000	EUR	Kutxabank SA, FRN, 0.50%, 14/10/2027	85	0,02
100.000	EUR	Lar Espana Real Estate Socimi SA, REIT, 1.75%, 22/07/2026	80	0,02
100.000	EUR	Lar Espana Real Estate Socimi SA, REIT, 1.84%, 03/11/2028	71	0,01
100.000	EUR	Mapfre SA, 1.63%, 19/05/2026	93	0,02
100.000	EUR	Mapfre SA, 2.88%, 13/04/2030	82	0,02
100.000	EUR	Mapfre SA, FRN, 4.38%, 31/03/2047	91	0,02
100.000	EUR	Mapfre SA, FRN, 4.13%, 07/09/2048	88	0,02
200.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 1.75%, 26/05/2025	187	0,04
150.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 1.88%, 02/11/2026	135	0,03
200.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 2.38%, 13/07/2027	179	0,04
100.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 1.38%, 01/06/2030	75	0,02
100.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 1.88%, 04/12/2034	67	0,01
100.000	EUR	Naturgy Capital Markets SA, 1.13%, 11/04/2024	96	0,02
100.000	EUR	NorteGas Energia Distribucion SA, 0.91%, 22/01/2031	72	0,01
150.000	EUR	NorteGas Energia Distribucion SA, FRN, 2.07%, 28/09/2027	134	0,03
100.000	EUR	Prosegur Cash SA, 1.38%, 04/02/2026	91	0,02
100.000	EUR	Prosegur Cia de Seguridad SA, 2.50%, 06/04/2029	81	0,02
100.000	EUR	Red Electrica Corp. SA, 0.88%, 14/04/2025	95	0,02
100.000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 1.00%, 21/04/2026	93	0,02
100.000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 1.25%, 13/03/2027	92	0,02
300.000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 0.38%, 24/07/2028	258	0,05
100.000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 0.50%, 24/05/2033	74	0,01
100.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.88%, 30/05/2023	99	0,02
100.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 1.13%, 09/10/2023	98	0,02
200.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 1.00%, 27/02/2024	194	0,04
200.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.38%, 27/06/2024	190	0,04
200.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.38%, 17/01/2025	186	0,04
100.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.00%, 23/02/2026	88	0,02
100.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.50%, 14/11/2026	87	0,02
200.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.50%, 14/01/2027	173	0,04
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.07%, 05/02/2024	196	0,04

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Spagna (continua)</b>				
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.50%, 11/09/2025	190	0,04
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.46%, 13/04/2026	187	0,04
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.45%, 22/01/2027	184	0,04
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.20%, 21/08/2027	179	0,04
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.72%, 12/01/2028	181	0,04
300.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.32%, 17/10/2028	277	0,06
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.79%, 12/03/2029	177	0,04
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.93%, 17/10/2029	188	0,04
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 0.66%, 03/02/2030	159	0,03
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.59%, 25/05/2031	179	0,04
300.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.93%, 17/10/2031	250	0,05
100.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.81%, 21/05/2032	81	0,02
100.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.96%, 01/07/2039	70	0,01
100.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.86%, 13/07/2040	67	0,01
100.000	EUR	Unicaja Banco SA, FRN, 4.50%, 30/06/2025	99	0,02
200.000	EUR	Unicaja Banco SA, FRN, 1.00%, 01/12/2026	174	0,04
200.000	EUR	Werfenlife SA, 0.50%, 28/10/2026	174	0,04
<b>Spagna - Totale</b>			<b>23.904</b>	<b>5,07</b>
<b>Svezia (31 marzo 2022: 2,33%)</b>				
100.000	EUR	Akelius Residential Property AB, REIT, 1.13%, 14/03/2024	96	0,02
100.000	EUR	Akelius Residential Property AB, REIT, FRN, 1.75%, 07/02/2025	94	0,02
100.000	EUR	Alfa Laval Treasury International AB, 0.25%, 25/06/2024	95	0,02
200.000	EUR	Alfa Laval Treasury International AB, 1.38%, 18/02/2029	168	0,04
200.000	EUR	Atlas Copco AB, 0.63%, 30/08/2026	181	0,04
100.000	EUR	Castellum AB, REIT, 0.75%, 04/09/2026	78	0,02
100.000	EUR	Electrolux AB, 4.13%, 05/10/2026	100	0,02
100.000	EUR	Electrolux AB, 2.50%, 18/05/2030	87	0,02
100.000	EUR	Energa Finance AB, 2.13%, 07/03/2027	87	0,02
200.000	EUR	EQT AB, 2.38%, 06/04/2028	174	0,04
100.000	EUR	EQT AB, 0.88%, 14/05/2031	68	0,01
200.000	EUR	EQT AB, 2.88%, 06/04/2032	158	0,03
100.000	EUR	Essity AB, 2.50%, 09/06/2023	100	0,02
150.000	EUR	Essity AB, 1.13%, 27/03/2024	146	0,03
100.000	EUR	Essity AB, 1.13%, 05/03/2025	95	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	73	0,02
100.000	EUR	Fastighets AB Balder, REIT, 1.88%, 14/03/2025	88	0,02
100.000	EUR	Fastighets AB Balder, REIT, 1.25%, 28/01/2028	72	0,02
125.000	EUR	Investor AB, 1.50%, 12/09/2030	107	0,02
150.000	EUR	Investor AB, 2.75%, 10/06/2032	136	0,03
100.000	EUR	Investor AB, 0.38%, 29/10/2035	63	0,01
100.000	EUR	Investor AB, 1.50%, 20/06/2039	70	0,01
200.000	EUR	Lansforsakringar Bank AB, 0.88%, 25/09/2023	195	0,04
175.000	EUR	Lansforsakringar Bank AB, 0.13%, 19/02/2025	161	0,03
100.000	EUR	Molnlycke Holding AB, 1.75%, 28/02/2024	98	0,02
100.000	EUR	Molnlycke Holding AB, 1.88%, 28/02/2025	96	0,02
125.000	EUR	Molnlycke Holding AB, 0.88%, 05/09/2029	97	0,02
100.000	EUR	Molnlycke Holding AB, 0.63%, 15/01/2031	71	0,02
275.000	EUR	Sagax AB, REIT, FRN, 2.25%, 13/03/2025	255	0,05
100.000	EUR	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, REIT, FRN, 1.75%, 14/01/2025	83	0,02
200.000	EUR	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, REIT, FRN, 1.13%, 04/09/2026	150	0,03
100.000	EUR	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, REIT, FRN, 1.00%, 12/08/2027	68	0,01
200.000	EUR	Sandvik AB, 0.38%, 25/11/2028	160	0,03
100.000	EUR	Sandvik AB, 3.75%, 27/09/2029	97	0,02
100.000	EUR	Scania CV AB, 0.50%, 06/10/2023	97	0,02
100.000	EUR	Scania CV AB, 2.25%, 03/06/2025	96	0,02
100.000	EUR	Securitas AB, 1.13%, 20/02/2024	97	0,02
100.000	EUR	Securitas AB, 1.25%, 06/03/2025	93	0,02
100.000	EUR	Securitas AB, 0.25%, 22/02/2028	75	0,02

NM1222U-2615757-95/212

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Svezia (continua)</b>				
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.25%, 19/05/2023	197	0,04
150.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.05%, 01/07/2024	143	0,03
275.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1.75%, 11/11/2026	258	0,05
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.38%, 11/02/2027	172	0,04
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.38%, 21/06/2028	163	0,03
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.63%, 12/11/2029	157	0,03
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN, 1.37%, 31/10/2028	193	0,04
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN, 0.75%, 03/11/2031	166	0,04
150.000	EUR	SKF AB, 0.25%, 15/02/2031	110	0,02
125.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.38%, 03/07/2023	123	0,03
100.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.13%, 18/06/2024	95	0,02
400.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 1.00%, 15/04/2025	381	0,08
100.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.05%, 03/09/2026	87	0,02
125.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.13%, 03/11/2026	109	0,02
100.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.01%, 02/12/2027	82	0,02
175.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.05%, 06/09/2028	142	0,03
300.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 1.38%, 23/02/2029	253	0,05
200.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 2.63%, 05/09/2029	187	0,04
175.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.50%, 18/02/2030	134	0,03
100.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 1.62%, 05/03/2029	96	0,02
200.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 3.25%, 01/06/2033	182	0,04
200.000	EUR	Swedbank AB, 0.40%, 29/08/2023	196	0,04
200.000	EUR	Swedbank AB, 0.25%, 09/10/2024	188	0,04
100.000	EUR	Swedbank AB, 0.75%, 05/05/2025	94	0,02
150.000	EUR	Swedbank AB, 0.25%, 02/11/2026	131	0,03
300.000	EUR	Swedbank AB, 1.30%, 17/02/2027	265	0,06
175.000	EUR	Swedbank AB, 2.10%, 25/05/2027	164	0,03
150.000	EUR	Swedbank AB, 0.20%, 12/01/2028	121	0,03
200.000	EUR	Swedbank AB, FRN, 0.30%, 20/05/2027	175	0,04
200.000	EUR	Swedbank AB, FRN, 3.63%, 23/08/2032	186	0,04
100.000	EUR	Tele2 AB, 2.13%, 15/05/2028	91	0,02
100.000	EUR	Tele2 AB, 0.75%, 23/03/2031	77	0,02
250.000	EUR	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1.13%, 08/02/2027	209	0,04
100.000	EUR	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1.00%, 26/05/2029	72	0,02
200.000	EUR	Telia Co. AB, 3.63%, 14/02/2024	202	0,04
100.000	EUR	Telia Co. AB, 3.88%, 01/10/2025	102	0,02
100.000	EUR	Telia Co. AB, 3.00%, 07/09/2027	98	0,02
100.000	EUR	Telia Co. AB, 2.13%, 20/02/2034	83	0,02
250.000	EUR	Telia Co. AB, 1.63%, 23/02/2035	193	0,04
100.000	EUR	Telia Co. AB, FRN, 1.37%, 11/05/2081	86	0,02
200.000	EUR	Telia Co. AB, FRN, 4.63%, 21/12/2082	191	0,04
100.000	EUR	Telia Co. AB, FRN, 2.75%, 30/06/2083	86	0,02
100.000	EUR	Volvo Treasury AB, 0.00%, 09/05/2024	95	0,02
200.000	EUR	Volvo Treasury AB, 2.13%, 01/09/2024	196	0,04
100.000	EUR	Volvo Treasury AB, 0.13%, 17/09/2024	94	0,02
125.000	EUR	Volvo Treasury AB, 0.63%, 14/02/2025	118	0,03
100.000	EUR	Volvo Treasury AB, 1.63%, 26/05/2025	96	0,02
100.000	EUR	Volvo Treasury AB, 0.00%, 18/05/2026	88	0,02
100.000	EUR	Volvo Treasury AB, 2.00%, 19/08/2027	93	0,02
<b>Svezia - Totale</b>			<b>11.637</b>	<b>2,47</b>
<b>Svizzera (31 marzo 2022: 1,31%)</b>				
200.000	EUR	UBS AG, 0.01%, 31/03/2026	176	0,04
200.000	EUR	UBS AG, 0.50%, 31/03/2031	150	0,03
200.000	EUR	UBS Group AG, 1.50%, 30/11/2024	195	0,04
200.000	EUR	UBS Group AG, 1.25%, 01/09/2026	179	0,04
400.000	EUR	UBS Group AG, 0.25%, 24/02/2028	320	0,07
400.000	EUR	UBS Group AG, 0.88%, 03/11/2031	293	0,06
200.000	EUR	UBS Group AG, 0.63%, 24/02/2033	137	0,03
800.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 1.25%, 17/04/2025	768	0,16

NM1222U-2615757-96/212

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Svizzera (continua)</b>				
250.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 0.25%, 29/01/2026	229	0,05
600.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 0.25%, 03/11/2026	531	0,11
200.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 2.75%, 15/06/2027	189	0,04
200.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 0.25%, 05/11/2028	161	0,04
400.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 3.12%, 15/06/2030	368	0,08
<b>Svizzera - Totale</b>			<b>3.696</b>	<b>0,79</b>
<b>Regno Unito (31 marzo 2022: 6,27%)</b>				
100.000	EUR	Ancor UK Finance plc, 1.13%, 23/06/2027	85	0,02
200.000	EUR	Anglo American Capital plc, 3.25%, 03/04/2023	201	0,04
100.000	EUR	Anglo American Capital plc, 1.63%, 18/09/2025	94	0,02
100.000	EUR	Anglo American Capital plc, 1.63%, 11/03/2026	93	0,02
200.000	EUR	Anglo American Capital plc, 4.75%, 21/09/2032	193	0,04
150.000	EUR	Aon Global Ltd., 2.88%, 14/05/2026	145	0,03
225.000	EUR	AstraZeneca plc, 0.75%, 12/05/2024	217	0,05
200.000	EUR	AstraZeneca plc, 1.25%, 12/05/2028	179	0,04
100.000	EUR	AstraZeneca plc, 0.38%, 03/06/2029	82	0,02
150.000	EUR	Aviva plc, 1.88%, 13/11/2027	138	0,03
100.000	EUR	Aviva plc, FRN, 3.88%, 03/07/2044	98	0,02
100.000	EUR	Aviva plc, FRN, 3.38%, 04/12/2045	95	0,02
100.000	EUR	Babcock International Group plc, 1.38%, 13/09/2027	82	0,02
100.000	EUR	Barclays plc, 1.50%, 03/09/2023	99	0,02
125.000	EUR	Barclays plc, 1.88%, 08/12/2023	123	0,03
490.000	EUR	Barclays plc, FRN, 3.38%, 02/04/2025	483	0,10
150.000	EUR	Barclays plc, FRN, 0.75%, 09/06/2025	141	0,03
300.000	EUR	Barclays plc, FRN, 1.37%, 24/01/2026	278	0,06
100.000	EUR	Barclays plc, FRN, 2.89%, 31/01/2027	93	0,02
300.000	EUR	Barclays plc, FRN, 0.88%, 28/01/2028	250	0,05
400.000	EUR	Barclays plc, FRN, 0.58%, 09/08/2029	307	0,06
300.000	EUR	Barclays plc, FRN, 1.12%, 22/03/2031	247	0,05
200.000	EUR	Barclays plc, FRN, 1.11%, 12/05/2032	141	0,03
200.000	EUR	BG Energy Capital plc, 2.25%, 21/11/2029	179	0,04
350.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.88%, 07/04/2024	344	0,07
200.000	EUR	BP Capital Markets plc, 0.90%, 03/07/2024	193	0,04
150.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.95%, 03/03/2025	146	0,03
150.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.08%, 26/06/2025	141	0,03
200.000	EUR	BP Capital Markets plc, 2.97%, 27/02/2026	197	0,04
150.000	EUR	BP Capital Markets plc, 2.21%, 25/09/2026	143	0,03
210.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.57%, 16/02/2027	192	0,04
150.000	EUR	BP Capital Markets plc, 0.83%, 08/11/2027	130	0,03
300.000	EUR	BP Capital Markets plc, 2.52%, 07/04/2028	281	0,06
100.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.59%, 03/07/2028	88	0,02
200.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.64%, 26/06/2029	172	0,04
250.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.23%, 08/05/2031	198	0,04
300.000	EUR	BP Capital Markets plc, 2.82%, 07/04/2032	269	0,06
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 <sup>1</sup>	445	0,09
450.000	EUR	BP Capital Markets plc, FRN, 3.63%, 22/03/2029 <sup>1</sup>	364	0,08
100.000	EUR	Brambles Finance plc, 1.50%, 04/10/2027	91	0,02
150.000	EUR	British Telecommunications plc, 0.88%, 26/09/2023	147	0,03
100.000	EUR	British Telecommunications plc, 1.00%, 23/06/2024	96	0,02
225.000	EUR	British Telecommunications plc, 1.00%, 21/11/2024	214	0,05
350.000	EUR	British Telecommunications plc, 1.75%, 10/03/2026	328	0,07
300.000	EUR	British Telecommunications plc, 1.50%, 23/06/2027	269	0,06
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	135	0,03
100.000	EUR	British Telecommunications plc, 1.13%, 12/09/2029	82	0,02
100.000	EUR	British Telecommunications plc, 3.38%, 30/08/2032	91	0,02
100.000	EUR	Cadent Finance plc, 0.63%, 19/03/2030	75	0,02
100.000	EUR	Cadent Finance plc, 0.75%, 11/03/2032	70	0,01

NM1222U-2615757-97/212



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Regno Unito (continua)</b>				
150.000	EUR	Cadent Finance plc, FRN, 0.63%, 22/09/2024	140	0,03
150.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 2.63%, 06/11/2023	149	0,03
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 2.38%, 07/05/2025	98	0,02
200.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.75%, 27/03/2026	190	0,04
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.50%, 08/11/2027	89	0,02
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.75%, 26/05/2028	89	0,02
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 0.20%, 02/12/2028	80	0,02
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.13%, 12/04/2029	84	0,02
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.88%, 18/03/2030	87	0,02
200.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 0.70%, 12/09/2031	151	0,03
100.000	EUR	Diageo Finance plc, 0.13%, 12/10/2023	97	0,02
100.000	EUR	Diageo Finance plc, 0.50%, 19/06/2024	96	0,02
200.000	EUR	Diageo Finance plc, 1.75%, 23/09/2024	196	0,04
200.000	EUR	Diageo Finance plc, 2.38%, 20/05/2026	194	0,04
100.000	EUR	Diageo Finance plc, 1.88%, 27/03/2027	94	0,02
200.000	EUR	Diageo Finance plc, 2.50%, 27/03/2032	180	0,04
175.000	EUR	DS Smith plc, FRN, 1.38%, 26/07/2024	167	0,03
150.000	EUR	DS Smith plc, FRN, 0.88%, 12/09/2026	128	0,03
100.000	EUR	easyJet plc, 1.13%, 18/10/2023	97	0,02
200.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 0.00%, 23/09/2023	194	0,04
100.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.38%, 02/12/2024	97	0,02
50.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 4.00%, 16/06/2025	51	0,01
250.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.25%, 21/05/2026	233	0,05
100.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.00%, 12/09/2026	92	0,02
100.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.38%, 12/09/2029	87	0,02
150.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.75%, 21/05/2030	132	0,03
350.000	EUR	HSBC Holdings plc, 0.88%, 06/09/2024	333	0,07
200.000	EUR	HSBC Holdings plc, 3.00%, 30/06/2025	194	0,04
250.000	EUR	HSBC Holdings plc, 2.50%, 15/03/2027	230	0,05
200.000	EUR	HSBC Holdings plc, 3.13%, 07/06/2028	182	0,04
250.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 0.31%, 13/11/2026	220	0,05
500.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 3.02%, 15/06/2027	470	0,10
250.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 0.64%, 24/09/2029	195	0,04
225.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 0.77%, 13/11/2031	163	0,03
100.000	EUR	Informa plc, FRN, 1.50%, 05/07/2023	99	0,02
125.000	EUR	Informa plc, FRN, 2.13%, 06/10/2025	116	0,02
100.000	EUR	Informa plc, FRN, 1.25%, 22/04/2028	80	0,02
100.000	EUR	InterContinental Hotels Group plc, FRN, 1.63%, 08/10/2024	95	0,02
100.000	EUR	InterContinental Hotels Group plc, FRN, 2.13%, 15/05/2027	88	0,02
100.000	EUR	Intermediate Capital Group plc, 1.63%, 17/02/2027	83	0,02
150.000	EUR	Intermediate Capital Group plc, 2.50%, 28/01/2030	110	0,02
200.000	EUR	Investec Bank plc, FRN, 1.25%, 11/08/2026	182	0,04
100.000	EUR	ITV plc, FRN, 1.38%, 26/09/2026	87	0,02
100.000	EUR	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 0.38%, 28/01/2025	93	0,02
200.000	EUR	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 2.38%, 09/04/2026	190	0,04
300.000	EUR	Lloyds Bank plc, 1.25%, 13/01/2025	287	0,06
300.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, 1.50%, 12/09/2027	265	0,06
200.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 0.50%, 12/11/2025	186	0,04
300.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 3.50%, 01/04/2026	294	0,06
100.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 4.50%, 18/03/2030	95	0,02
200.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 3.12%, 24/08/2030	179	0,04
150.000	EUR	London Stock Exchange Group plc, 0.88%, 19/09/2024	144	0,03
100.000	EUR	London Stock Exchange Group plc, 1.75%, 06/12/2027	91	0,02
125.000	EUR	London Stock Exchange Group plc, 1.75%, 19/09/2029	108	0,02
200.000	EUR	Mitsubishi HC Capital UK plc, 0.00%, 29/10/2024	184	0,04
100.000	EUR	Mondi Finance plc, 1.50%, 15/04/2024	96	0,02
200.000	EUR	Mondi Finance plc, 1.63%, 27/04/2026	182	0,04
100.000	EUR	Motability Operations Group plc, 1.63%, 09/06/2023	99	0,02
125.000	EUR	Motability Operations Group plc, 0.88%, 14/03/2025	118	0,02
150.000	EUR	Motability Operations Group plc, 0.38%, 03/01/2026	136	0,03

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Regno Unito (continua)</b>				
100.000	EUR	National Grid Electricity Transmission plc, 0.19%, 20/01/2025	93	0,02
150.000	EUR	National Grid Electricity Transmission plc, 0.82%, 07/07/2032	108	0,02
100.000	EUR	National Grid Electricity Transmission plc, 0.87%, 26/11/2040	53	0,01
200.000	EUR	National Grid plc, 2.18%, 30/06/2026	189	0,04
100.000	EUR	National Grid plc, 0.16%, 20/01/2028	81	0,02
200.000	EUR	National Grid plc, 0.25%, 01/09/2028	160	0,03
125.000	EUR	National Grid plc, 0.55%, 18/09/2029	97	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	67	0,01
200.000	EUR	National Grid plc, 3.25%, 30/03/2034	173	0,04
200.000	EUR	Nationwide Building Society, 1.25%, 03/03/2025	191	0,04
175.000	EUR	Nationwide Building Society, 0.25%, 22/07/2025	160	0,03
175.000	EUR	Nationwide Building Society, 2.00%, 28/04/2027	161	0,03
250.000	EUR	Nationwide Building Society, 0.25%, 14/09/2028	198	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	163	0,03
200.000	EUR	Nationwide Building Society, FRN, 2.00%, 25/07/2029	187	0,04
100.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 2.00%, 04/03/2025	97	0,02
200.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 0.75%, 15/11/2025	187	0,04
250.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 1.75%, 02/03/2026	234	0,05
300.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 4.07%, 06/09/2028	286	0,06
200.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 0.67%, 14/09/2029	154	0,03
200.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 0.78%, 26/02/2030	152	0,04
200.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 1.04%, 14/09/2032	155	0,03
100.000	EUR	NatWest Markets plc, 1.13%, 14/06/2023	99	0,02
300.000	EUR	NatWest Markets plc, 1.00%, 28/05/2024	288	0,06
200.000	EUR	NatWest Markets plc, 2.75%, 02/04/2025	195	0,04
200.000	EUR	NatWest Markets plc, 2.00%, 27/08/2025	189	0,04
200.000	EUR	NatWest Markets plc, 0.13%, 12/11/2025	178	0,04
300.000	EUR	NatWest Markets plc, 0.13%, 18/06/2026	259	0,05
200.000	EUR	NatWest Markets plc, 1.38%, 02/03/2027	177	0,04
100.000	EUR	Omnicom Finance Holdings plc, 0.80%, 08/07/2027	88	0,02
100.000	EUR	Omnicom Finance Holdings plc, 1.40%, 08/07/2031	79	0,02
100.000	EUR	Pearson Funding plc, 1.38%, 06/05/2025	94	0,02
100.000	EUR	Phoenix Group Holdings plc, 4.38%, 24/01/2029	83	0,02
100.000	EUR	Rentokil Initial plc, FRN, 0.95%, 22/11/2024	95	0,02
100.000	EUR	Rentokil Initial plc, FRN, 0.88%, 30/05/2026	90	0,02
100.000	EUR	Rentokil Initial plc, FRN, 0.50%, 14/10/2028	80	0,02
100.000	EUR	Rio Tinto Finance plc, 2.88%, 11/12/2024	101	0,02
200.000	EUR	Royal Mail plc, 2.38%, 29/07/2024	194	0,04
100.000	EUR	Royal Mail plc, 1.25%, 08/10/2026	89	0,02
200.000	EUR	Santander UK Group Holdings plc, FRN, 0.39%, 28/02/2025	190	0,04
200.000	EUR	Santander UK Group Holdings plc, FRN, 3.53%, 25/08/2028	187	0,04
225.000	EUR	Santander UK Group Holdings plc, FRN, 0.60%, 13/09/2029	173	0,04
400.000	EUR	Sky Ltd., 1.88%, 24/11/2023	396	0,08
200.000	EUR	Sky Ltd., 2.50%, 15/09/2026	194	0,04
100.000	EUR	Smiths Group plc, 2.00%, 23/02/2027	91	0,02
100.000	EUR	SSE plc, 1.75%, 08/09/2023	98	0,02
125.000	EUR	SSE plc, 1.25%, 16/04/2025	118	0,02
150.000	EUR	SSE plc, 0.88%, 06/09/2025	139	0,03
200.000	EUR	SSE plc, 1.38%, 04/09/2027	179	0,04
100.000	EUR	SSE plc, 2.88%, 01/08/2029	92	0,02
100.000	EUR	SSE plc, FRN, 3.12%, 14/04/2027 <sup>1</sup>	87	0,02
300.000	EUR	SSE plc, FRN, 4.00%, 21/01/2028 <sup>1</sup>	264	0,06
200.000	EUR	Standard Chartered plc, 3.13%, 19/11/2024	194	0,04
100.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 0.90%, 02/07/2027	87	0,02
200.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 1.62%, 03/10/2027	177	0,04
200.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 0.85%, 27/01/2028	168	0,04
200.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 0.80%, 17/11/2029	155	0,03
100.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 2.50%, 09/09/2030	91	0,02

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Regno Unito (continua)</b>				
200.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 1.20%, 23/09/2031	165	0,03
100.000	EUR	Swiss Re Finance UK plc, FRN, 2.71%, 04/06/2052	74	0,02
300.000	EUR	Tesco Corporate Treasury Services plc, 2.50%, 01/07/2024	294	0,06
200.000	EUR	Tesco Corporate Treasury Services plc, 0.88%, 29/05/2026	177	0,04
200.000	EUR	Tesco Corporate Treasury Services plc, 0.38%, 27/07/2029	148	0,03
100.000	EUR	Thames Water Utilities Finance plc, 0.88%, 31/01/2028	83	0,02
100.000	EUR	Thames Water Utilities Finance plc, 1.25%, 31/01/2032	72	0,02
100.000	EUR	Tritax EuroBox plc, REIT, FRN, 0.95%, 02/06/2026	84	0,02
100.000	EUR	Unilever plc, 1.50%, 11/06/2039	74	0,02
100.000	EUR	Virgin Money UK plc, FRN, 2.87%, 24/06/2025	96	0,02
100.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.75%, 25/08/2023	99	0,02
100.000	EUR	Vodafone Group plc, 0.50%, 30/01/2024	97	0,02
300.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.88%, 11/09/2025	289	0,06
200.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.13%, 20/11/2025	188	0,04
500.000	EUR	Vodafone Group plc, 2.20%, 25/08/2026	479	0,10
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	133	0,03
250.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.63%, 24/11/2030	212	0,04
200.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.60%, 29/07/2031	166	0,03
200.000	EUR	Vodafone Group plc, 2.88%, 20/11/2037	166	0,03
100.000	EUR	Vodafone Group plc, 2.50%, 24/05/2039	76	0,02
100.000	EUR	Wellcome Trust Ltd. (The), 1.13%, 21/01/2027	91	0,02
100.000	EUR	Western Power Distribution East Midlands plc, 3.53%, 20/09/2028	97	0,02
100.000	EUR	Western Power Distribution East Midlands plc, 3.95%, 20/09/2032	96	0,02
150.000	EUR	WPP Finance 2013, 3.00%, 20/11/2023	149	0,03
100.000	EUR	WPP Finance 2016, 1.38%, 20/03/2025	95	0,02
150.000	EUR	Yorkshire Building Society, 0.63%, 21/09/2025	136	0,03
100.000	EUR	Yorkshire Building Society, 0.50%, 01/07/2028	80	0,02
<b>Regno Unito - Totale</b>			<b>31.251</b>	<b>6,63</b>
<b>Stati Uniti (31 marzo 2022: 15,29%)</b>				
200.000	EUR	3M Co., 1.50%, 09/11/2026	187	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	82	0,02
100.000	EUR	AbbVie, Inc., 1.50%, 15/11/2023	99	0,02
150.000	EUR	AbbVie, Inc., 1.38%, 17/05/2024	146	0,03
200.000	EUR	AbbVie, Inc., 1.25%, 01/06/2024	194	0,04
200.000	EUR	AbbVie, Inc., 0.75%, 18/11/2027	173	0,04
100.000	EUR	AbbVie, Inc., 2.63%, 15/11/2028	94	0,02
200.000	EUR	AbbVie, Inc., 2.13%, 17/11/2028	183	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	80	0,02
100.000	EUR	Air Products and Chemicals, Inc., 0.50%, 05/05/2028	85	0,02
100.000	EUR	Air Products and Chemicals, Inc., 0.80%, 05/05/2032	74	0,02
300.000	EUR	American Honda Finance Corp., 1.95%, 18/10/2024	293	0,06
250.000	EUR	American Honda Finance Corp., 0.30%, 07/07/2028	205	0,04
200.000	EUR	American International Group, Inc., 1.88%, 21/06/2027	181	0,04
100.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 1.38%, 04/04/2025	95	0,02
300.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 0.40%, 15/02/2027	252	0,05
200.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 0.50%, 15/01/2028	162	0,03
300.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 0.88%, 21/05/2029	234	0,05
100.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 1.00%, 15/01/2032	71	0,01
150.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 1.25%, 21/05/2033	106	0,02
200.000	EUR	Amgen, Inc., 2.00%, 25/02/2026	192	0,04
150.000	EUR	Apple, Inc., 1.38%, 17/01/2024	148	0,03
200.000	EUR	Apple, Inc., 0.88%, 24/05/2025	191	0,04
100.000	EUR	Apple, Inc., 0.00%, 15/11/2025	92	0,02
350.000	EUR	Apple, Inc., 1.63%, 10/11/2026	334	0,07
250.000	EUR	Apple, Inc., 2.00%, 17/09/2027	238	0,05

NM1222U-2615757-100/212



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Stati Uniti (continua)</b>				
350.000	EUR	Apple, Inc., 1.38%, 24/05/2029	316	0,07
200.000	EUR	Apple, Inc., 0.50%, 15/11/2031	158	0,03
100.000	EUR	Archer-Daniels-Midland Co., 1.75%, 23/06/2023	99	0,02
150.000	EUR	Archer-Daniels-Midland Co., 1.00%, 12/09/2025	141	0,03
230.000	EUR	AT&T, Inc., 2.40%, 15/03/2024	228	0,05
150.000	EUR	AT&T, Inc., 3.50%, 17/12/2025	150	0,03
325.000	EUR	AT&T, Inc., 0.25%, 04/03/2026	292	0,06
350.000	EUR	AT&T, Inc., 1.80%, 05/09/2026	327	0,07
400.000	EUR	AT&T, Inc., 1.60%, 19/05/2028	357	0,08
200.000	EUR	AT&T, Inc., 2.35%, 05/09/2029	181	0,04
150.000	EUR	AT&T, Inc., 2.60%, 17/12/2029	137	0,03
300.000	EUR	AT&T, Inc., 0.80%, 04/03/2030	239	0,05
300.000	EUR	AT&T, Inc., 2.05%, 19/05/2032	251	0,05
250.000	EUR	AT&T, Inc., 3.55%, 17/12/2032	234	0,05
100.000	EUR	AT&T, Inc., 3.38%, 15/03/2034	90	0,02
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	256	0,05
100.000	EUR	AT&T, Inc., 2.60%, 19/05/2038	78	0,02
200.000	EUR	AT&T, Inc., 1.80%, 14/09/2039	135	0,03
100.000	EUR	Athene Global Funding, 1.24%, 08/04/2024	96	0,02
175.000	EUR	Athene Global Funding, 0.83%, 08/01/2027	150	0,03
175.000	EUR	Athene Global Funding, 0.63%, 12/01/2028	142	0,03
100.000	EUR	Avery Dennison Corp., 1.25%, 03/03/2025	93	0,02
200.000	EUR	Bank of America Corp., 2.38%, 19/06/2024	197	0,04
150.000	EUR	Bank of America Corp., 1.38%, 26/03/2025	143	0,03
200.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.38%, 07/02/2025	194	0,04
275.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.81%, 09/05/2026	254	0,05
300.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.95%, 27/10/2026	282	0,06
250.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.78%, 04/05/2027	231	0,05
200.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.66%, 25/04/2028	179	0,04
200.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.58%, 24/08/2028	168	0,04
430.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 3.65%, 31/03/2029	415	0,09
250.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.58%, 08/08/2029	201	0,04
200.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.38%, 13/08/2030	165	0,03
500.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.69%, 22/03/2031	381	0,08
200.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.65%, 26/10/2031	148	0,03
375.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.10%, 24/05/2032	284	0,06
425.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 2.82%, 27/04/2033	366	0,08
200.000	EUR	Baxter International, Inc., 0.40%, 15/05/2024	192	0,04
250.000	EUR	Baxter International, Inc., 1.30%, 15/05/2029	209	0,04
200.000	EUR	Becton Dickinson and Co., 0.03%, 13/08/2025	182	0,04
100.000	EUR	Becton Dickinson and Co., 1.90%, 15/12/2026	93	0,02
125.000	EUR	Berkshire Hathaway Finance Corp., 1.50%, 18/03/2030	105	0,02
200.000	EUR	Berkshire Hathaway Finance Corp., 2.00%, 18/03/2034	160	0,03
150.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 1.30%, 15/03/2024	147	0,03
200.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 0.00%, 12/03/2025	186	0,04
150.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 1.13%, 16/03/2027	135	0,03
150.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 2.15%, 15/03/2028	139	0,03
200.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 1.63%, 16/03/2035	150	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	91	0,02
150.000	EUR	Berry Global, Inc., 1.50%, 15/01/2027	127	0,03
150.000	EUR	Blackstone Holdings Finance Co. LLC, 1.00%, 05/10/2026	134	0,03
100.000	EUR	Blackstone Holdings Finance Co. LLC, 1.50%, 10/04/2029	85	0,02
100.000	EUR	Blackstone Holdings Finance Co. LLC, 3.50%, 01/06/2034	87	0,02
100.000	EUR	Blackstone Private Credit Fund, 1.75%, 30/11/2026	81	0,02
100.000	EUR	BMW US Capital LLC, 1.00%, 20/04/2027	91	0,02
200.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 2.38%, 23/09/2024	198	0,04
250.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 1.80%, 03/03/2027	231	0,05
200.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 0.50%, 08/03/2028	168	0,04

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Stati Uniti (continua)</b>				
200.000	EUR	BorgWarner, Inc., 1.00%, 19/05/2031	143	0,03
200.000	EUR	Boston Scientific Corp., 0.63%, 01/12/2027	172	0,04
100.000	EUR	Bristol-Myers Squibb Co., 1.00%, 15/05/2025	95	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
150.000	EUR	Capital One Financial Corp., 0.80%, 12/06/2024	142	0,03
100.000	EUR	Capital One Financial Corp., 1.65%, 12/06/2029	79	0,02
300.000	EUR	Celanese US Holdings LLC, 1.25%, 11/02/2025	272	0,06
125.000	EUR	Celanese US Holdings LLC, 2.13%, 01/03/2027	103	0,02
100.000	EUR	Celanese US Holdings LLC, 0.63%, 10/09/2028	70	0,01
100.000	EUR	Celanese US Holdings LLC, FRN, 4.78%, 19/07/2026	95	0,02
100.000	EUR	Celanese US Holdings LLC, FRN, 5.34%, 19/01/2029	91	0,02
150.000	EUR	Chubb INA Holdings, Inc., 0.30%, 15/12/2024	141	0,03
100.000	EUR	Chubb INA Holdings, Inc., 0.88%, 15/06/2027	88	0,02
100.000	EUR	Chubb INA Holdings, Inc., 1.55%, 15/03/2028	89	0,02
100.000	EUR	Chubb INA Holdings, Inc., 0.88%, 15/12/2029	80	0,02
100.000	EUR	Chubb INA Holdings, Inc., 1.40%, 15/06/2031	79	0,02
200.000	EUR	Chubb INA Holdings, Inc., 2.50%, 15/03/2038	152	0,03
400.000	EUR	Citigroup, Inc., 0.75%, 26/10/2023	391	0,08
300.000	EUR	Citigroup, Inc., 2.38%, 22/05/2024	296	0,06
100.000	EUR	Citigroup, Inc., 1.75%, 28/01/2025	96	0,02
100.000	EUR	Citigroup, Inc., 2.13%, 10/09/2026	93	0,02
200.000	EUR	Citigroup, Inc., 1.63%, 21/03/2028	176	0,04
100.000	EUR	Citigroup, Inc., 1.50%, 26/10/2028	86	0,02
325.000	EUR	Citigroup, Inc., 1.25%, 10/04/2029	269	0,06
600.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 1.25%, 06/07/2026	558	0,12
265.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 1.50%, 24/07/2026	248	0,05
200.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 0.50%, 08/10/2027	173	0,04
200.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 4.25%, 25/02/2030	193	0,04
400.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 4.11%, 22/09/2033	384	0,08
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.50%, 08/03/2024	97	0,02
400.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.75%, 22/09/2026	369	0,08
200.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.88%, 22/09/2026	191	0,04
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.13%, 09/03/2027	92	0,02
325.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.13%, 15/03/2029	264	0,06
275.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.40%, 06/05/2030	220	0,05
250.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.25%, 08/03/2031	211	0,04
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.50%, 09/03/2033	74	0,02
125.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.38%, 15/03/2033	90	0,02
340.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.63%, 09/03/2035	269	0,06
200.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.95%, 06/05/2036	139	0,03
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.10%, 02/09/2036	70	0,01
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.80%, 15/03/2040	62	0,01
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.00%, 09/03/2041	63	0,01
100.000	EUR	Colgate-Palmolive Co., 0.50%, 06/03/2026	92	0,02
100.000	EUR	Colgate-Palmolive Co., 0.30%, 10/11/2029	82	0,02
100.000	EUR	Colgate-Palmolive Co., 1.38%, 06/03/2034	81	0,02
100.000	EUR	Colgate-Palmolive Co., 0.88%, 12/11/2039	66	0,01
250.000	EUR	Comcast Corp., 0.00%, 14/09/2026	219	0,05
300.000	EUR	Comcast Corp., 0.25%, 20/05/2027	260	0,05
200.000	EUR	Comcast Corp., 0.25%, 14/09/2029	160	0,03
300.000	EUR	Comcast Corp., 0.75%, 20/02/2032	231	0,05
100.000	EUR	Comcast Corp., 1.25%, 20/02/2040	67	0,01
100.000	EUR	Computershare US, Inc., 1.13%, 07/10/2031	73	0,02
100.000	EUR	Danaher Corp., 1.70%, 30/03/2024	98	0,02
160.000	EUR	Danaher Corp., 2.10%, 30/09/2026	152	0,03
200.000	EUR	Danaher Corp., 2.50%, 30/03/2030	184	0,04
200.000	EUR	Digital Euro Finco LLC, REIT, 2.50%, 16/01/2026	185	0,04
100.000	EUR	Digital Euro Finco LLC, REIT, 1.13%, 09/04/2028	81	0,02
100.000	EUR	Discovery Communications LLC, 1.90%, 19/03/2027	85	0,02

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Stati Uniti (continua)</b>				
100.000	EUR	Dover Corp., 1.25%, 09/11/2026	91	0,02
100.000	EUR	Dover Corp., 0.75%, 04/11/2027	86	0,02
260.000	EUR	Dow Chemical Co. (The), 0.50%, 15/03/2027	220	0,05
100.000	EUR	Dow Chemical Co. (The), 1.13%, 15/03/2032	71	0,01
100.000	EUR	Dow Chemical Co. (The), 1.88%, 15/03/2040	61	0,01
200.000	EUR	Duke Energy Corp., 3.85%, 15/06/2034	176	0,04
100.000	EUR	DXC Technology Co., 1.75%, 15/01/2026	92	0,02
150.000	EUR	Eastman Chemical Co., 1.50%, 26/05/2023	148	0,03
100.000	EUR	Eastman Chemical Co., 1.88%, 23/11/2026	88	0,02
250.000	EUR	Ecolab, Inc., 1.00%, 15/01/2024	244	0,05
200.000	EUR	Eli Lilly & Co., 1.63%, 02/06/2026	190	0,04
200.000	EUR	Eli Lilly & Co., 2.13%, 03/06/2030	183	0,04
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
225.000	EUR	Eli Lilly & Co., 1.70%, 01/11/2049	149	0,03
200.000	EUR	Eli Lilly & Co., 1.13%, 14/09/2051	109	0,02
150.000	EUR	Eli Lilly & Co., 1.38%, 14/09/2061	77	0,02
200.000	EUR	Emerson Electric Co., 0.38%, 22/05/2024	192	0,04
100.000	EUR	Emerson Electric Co., 1.25%, 15/10/2025	94	0,02
100.000	EUR	Emerson Electric Co., 2.00%, 15/10/2029	89	0,02
200.000	EUR	Equinix, Inc., REIT, 1.00%, 15/03/2033	141	0,03
100.000	EUR	Euronet Worldwide, Inc., FRN, 1.38%, 22/05/2026	86	0,02
250.000	EUR	FedEx Corp., 1.63%, 11/01/2027	227	0,05
175.000	EUR	FedEx Corp., 0.45%, 04/05/2029	135	0,03
100.000	EUR	FedEx Corp., 1.30%, 05/08/2031	74	0,02
100.000	EUR	FedEx Corp., 0.95%, 04/05/2033	69	0,01
100.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 1.10%, 15/07/2024	96	0,02
100.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 0.63%, 03/12/2025	91	0,02
300.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 1.50%, 21/05/2027	268	0,06
150.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 1.00%, 03/12/2028	123	0,03
225.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 2.00%, 21/05/2030	189	0,04
100.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 2.95%, 21/05/2039	78	0,02
150.000	EUR	Fiserv, Inc., 0.38%, 01/07/2023	147	0,03
100.000	EUR	Fiserv, Inc., 1.13%, 01/07/2027	88	0,02
100.000	EUR	Fiserv, Inc., 1.63%, 01/07/2030	82	0,02
100.000	EUR	General Electric Co., 1.25%, 26/05/2023	99	0,02
100.000	EUR	General Electric Co., 0.88%, 17/05/2025	94	0,02
200.000	EUR	General Electric Co., 1.88%, 28/05/2027	183	0,04
150.000	EUR	General Electric Co., 1.50%, 17/05/2029	127	0,03
200.000	EUR	General Electric Co., 4.13%, 19/09/2035	191	0,04
225.000	EUR	General Electric Co., 2.13%, 17/05/2037	171	0,04
150.000	EUR	General Mills, Inc., 1.00%, 27/04/2023	149	0,03
100.000	EUR	General Mills, Inc., 0.13%, 15/11/2025	90	0,02
200.000	EUR	General Mills, Inc., 0.45%, 15/01/2026	181	0,04
200.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 0.96%, 07/09/2023	195	0,04
200.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 2.20%, 01/04/2024	195	0,04
100.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 1.69%, 26/03/2025	93	0,02
200.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 0.85%, 26/02/2026	177	0,04
100.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 0.60%, 20/05/2027	81	0,02
200.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 0.65%, 07/09/2028	150	0,03
550.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.38%, 15/05/2024	536	0,11
200.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.13%, 19/08/2024	188	0,04
150.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 2.13%, 30/09/2024	146	0,03
440.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 3.38%, 27/03/2025	438	0,09
400.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.25%, 01/05/2025	378	0,08
200.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 2.88%, 03/06/2026	192	0,04
275.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.63%, 27/07/2026	252	0,05
400.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.25%, 26/01/2028	324	0,07
150.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 2.00%, 22/03/2028	133	0,03
300.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 2.00%, 01/11/2028	263	0,06

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Stati Uniti (continua)</b>				
279.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.25%, 07/02/2029	229	0,05
300.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.88%, 09/05/2029	237	0,05
300.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.88%, 21/01/2030	232	0,05
275.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 3.00%, 12/02/2031	245	0,05
225.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.75%, 23/03/2032	159	0,03
225.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.00%, 18/03/2033	156	0,03
150.000	EUR	Harley-Davidson Financial Services, Inc., 0.90%, 19/11/2024	142	0,03
100.000	EUR	Honeywell International, Inc., 0.00%, 10/03/2024	96	0,02
150.000	EUR	Honeywell International, Inc., 2.25%, 22/02/2028	140	0,03
100.000	EUR	Honeywell International, Inc., 0.75%, 10/03/2032	76	0,02
250.000	EUR	Illinois Tool Works, Inc., 0.25%, 05/12/2024	235	0,05
175.000	EUR	Illinois Tool Works, Inc., 0.63%, 05/12/2027	151	0,03
100.000	EUR	Illinois Tool Works, Inc., 2.13%, 22/05/2030	88	0,02
100.000	EUR	Illinois Tool Works, Inc., 1.00%, 05/06/2031	78	0,02
100.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.13%, 06/09/2024	97	0,02
200.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.88%, 31/01/2025	191	0,04
200.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.95%, 23/05/2025	189	0,04
150.000	EUR	International Business Machines Corp., 2.88%, 07/11/2025	148	0,03
200.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.25%, 29/01/2027	184	0,04
200.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.30%, 11/02/2028	170	0,04
150.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.75%, 07/03/2028	138	0,03
300.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.50%, 23/05/2029	267	0,06
250.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.88%, 09/02/2030	208	0,04
200.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.75%, 31/01/2031	174	0,04
375.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.65%, 11/02/2032	286	0,06
250.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.25%, 09/02/2034	191	0,04
175.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.20%, 11/02/2040	117	0,02
100.000	EUR	International Flavors & Fragrances, Inc., 1.75%, 14/03/2024	97	0,02
200.000	EUR	International Flavors & Fragrances, Inc., 1.80%, 25/09/2026	184	0,04
100.000	EUR	Jefferies Group LLC, 1.00%, 19/07/2024	95	0,02
200.000	EUR	Johnson & Johnson, 0.65%, 20/05/2024	194	0,04
200.000	EUR	Johnson & Johnson, 1.15%, 20/11/2028	179	0,04
250.000	EUR	Johnson & Johnson, 1.65%, 20/05/2035	203	0,04
300.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., 0.63%, 25/01/2024	291	0,06
150.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., 1.50%, 27/01/2025	144	0,03
300.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., 3.00%, 19/02/2026	292	0,06
300.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., 1.50%, 29/10/2026	274	0,06
100.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., 2.88%, 24/05/2028	93	0,02
490.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.09%, 11/03/2027	443	0,09
300.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 0.39%, 24/02/2028	255	0,05
450.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.64%, 18/05/2028	401	0,08
300.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.81%, 12/06/2029	262	0,06
475.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.96%, 23/03/2030	411	0,09
250.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.00%, 25/07/2031	194	0,04
475.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.05%, 04/11/2032	355	0,08
325.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 0.60%, 17/02/2033	231	0,05
100.000	EUR	Kellogg Co., 1.00%, 17/05/2024	97	0,02
200.000	EUR	Kellogg Co., 1.25%, 10/03/2025	192	0,04
100.000	EUR	Kellogg Co., 0.50%, 20/05/2029	81	0,02
100.000	EUR	Kimberly-Clark Corp., 0.63%, 07/09/2024	96	0,02
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	124	0,03
100.000	EUR	Kraft Heinz Foods Co., 1.50%, 24/05/2024	97	0,02
300.000	EUR	Kraft Heinz Foods Co., 2.25%, 25/05/2028	270	0,06
100.000	EUR	Liberty Mutual Group, Inc., 2.75%, 04/05/2026	96	0,02
100.000	EUR	Linde, Inc., 1.20%, 12/02/2024	98	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	92	0,02
100.000	EUR	ManpowerGroup, Inc., 3.50%, 30/06/2027	95	0,02
200.000	EUR	Marsh & McLennan Cos., Inc., 1.98%, 21/03/2030	171	0,04

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Stati Uniti (continua)</b>				
200.000	EUR	Mastercard, Inc., 2.10%, 01/12/2027	190	0,04
100.000	EUR	Mastercard, Inc., 1.00%, 22/02/2029	86	0,02
200.000	EUR	McDonald's Corp., 0.63%, 29/01/2024	194	0,04
200.000	EUR	McDonald's Corp., 2.38%, 27/11/2024	198	0,04
100.000	EUR	McDonald's Corp., 1.88%, 26/05/2027	93	0,02
100.000	EUR	McDonald's Corp., 1.75%, 03/05/2028	91	0,02
125.000	EUR	McDonald's Corp., 0.25%, 04/10/2028	102	0,02
200.000	EUR	McDonald's Corp., 2.38%, 31/05/2029	183	0,04
100.000	EUR	McDonald's Corp., 2.63%, 11/06/2029	92	0,02
100.000	EUR	McDonald's Corp., 1.50%, 28/11/2029	86	0,02
200.000	EUR	McDonald's Corp., 1.60%, 15/03/2031	165	0,03
150.000	EUR	McDonald's Corp., 0.88%, 04/10/2033	108	0,02
100.000	EUR	McDonald's Corp., 3.00%, 31/05/2034	90	0,02
250.000	EUR	McKesson Corp., 1.63%, 30/10/2026	232	0,05
100.000	EUR	Merck & Co., Inc., 0.50%, 02/11/2024	96	0,02
250.000	EUR	Merck & Co., Inc., 1.88%, 15/10/2026	240	0,05
200.000	EUR	Merck & Co., Inc., 2.50%, 15/10/2034	179	0,04
100.000	EUR	Merck & Co., Inc., 1.38%, 02/11/2036	76	0,02
200.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.38%, 09/04/2024	192	0,04
200.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.50%, 25/05/2029	161	0,03
350.000	EUR	Microsoft Corp., 3.13%, 06/12/2028	351	0,07
100.000	EUR	Microsoft Corp., 2.63%, 02/05/2033	94	0,02
100.000	EUR	MMS USA Holdings, Inc., 0.63%, 13/06/2025	93	0,02
100.000	EUR	MMS USA Holdings, Inc., 1.25%, 13/06/2028	86	0,02
200.000	EUR	MMS USA Holdings, Inc., 1.75%, 13/06/2031	159	0,03
100.000	EUR	Molson Coors Beverage Co., 1.25%, 15/07/2024	95	0,02
150.000	EUR	Mondelez International, Inc., 1.63%, 08/03/2027	138	0,03
125.000	EUR	Mondelez International, Inc., 0.25%, 17/03/2028	103	0,02
100.000	EUR	Mondelez International, Inc., 0.75%, 17/03/2033	72	0,01
125.000	EUR	Mondelez International, Inc., 1.38%, 17/03/2041	77	0,02
200.000	EUR	Moody's Corp., 0.95%, 25/02/2030	161	0,03
350.000	EUR	Morgan Stanley, 1.75%, 11/03/2024	343	0,07
350.000	EUR	Morgan Stanley, 1.75%, 30/01/2025	337	0,07
130.000	EUR	Morgan Stanley, 1.38%, 27/10/2026	118	0,02
390.000	EUR	Morgan Stanley, 1.88%, 27/04/2027	355	0,07
300.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 0.64%, 26/07/2024	293	0,06
175.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 2.10%, 08/05/2026	167	0,04
100.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 1.34%, 23/10/2026	92	0,02
475.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 0.41%, 29/10/2027	409	0,09
425.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 0.49%, 26/10/2029	339	0,07
250.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 0.50%, 07/02/2031	188	0,04
450.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 2.95%, 07/05/2032	398	0,08
420.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 1.10%, 29/04/2033	309	0,07
100.000	EUR	Mylan, Inc., 2.13%, 23/05/2025	94	0,02
100.000	EUR	Nasdaq, Inc., 1.75%, 28/03/2029	84	0,02
100.000	EUR	Nasdaq, Inc., 0.88%, 13/02/2030	77	0,02
200.000	EUR	Nasdaq, Inc., 0.90%, 30/07/2033	135	0,03
100.000	EUR	National Grid North America, Inc., 0.75%, 08/08/2023	98	0,02
100.000	EUR	National Grid North America, Inc., 1.00%, 12/07/2024	96	0,02
125.000	EUR	National Grid North America, Inc., 0.41%, 20/01/2026	112	0,02
100.000	EUR	National Grid North America, Inc., 1.05%, 20/01/2031	77	0,02
200.000	EUR	Nestle Holdings, Inc., 0.88%, 18/07/2025	190	0,04
200.000	EUR	New York Life Global Funding, 0.25%, 23/01/2027	174	0,04
100.000	EUR	New York Life Global Funding, 0.25%, 04/10/2028	81	0,02
200.000	EUR	Oracle Corp., 3.13%, 10/07/2025	199	0,04
150.000	EUR	Parker-Hannifin Corp., 1.13%, 01/03/2025	139	0,03
200.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.25%, 06/05/2024	193	0,04
100.000	EUR	PepsiCo, Inc., 2.63%, 28/04/2026	99	0,02
150.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.75%, 18/03/2027	136	0,03
300.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.50%, 06/05/2028	258	0,05



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Stati Uniti (continua)</b>				
100.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.88%, 18/07/2028	87	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	110	0,02
200.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.75%, 14/10/2033	148	0,03
200.000	EUR	PepsiCo, Inc., 1.05%, 09/10/2050	110	0,02
200.000	EUR	PerkinElmer, Inc., 1.88%, 19/07/2026	185	0,04
200.000	EUR	Pfizer, Inc., 1.00%, 06/03/2027	184	0,04
100.000	EUR	PPG Industries, Inc., 0.88%, 03/11/2025	92	0,02
100.000	EUR	PPG Industries, Inc., 1.40%, 13/03/2027	89	0,02
200.000	EUR	PPG Industries, Inc., 2.75%, 01/06/2029	182	0,04
200.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 1.13%, 02/11/2023	197	0,04
100.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 0.50%, 25/10/2024	96	0,02
100.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 0.63%, 30/10/2024	96	0,02
400.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 4.88%, 11/05/2027	430	0,10
150.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 1.20%, 30/10/2028	134	0,03
100.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 0.35%, 05/05/2030	81	0,02
200.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 1.88%, 30/10/2038	160	0,03
100.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 0.90%, 04/11/2041	62	0,01
200.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 0.25%, 10/09/2027	167	0,04
100.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 0.38%, 06/02/2028	83	0,02
200.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 1.00%, 08/02/2029	164	0,03
150.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 0.63%, 10/09/2031	108	0,02
250.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 0.50%, 16/02/2032	175	0,04
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	70	0,01
100.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 1.00%, 16/02/2041	56	0,01
100.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 1.50%, 10/09/2049	53	0,01
100.000	EUR	Prologis LP, REIT, 3.00%, 02/06/2026	98	0,02
125.000	EUR	Public Storage, REIT, 0.50%, 09/09/2030	94	0,02
100.000	EUR	Public Storage, REIT, 0.88%, 24/01/2032	72	0,02
200.000	EUR	PVH Corp., 3.13%, 15/12/2027	176	0,04
100.000	EUR	Raytheon Technologies Corp., 2.15%, 18/05/2030	87	0,02
100.000	EUR	RELX Capital, Inc., 1.30%, 12/05/2025	95	0,02
250.000	EUR	Southern Co. (The), FRN, 1.88%, 15/09/2081	175	0,04
100.000	EUR	Southern Power Co., 1.85%, 20/06/2026	93	0,02
100.000	EUR	Stryker Corp., 1.13%, 30/11/2023	98	0,02
200.000	EUR	Stryker Corp., 0.25%, 03/12/2024	188	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	164	0,03
100.000	EUR	Stryker Corp., 2.63%, 30/11/2030	90	0,02
200.000	EUR	Stryker Corp., 1.00%, 03/12/2031	152	0,03
200.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 0.75%, 12/09/2024	192	0,04
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 0.13%, 01/03/2025	93	0,02
200.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 2.00%, 15/04/2025	195	0,04
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.40%, 23/01/2026	94	0,02
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.45%, 16/03/2027	92	0,02
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.75%, 15/04/2027	93	0,02
200.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 0.50%, 01/03/2028	171	0,04
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	91	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	89	0,02
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 2.88%, 24/07/2037	87	0,02
400.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.50%, 01/10/2039	270	0,06
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.88%, 01/10/2049	63	0,01
100.000	EUR	Toyota Motor Credit Corp., 0.63%, 21/11/2024	95	0,02
100.000	EUR	Toyota Motor Credit Corp., 0.25%, 16/07/2026	89	0,02
150.000	EUR	Toyota Motor Credit Corp., 0.13%, 05/11/2027	125	0,03
150.000	EUR	United Parcel Service, Inc., 0.38%, 15/11/2023	146	0,03
100.000	EUR	United Parcel Service, Inc., 1.63%, 15/11/2025	96	0,02



# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Stati Uniti (continua)</b>				
100.000	EUR	United Parcel Service, Inc., 1.00%, 15/11/2028	85	0,02
100.000	EUR	United Parcel Service, Inc., 1.50%, 15/11/2032	81	0,02
200.000	EUR	US Bancorp, 0.85%, 07/06/2024	192	0,04
200.000	EUR	Utah Acquisition Sub, Inc., 2.25%, 22/11/2024	193	0,04
200.000	EUR	Utah Acquisition Sub, Inc., 3.13%, 22/11/2028	175	0,04
200.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.63%, 01/03/2024	197	0,04
200.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 0.88%, 02/04/2025	190	0,04
300.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 3.25%, 17/02/2026	299	0,06
200.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.38%, 27/10/2026	186	0,04
200.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 0.88%, 08/04/2027	179	0,04
200.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.38%, 02/11/2028	177	0,04
250.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 0.38%, 22/03/2029	203	0,04
100.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.88%, 26/10/2029	89	0,02
400.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.25%, 08/04/2030	334	0,07
150.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 2.63%, 01/12/2031	136	0,03
100.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 0.88%, 19/03/2032	76	0,02
275.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 0.75%, 22/03/2032	204	0,04
275.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.30%, 18/05/2033	210	0,04
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	252	0,05
100.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.50%, 19/09/2039	67	0,01
200.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.85%, 18/05/2040	140	0,03
150.000	EUR	VF Corp., 0.63%, 20/09/2023	147	0,03
100.000	EUR	VF Corp., 0.25%, 25/02/2028	82	0,02
100.000	EUR	VF Corp., 0.63%, 25/02/2032	72	0,01
300.000	EUR	Visa, Inc., 1.50%, 15/06/2026	283	0,06
100.000	EUR	Visa, Inc., 2.00%, 15/06/2029	92	0,02
200.000	EUR	Visa, Inc., 2.38%, 15/06/2034	177	0,04
100.000	EUR	Walgreens Boots Alliance, Inc., 2.13%, 20/11/2026	94	0,02
250.000	EUR	Walmart, Inc., 2.55%, 08/04/2026	246	0,05
100.000	EUR	Walmart, Inc., 4.88%, 21/09/2029	109	0,02
100.000	EUR	Wells Fargo & Co., 0.50%, 26/04/2024	96	0,02
100.000	EUR	Wells Fargo & Co., 2.13%, 04/06/2024	98	0,02
500.000	EUR	Wells Fargo & Co., 1.63%, 02/06/2025	474	0,10
350.000	EUR	Wells Fargo & Co., 2.00%, 27/04/2026	326	0,07
400.000	EUR	Wells Fargo & Co., 1.38%, 26/10/2026	358	0,08
290.000	EUR	Wells Fargo & Co., 1.00%, 02/02/2027	253	0,05
450.000	EUR	Wells Fargo & Co., 1.50%, 24/05/2027	398	0,08
200.000	EUR	Wells Fargo & Co., 0.63%, 25/03/2030	151	0,03
200.000	EUR	Wells Fargo & Co., 0.63%, 14/08/2030	148	0,03
200.000	EUR	Wells Fargo & Co., FRN, 1.34%, 04/05/2025	192	0,04
300.000	EUR	Wells Fargo & Co., FRN, 1.74%, 04/05/2030	252	0,05
200.000	EUR	Westlake Corp., 1.63%, 17/07/2029	150	0,03
200.000	EUR	Worley US Finance Sub Ltd., 0.88%, 09/06/2026	176	0,04
100.000	EUR	Zimmer Biomet Holdings, Inc., 1.16%, 15/11/2027	85	0,02
100.000	EUR	Zimmer Biomet Holdings, Inc., FRN, 2.43%, 13/12/2026	93	0,02
		<b>Stati Uniti - Totale</b>	<b>70.821</b>	<b>15,01</b>
<b>Totale investimenti in titoli di debito societario</b>			<b>466.520</b>	<b>98,89</b>
<b>Totale investimenti in obbligazioni</b>			<b>466.520</b>	<b>98,89</b>

# BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Numero di contratti	Valuta	Importo	Descrizione	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti future</b>						
<b>Germania (31 marzo 2022: 0,01%)</b>					-	-
<b>Totale utili non realizzati su contratti future (31 marzo 2022: 0,01%)</b>					-	-
					<b>Valore equo Migliaia di EUR</b>	<b>% del valore patrimoniale netto</b>
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico					466.520	98,89
Liquidità					7	-
Strumenti liquidi equivalenti						
Partecipazione	Valuta	Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2022: 0,44%)				
		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc				
12.670	EUR	TO) <sup>2</sup>			1.243	0,27
Totale in strumenti liquidi equivalenti					1.243	0,27
Altre attività e passività					3.972	0,84
<b>Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>					<b>471.742</b>	<b>100,00</b>
<b>Analisi del totale attività</b>						<b>% del totale attività</b>
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale						98,21
Organismi di investimento collettivo						0,26
Altre attività						1,53
<b>Totale attività</b>						<b>100,00</b>

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

<sup>2</sup>Una parte correlata al Fondo.

# BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI</b>				
<b>Titoli di Stato (31 marzo 2022: 99,13%)</b>				
<b>Austria (31 marzo 2022: 3,53%)</b>				
235.000	EUR	Austria Government Bond, 1.75%, 20/10/2023	235	0,18
110.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 15/07/2024	107	0,08
320.000	EUR	Austria Government Bond, 1.65%, 21/10/2024	319	0,24
110.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/04/2025	104	0,08
350.000	EUR	Austria Government Bond, 1.20%, 20/10/2025	341	0,26
180.000	EUR	Austria Government Bond, 4.85%, 15/03/2026	197	0,15
391.000	EUR	Austria Government Bond, 0.75%, 20/10/2026	369	0,28
360.000	EUR	Austria Government Bond, 0.50%, 20/04/2027	332	0,25
50.000	EUR	Austria Government Bond, 6.25%, 15/07/2027	59	0,05
150.000	EUR	Austria Government Bond, 0.75%, 20/02/2028	137	0,11
70.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/10/2028	60	0,05
300.000	EUR	Austria Government Bond, 0.50%, 20/02/2029	264	0,20
280.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/02/2030	231	0,18
230.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/02/2031	184	0,14
130.000	EUR	Austria Government Bond, 0.90%, 20/02/2032	110	0,08
220.000	EUR	Austria Government Bond, 2.40%, 23/05/2034	209	0,16
110.000	EUR	Austria Government Bond, 0.25%, 20/10/2036	76	0,06
295.000	EUR	Austria Government Bond, 4.15%, 15/03/2037	336	0,26
100.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/10/2040	59	0,05
150.000	EUR	Austria Government Bond, 3.15%, 20/06/2044	157	0,12
177.000	EUR	Austria Government Bond, 1.50%, 20/02/2047	134	0,10
80.000	EUR	Austria Government Bond, 1.85%, 23/05/2049	65	0,05
141.000	EUR	Austria Government Bond, 0.75%, 20/03/2051	84	0,06
71.000	EUR	Austria Government Bond, 3.80%, 26/01/2062	86	0,07
70.000	EUR	Austria Government Bond, 0.70%, 20/04/2071	32	0,02
55.000	EUR	Austria Government Bond, 1.50%, 02/11/2086	34	0,03
123.000	EUR	Austria Government Bond, 2.10%, 20/09/2117	95	0,07
80.000	EUR	Austria Government Bond, 0.85%, 30/06/2120	34	0,03
		<b>Austria - Totale</b>	<b>4.450</b>	<b>3,41</b>
<b>Belgio (31 marzo 2022: 5,52%)</b>				
90.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.20%, 22/10/2023	89	0,07
335.000	EUR	Belgium Government Bond, 2.60%, 22/06/2024	339	0,26
210.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.50%, 22/10/2024	205	0,16
540.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.80%, 22/06/2025	524	0,40
171.000	EUR	Belgium Government Bond, 4.50%, 28/03/2026	185	0,14
370.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.00%, 22/06/2026	356	0,27
330.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.80%, 22/06/2027	309	0,24
110.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.00%, 22/10/2027	98	0,08
430.000	EUR	Belgium Government Bond, 5.50%, 28/03/2028	501	0,39
320.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.80%, 22/06/2028	294	0,23
330.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.90%, 22/06/2029	299	0,23
360.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.10%, 22/06/2030	301	0,23
210.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.00%, 22/06/2031	185	0,14
200.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.00%, 22/10/2031	158	0,12
288.000	EUR	Belgium Government Bond, 4.00%, 28/03/2032	320	0,25
150.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.35%, 22/06/2032	119	0,09
285.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.25%, 22/04/2033	247	0,19
195.000	EUR	Belgium Government Bond, 3.00%, 22/06/2034	197	0,15
470.000	EUR	Belgium Government Bond, 5.00%, 28/03/2035	566	0,43
101.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.45%, 22/06/2037	82	0,06
170.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.90%, 22/06/2038	145	0,11
60.000	EUR	Belgium Government Bond, 2.75%, 22/04/2039	57	0,04
153.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.40%, 22/06/2040	97	0,07
380.000	EUR	Belgium Government Bond, 4.25%, 28/03/2041	434	0,33
170.000	EUR	Belgium Government Bond, 3.75%, 22/06/2045	187	0,14
235.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.60%, 22/06/2047	176	0,14

# BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
<b>Belgio (continua)</b>				
233.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.70%, 22/06/2050	173	0,13
180.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.40%, 22/06/2053	120	0,09
125.000	EUR	Belgium Government Bond, 2.25%, 22/06/2057	106	0,08
151.000	EUR	Belgium Government Bond, 2.15%, 22/06/2066	124	0,10
115.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.65%, 22/06/2071	50	0,04
<b>Belgio - Totale</b>			<b>7.043</b>	<b>5,40</b>
<b>Cipro (31 marzo 2022: 0,14%)</b>				
90.000	EUR	Cyprus Government Bond, 4.25%, 04/11/2025	94	0,07
70.000	EUR	Cyprus Government Bond, 2.75%, 26/02/2034	62	0,05
40.000	EUR	Cyprus Government Bond, 2.75%, 03/05/2049	32	0,03
<b>Cipro - Totale</b>			<b>188</b>	<b>0,15</b>
<b>Estonia (31 marzo 2022: 0,04%)</b>				
70.000	EUR	Estonia Government Bond, 0.13%, 10/06/2030	55	0,04
<b>Estonia - Totale</b>			<b>55</b>	<b>0,04</b>
<b>Finlandia (31 marzo 2022: 1,44%)</b>				
80.000	EUR	Finland Government Bond, 0.00%, 15/09/2023	79	0,06
25.000	EUR	Finland Government Bond, 2.00%, 15/04/2024	25	0,02
360.000	EUR	Finland Government Bond, 4.00%, 04/07/2025	380	0,29
85.000	EUR	Finland Government Bond, 0.88%, 15/09/2025	82	0,06
100.000	EUR	Finland Government Bond, 0.00%, 15/09/2026	91	0,07
190.000	EUR	Finland Government Bond, 0.50%, 15/09/2027	174	0,13
80.000	EUR	Finland Government Bond, 2.75%, 04/07/2028	81	0,06
63.000	EUR	Finland Government Bond, 0.50%, 15/09/2028	56	0,04
250.000	EUR	Finland Government Bond, 0.50%, 15/09/2029	218	0,17
125.000	EUR	Finland Government Bond, 0.75%, 15/04/2031	107	0,08
70.000	EUR	Finland Government Bond, 0.13%, 15/09/2031	56	0,04
60.000	EUR	Finland Government Bond, 1.50%, 15/09/2032	53	0,04
140.000	EUR	Finland Government Bond, 1.13%, 15/04/2034	117	0,09
90.000	EUR	Finland Government Bond, 0.13%, 15/04/2036	63	0,05
71.000	EUR	Finland Government Bond, 0.25%, 15/09/2040	45	0,04
115.000	EUR	Finland Government Bond, 2.63%, 04/07/2042	111	0,09
80.000	EUR	Finland Government Bond, 0.50%, 15/04/2043	51	0,04
80.000	EUR	Finland Government Bond, 1.38%, 15/04/2047	61	0,05
90.000	EUR	Finland Government Bond, 0.13%, 15/04/2052	44	0,03
<b>Finlandia - Totale</b>			<b>1.894</b>	<b>1,45</b>
<b>Francia (31 marzo 2022: 24,20%)</b>				
865.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.25%, 25/10/2023	887	0,68
650.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2024	634	0,49
840.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/03/2024	818	0,63
881.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.25%, 25/05/2024	887	0,68
780.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.75%, 25/11/2024	777	0,60
110.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2025	105	0,08
1.050.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/03/2025	1.000	0,77
920.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2025	885	0,68
540.000	EUR	France Government Bond OAT, 6.00%, 25/10/2025	603	0,46
750.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.00%, 25/11/2025	727	0,56
790.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2026	737	0,56
1.127.000	EUR	France Government Bond OAT, 3.50%, 25/04/2026	1.181	0,91
912.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2026	862	0,66
960.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.25%, 25/11/2026	888	0,68
570.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2027	518	0,40

NM1222U-2615757-110/212

# BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
<b>Francia (continua)</b>				
740.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.00%, 25/05/2027	700	0,54
1.220.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.75%, 25/10/2027	1.247	0,96
340.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/02/2028	313	0,24
1.172.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2028	1.075	0,82
814.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/11/2028	740	0,57
1.075.000	EUR	France Government Bond OAT, 5.50%, 25/04/2029	1.273	0,98
934.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2029	828	0,63
860.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/11/2029	726	0,56
1.115.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.50%, 25/05/2030	1.126	0,86
1.030.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/11/2030	844	0,65
1.095.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2031	1.015	0,78
1.090.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/11/2031	864	0,66
707.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/05/2032	550	0,42
702.000	EUR	France Government Bond OAT, 5.75%, 25/10/2032	887	0,68
230.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.00%, 25/11/2032	215	0,16
770.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.25%, 25/05/2034	649	0,50
575.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.75%, 25/04/2035	682	0,52
855.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.25%, 25/05/2036	694	0,53
70.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.25%, 25/05/2038	55	0,04
555.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.00%, 25/10/2038	621	0,48
630.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.75%, 25/06/2039	532	0,41
490.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2040	322	0,25
740.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.50%, 25/04/2041	885	0,68
70.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.50%, 25/05/2043	64	0,05
310.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/06/2044	190	0,15
646.000	EUR	France Government Bond OAT, 3.25%, 25/05/2045	672	0,51
570.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.00%, 25/05/2048	469	0,36
653.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2050	471	0,36
694.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2052	394	0,30
380.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2053	211	0,16
400.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.00%, 25/04/2055	479	0,37
362.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.00%, 25/04/2060	437	0,33
251.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.75%, 25/05/2066	181	0,14
210.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2072	83	0,06
<b>Francia - Totale</b>			<b>32.003</b>	<b>24,55</b>
<b>Germania (31 marzo 2022: 17,90%)</b>				
330.000	EUR	Bundesobligation, 0.00%, 13/10/2023	324	0,25
520.000	EUR	Bundesobligation, 0.00%, 05/04/2024	508	0,39
426.000	EUR	Bundesobligation, 0.00%, 18/10/2024	412	0,32
390.000	EUR	Bundesobligation, 0.00%, 11/04/2025	374	0,29
260.000	EUR	Bundesobligation, 0.00%, 10/10/2025	247	0,19
540.000	EUR	Bundesobligation, 0.00%, 10/04/2026	508	0,39
551.000	EUR	Bundesobligation, 0.00%, 09/10/2026	512	0,39
260.000	EUR	Bundesobligation, 1.30%, 15/10/2027	252	0,19
340.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.25%, 04/01/2024	360	0,28
460.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.75%, 15/02/2024	461	0,35
539.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.50%, 15/05/2024	538	0,41
484.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.00%, 15/08/2024	479	0,37
583.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.50%, 15/02/2025	567	0,43
870.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.00%, 15/08/2025	852	0,65
640.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.50%, 15/02/2026	614	0,47
660.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2026	616	0,47
725.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/02/2027	677	0,52
370.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.50%, 04/07/2027	445	0,34
691.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.50%, 15/08/2027	648	0,50
490.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/11/2027	445	0,34

# BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
<b>Germania (continua)</b>				
315.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.63%, 04/01/2028	372	0,29
470.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.50%, 15/02/2028	436	0,33
370.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.75%, 04/07/2028	425	0,33
626.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/08/2028	568	0,44
450.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/11/2028	400	0,31
460.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/02/2029	413	0,32
500.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2029	437	0,33
352.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.25%, 04/01/2030	452	0,35
480.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/02/2030	415	0,32
610.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2030	522	0,40
150.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2030	128	0,10
530.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.50%, 04/01/2031	669	0,51
450.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/02/2031	381	0,29
530.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2031	443	0,34
290.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2031	243	0,19
600.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/02/2032	495	0,38
290.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.70%, 15/08/2032	279	0,21
500.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.75%, 04/07/2034	635	0,49
450.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/05/2035	341	0,26
570.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/05/2036	423	0,32
570.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.00%, 04/01/2037	694	0,53
390.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.25%, 04/07/2039	500	0,38
417.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.75%, 04/07/2040	571	0,44
411.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 3.25%, 04/07/2042	481	0,37
550.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.50%, 04/07/2044	584	0,45
571.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.50%, 15/08/2046	613	0,47
619.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.25%, 15/08/2048	515	0,39
619.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2050	347	0,27
280.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2050	158	0,12
320.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2052	172	0,13
250.000	EUR	Bundesschatzanweisungen, 0.00%, 15/12/2023	245	0,19
470.000	EUR	Bundesschatzanweisungen, 0.20%, 14/06/2024	458	0,35
<b>Germania - Totale</b>			<b>23.654</b>	<b>18,14</b>
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 1,90%)</b>				
188.000	EUR	Ireland Government Bond, 3.40%, 18/03/2024	192	0,15
160.000	EUR	Ireland Government Bond, 5.40%, 13/03/2025	173	0,13
275.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.00%, 15/05/2026	265	0,20
128.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.20%, 15/05/2027	117	0,09
185.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.90%, 15/05/2028	171	0,13
145.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.10%, 15/05/2029	134	0,10
195.000	EUR	Ireland Government Bond, 2.40%, 15/05/2030	195	0,15
207.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.20%, 18/10/2030	173	0,13
170.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.35%, 18/03/2031	156	0,12
211.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.00%, 18/10/2031	168	0,13
40.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.35%, 18/10/2032	32	0,02
70.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.30%, 15/05/2033	61	0,05
140.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.40%, 15/05/2035	105	0,08
130.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.70%, 15/05/2037	112	0,09
90.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.55%, 22/04/2041	58	0,04
210.000	EUR	Ireland Government Bond, 2.00%, 18/02/2045	176	0,14
140.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.50%, 15/05/2050	101	0,08
<b>Irlanda - Totale</b>			<b>2.389</b>	<b>1,83</b>
<b>Italia (31 marzo 2022: 21,75%)</b>				
300.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.45%, 01/10/2023	300	0,23



# BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
<b>Italia (continua)</b>				
491.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.65%, 15/10/2023	483	0,37
310.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 9.00%, 01/11/2023	332	0,25
217.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.00%, 15/01/2024	210	0,16
320.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.00%, 30/01/2024	309	0,24
750.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.50%, 01/03/2024	768	0,59
380.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.00%, 15/04/2024	365	0,28
240.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.75%, 01/07/2024	236	0,18
390.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.00%, 15/08/2024	370	0,28
600.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.75%, 01/09/2024	610	0,47
400.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.45%, 15/11/2024	388	0,30
500.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.50%, 01/12/2024	495	0,38
450.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.35%, 01/02/2025	423	0,32
530.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.00%, 01/03/2025	553	0,42
470.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.45%, 15/05/2025	449	0,35
360.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.50%, 01/06/2025	344	0,26
410.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.85%, 01/07/2025	394	0,31
620.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.50%, 15/11/2025	605	0,46
560.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.00%, 01/12/2025	539	0,41
460.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.50%, 01/02/2026	419	0,32
490.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.50%, 01/03/2026	509	0,39
150.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.00%, 01/04/2026	133	0,10
201.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.60%, 01/06/2026	189	0,15
170.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.10%, 15/07/2026	162	0,12
310.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.00%, 01/08/2026	271	0,21
280.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 7.25%, 01/11/2026	321	0,25
710.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.25%, 01/12/2026	649	0,50
427.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.85%, 15/01/2027	382	0,29
390.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.20%, 01/06/2027	366	0,28
400.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.05%, 01/08/2027	372	0,29
400.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 15/09/2027	351	0,27
950.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.50%, 01/11/2027	1.076	0,83
110.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.65%, 01/12/2027	104	0,08
520.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.00%, 01/02/2028	476	0,37
390.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.25%, 15/03/2028	322	0,25
270.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.50%, 15/07/2028	223	0,17
395.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.75%, 01/09/2028	413	0,32
390.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.80%, 01/12/2028	368	0,28
250.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.45%, 15/02/2029	201	0,15
420.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.00%, 01/08/2029	396	0,30
645.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.25%, 01/11/2029	698	0,54
619.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.50%, 01/03/2030	599	0,46
438.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.35%, 01/04/2030	361	0,28
480.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 01/08/2030	378	0,29
750.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.65%, 01/12/2030	619	0,48
410.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.90%, 01/04/2031	313	0,24
660.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.00%, 01/05/2031	747	0,57
330.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.60%, 01/08/2031	241	0,19
450.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 01/12/2031	336	0,26
635.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.65%, 01/03/2032	505	0,39
230.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 01/06/2032	169	0,13
200.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.50%, 01/12/2032	168	0,13
390.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.75%, 01/02/2033	432	0,33
416.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.45%, 01/09/2033	343	0,26
461.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.00%, 01/08/2034	484	0,37
370.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.35%, 01/03/2035	330	0,25
110.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.00%, 30/04/2035	105	0,08
290.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.45%, 01/03/2036	204	0,16
320.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.25%, 01/09/2036	249	0,19

# BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
<b>Italia (continua)</b>				
570.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.00%, 01/02/2037	545	0,42
367.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 01/03/2037	234	0,18
330.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.95%, 01/09/2038	273	0,21
490.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.00%, 01/08/2039	521	0,40
224.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.10%, 01/03/2040	187	0,14
480.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.00%, 01/09/2040	510	0,39
320.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.80%, 01/03/2041	214	0,16
380.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.75%, 01/09/2044	396	0,30
230.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.50%, 30/04/2045	136	0,10
348.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.25%, 01/09/2046	290	0,22
360.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.70%, 01/03/2047	272	0,21
380.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.45%, 01/03/2048	326	0,25
270.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.85%, 01/09/2049	246	0,19
320.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.45%, 01/09/2050	222	0,17
340.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.70%, 01/09/2051	199	0,15
170.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.15%, 01/09/2052	108	0,08
200.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.80%, 01/03/2067	142	0,11
100.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.15%, 01/03/2072	60	0,05
<b>Italia - Totale</b>			<b>28.038</b>	<b>21,51</b>
<b>Lettonia (31 marzo 2022: 0,08%)</b>				
100.000	EUR	Latvia Government Bond, 2.25%, 15/02/2047	84	0,06
<b>Lettonia - Totale</b>			<b>84</b>	<b>0,06</b>
<b>Lituania (31 marzo 2022: 0,11%)</b>				
130.000	EUR	Lithuania Government Bond, 3.38%, 22/01/2024	131	0,10
30.000	EUR	Lithuania Government Bond, 0.95%, 26/05/2027	27	0,02
20.000	EUR	Lithuania Government Bond, 0.50%, 19/06/2029	16	0,01
30.000	EUR	Lithuania Government Bond, 2.13%, 22/10/2035	25	0,02
70.000	EUR	Lithuania Government Bond, 1.63%, 19/06/2049	49	0,04
20.000	EUR	Lithuania Government Bond, 0.50%, 28/07/2050	9	0,01
<b>Lituania - Totale</b>			<b>257</b>	<b>0,20</b>
<b>Lussemburgo (31 marzo 2022: 0,18%)</b>				
150.000	EUR	Luxembourg Government Bond, 0.00%, 13/11/2026	134	0,10
20.000	EUR	Luxembourg Government Bond, 0.63%, 01/02/2027	18	0,02
70.000	EUR	State of the Grand-Duchy of Luxembourg, 0.00%, 14/09/2032	53	0,04
<b>Lussemburgo - Totale</b>			<b>205</b>	<b>0,16</b>
<b>Paesi Bassi (31 marzo 2022: 4,65%)</b>				
300.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/01/2024	294	0,23
295.000	EUR	Netherlands Government Bond, 2.00%, 15/07/2024	297	0,23
465.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.25%, 15/07/2025	445	0,34
400.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.50%, 15/07/2026	379	0,29
396.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/01/2027	363	0,28
190.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.75%, 15/07/2027	179	0,14
280.000	EUR	Netherlands Government Bond, 5.50%, 15/01/2028	326	0,25
410.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.75%, 15/07/2028	379	0,29
190.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/01/2029	165	0,13
215.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.25%, 15/07/2029	188	0,14
330.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/07/2030	277	0,21
240.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/07/2031	197	0,15
110.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.50%, 15/07/2032	92	0,07
333.000	EUR	Netherlands Government Bond, 2.50%, 15/01/2033	335	0,26
410.000	EUR	Netherlands Government Bond, 4.00%, 15/01/2037	476	0,36

# BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
<b>Paesi Bassi (continua)</b>				
110.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/01/2038	74	0,06
310.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.50%, 15/01/2040	220	0,17
385.000	EUR	Netherlands Government Bond, 3.75%, 15/01/2042	455	0,35
399.000	EUR	Netherlands Government Bond, 2.75%, 15/01/2047	422	0,32
280.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/01/2052	141	0,11
90.000	EUR	Netherlands Government Bond, 2.00%, 15/01/2054	81	0,06
<b>Paesi Bassi - Totale</b>			<b>5.785</b>	<b>4,44</b>
<b>Portogallo (31 marzo 2022: 2,25%)</b>				
270.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4.95%, 25/10/2023	279	0,21
210.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 5.65%, 15/02/2024	220	0,17
165.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.88%, 15/10/2025	169	0,13
356.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.88%, 21/07/2026	364	0,28
200.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4.13%, 14/04/2027	215	0,16
130.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.70%, 15/10/2027	119	0,09
290.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.13%, 17/10/2028	281	0,22
170.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.95%, 15/06/2029	162	0,12
230.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 3.88%, 15/02/2030	246	0,19
226.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.48%, 18/10/2030	187	0,14
50.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.30%, 17/10/2031	39	0,03
255.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.25%, 18/04/2034	233	0,18
30.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.90%, 12/10/2035	22	0,02
250.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4.10%, 15/04/2037	270	0,21
60.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.15%, 11/04/2042	40	0,03
90.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4.10%, 15/02/2045	99	0,08
60.000	EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.00%, 12/04/2052	32	0,02
<b>Portogallo - Totale</b>			<b>2.977</b>	<b>2,28</b>
<b>Slovacchia (31 marzo 2022: 0,68%)</b>				
180.000	EUR	Slovakia Government Bond, 3.38%, 15/11/2024	184	0,14
50.000	EUR	Slovakia Government Bond, 4.35%, 14/10/2025	53	0,04
70.000	EUR	Slovakia Government Bond, 1.38%, 21/01/2027	67	0,05
170.000	EUR	Slovakia Government Bond, 3.63%, 16/01/2029	179	0,14
145.000	EUR	Slovakia Government Bond, 0.75%, 09/04/2030	122	0,09
20.000	EUR	Slovakia Government Bond, 1.00%, 09/10/2030	17	0,01
80.000	EUR	Slovakia Government Bond, 1.63%, 21/01/2031	71	0,05
64.000	EUR	Slovakia Government Bond, 1.00%, 14/05/2032	52	0,04
110.000	EUR	Slovakia Government Bond, 1.88%, 09/03/2037	87	0,07
50.000	EUR	Slovakia Government Bond, 2.00%, 17/10/2047	37	0,03
20.000	EUR	Slovakia Government Bond, 1.00%, 13/10/2051	11	0,01
10.000	EUR	Slovakia Government Bond, 2.25%, 12/06/2068	8	0,01
<b>Slovacchia - Totale</b>			<b>888</b>	<b>0,68</b>
<b>Slovenia (31 marzo 2022: 0,48%)</b>				
10.000	EUR	Slovenia Government Bond, 2.13%, 28/07/2025	10	0,01
40.000	EUR	Slovenia Government Bond, 5.13%, 30/03/2026	44	0,04
10.000	EUR	Slovenia Government Bond, 1.25%, 22/03/2027	10	0,01
190.000	EUR	Slovenia Government Bond, 1.00%, 06/03/2028	174	0,13
30.000	EUR	Slovenia Government Bond, 1.19%, 14/03/2029	27	0,02
13.000	EUR	Slovenia Government Bond, 0.88%, 15/07/2030	11	0,01
60.000	EUR	Slovenia Government Bond, 2.25%, 03/03/2032	55	0,04
66.000	EUR	Slovenia Government Bond, 1.50%, 25/03/2035	53	0,04
70.000	EUR	Slovenia Government Bond, 1.75%, 03/11/2040	52	0,04
72.000	EUR	Slovenia Government Bond, 3.13%, 07/08/2045	67	0,05

# BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
		<b>Slovenia (continua)</b>		
23.000	EUR	Slovenia Government Bond, 1.18%, 13/02/2062	13	0,01
		<b>Slovenia - Totale</b>	<b>516</b>	<b>0,40</b>
		<b>Spagna (31 marzo 2022: 14,28%)</b>		
440.000	EUR	Spain Government Bond, 4.40%, 31/10/2023	451	0,35
340.000	EUR	Spain Government Bond, 4.80%, 31/01/2024	352	0,27
490.000	EUR	Spain Government Bond, 3.80%, 30/04/2024	503	0,39
110.000	EUR	Spain Government Bond, 0.00%, 31/05/2024	106	0,08
324.000	EUR	Spain Government Bond, 0.25%, 30/07/2024	313	0,24
870.000	EUR	Spain Government Bond, 2.75%, 31/10/2024	881	0,68
290.000	EUR	Spain Government Bond, 0.00%, 31/01/2025	275	0,21
430.000	EUR	Spain Government Bond, 1.60%, 30/04/2025	423	0,32
340.000	EUR	Spain Government Bond, 4.65%, 30/07/2025	362	0,28
525.000	EUR	Spain Government Bond, 2.15%, 31/10/2025	523	0,40
420.000	EUR	Spain Government Bond, 0.00%, 31/01/2026	388	0,30
421.000	EUR	Spain Government Bond, 1.95%, 30/04/2026	414	0,32
870.000	EUR	Spain Government Bond, 5.90%, 30/07/2026	982	0,75
645.000	EUR	Spain Government Bond, 1.30%, 31/10/2026	617	0,47
460.000	EUR	Spain Government Bond, 1.50%, 30/04/2027	439	0,34
510.000	EUR	Spain Government Bond, 0.80%, 30/07/2027	468	0,36
420.000	EUR	Spain Government Bond, 1.45%, 31/10/2027	396	0,30
190.000	EUR	Spain Government Bond, 0.00%, 31/01/2028	165	0,13
506.000	EUR	Spain Government Bond, 1.40%, 30/04/2028	472	0,36
510.000	EUR	Spain Government Bond, 1.40%, 30/07/2028	472	0,36
408.000	EUR	Spain Government Bond, 5.15%, 31/10/2028	461	0,35
685.000	EUR	Spain Government Bond, 6.00%, 31/01/2029	812	0,62
440.000	EUR	Spain Government Bond, 1.45%, 30/04/2029	404	0,31
450.000	EUR	Spain Government Bond, 0.60%, 31/10/2029	385	0,30
430.000	EUR	Spain Government Bond, 0.50%, 30/04/2030	360	0,28
550.000	EUR	Spain Government Bond, 1.95%, 30/07/2030	511	0,39
502.000	EUR	Spain Government Bond, 1.25%, 31/10/2030	439	0,34
420.000	EUR	Spain Government Bond, 0.10%, 30/04/2031	327	0,25
420.000	EUR	Spain Government Bond, 0.50%, 31/10/2031	334	0,26
380.000	EUR	Spain Government Bond, 0.70%, 30/04/2032	303	0,23
525.000	EUR	Spain Government Bond, 5.75%, 30/07/2032	641	0,49
300.000	EUR	Spain Government Bond, 2.55%, 31/10/2032	281	0,22
414.000	EUR	Spain Government Bond, 2.35%, 30/07/2033	380	0,29
450.000	EUR	Spain Government Bond, 1.85%, 30/07/2035	379	0,29
455.000	EUR	Spain Government Bond, 4.20%, 31/01/2037	495	0,38
220.000	EUR	Spain Government Bond, 0.85%, 30/07/2037	152	0,12
375.000	EUR	Spain Government Bond, 4.90%, 30/07/2040	446	0,34
390.000	EUR	Spain Government Bond, 1.20%, 31/10/2040	268	0,21
440.000	EUR	Spain Government Bond, 4.70%, 30/07/2041	514	0,39
140.000	EUR	Spain Government Bond, 1.00%, 30/07/2042	91	0,07
80.000	EUR	Spain Government Bond, 3.45%, 30/07/2043	78	0,06
277.000	EUR	Spain Government Bond, 5.15%, 31/10/2044	345	0,26
396.000	EUR	Spain Government Bond, 2.90%, 31/10/2046	354	0,27
310.000	EUR	Spain Government Bond, 2.70%, 31/10/2048	264	0,20
430.000	EUR	Spain Government Bond, 1.00%, 31/10/2050	234	0,18
170.000	EUR	Spain Government Bond, 1.90%, 31/10/2052	115	0,09
295.000	EUR	Spain Government Bond, 3.45%, 30/07/2066	278	0,21

# BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
130.000	EUR	<b>Spagna (continua)</b> Spain Government Bond, 1.45%, 31/10/2071	65	0,05
		<b>Spagna - Totale</b>	<b>18.718</b>	<b>14,36</b>
<b>Totale investimenti in titoli di Stato</b>			<b>129.144</b>	<b>99,06</b>
<b>Totale investimenti in obbligazioni</b>			<b>129.144</b>	<b>99,06</b>
			<b>Valore equo</b>	<b>% del valore</b>
			<b>Migliaia di EUR</b>	<b>patrimoniale</b>
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico			129.144	99,06
Liquidità			11	0,01
Strumenti liquidi equivalenti				
Partecipazione	Valuta	Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2022: 0,23%)		
3.163	EUR	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0) <sup>1</sup>	310	0,24
<b>Totale in strumenti liquidi equivalenti</b>			<b>310</b>	<b>0,24</b>
Altre attività e passività			901	0,69
<b>Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>			<b>130.366</b>	<b>100,00</b>
<b>Analisi del totale attività</b>				<b>% del totale</b>
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale				97,98
Organismi di investimento collettivo				0,24
Altre attività				1,78
<b>Totale attività</b>				<b>100,00</b>

<sup>1</sup>Una parte correlata al Fondo.

# BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di GBP	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI</b>				
<b>Titoli di Stato (31 marzo 2022: 0,90%)</b>				
<b>Regno Unito (31 marzo 2022: 0,90%)</b>				
3.255.000	GBP	UK Treasury, 0.25%, 31/07/2031 <sup>1</sup>	2.334	1,31
		<b>Regno Unito - Totale</b>	<b>2.334</b>	<b>1,31</b>
<b>Totale investimenti in titoli di Stato</b>			<b>2.334</b>	<b>1,31</b>
<b>Titoli del debito societario (31 marzo 2022: 97,78%)</b>				
<b>Australia (31 marzo 2022: 1,67%)</b>				
400.000	GBP	APA Infrastructure Ltd., 4.25%, 26/11/2024	381	0,21
300.000	GBP	APA Infrastructure Ltd., 3.50%, 22/03/2030	240	0,14
100.000	GBP	APA Infrastructure Ltd., 3.13%, 18/07/2031	74	0,04
300.000	GBP	APA Infrastructure Ltd., 2.50%, 15/03/2036	182	0,10
246.000	GBP	BHP Billiton Finance Ltd., 3.25%, 25/09/2024	235	0,13
650.000	GBP	BHP Billiton Finance Ltd., 4.30%, 25/09/2042	532	0,30
650.000	GBP	Macquarie Group Ltd., 4.08%, 31/05/2029	540	0,30
575.000	GBP	National Australia Bank Ltd., FRN, 1.70%, 15/09/2031	449	0,25
250.000	GBP	Pacific National Finance Pty. Ltd., 5.00%, 19/09/2023	246	0,14
200.000	GBP	QBE Insurance Group Ltd., FRN, 2.50%, 13/09/2038	142	0,08
100.000	GBP	Scentre Group Trust 1, REIT, 3.88%, 16/07/2026	91	0,05
300.000	GBP	Vicinity Centres Trust, REIT, 3.38%, 07/04/2026	267	0,15
575.000	GBP	Westfield America Management Ltd., REIT, 2.63%, 30/03/2029	422	0,24
200.000	GBP	Westpac Banking Corp., 2.13%, 02/05/2025	180	0,10
		<b>Australia - Totale</b>	<b>3.981</b>	<b>2,23</b>
<b>Belgio (31 marzo 2022: 0,85%)</b>				
275.000	GBP	Anheuser-Busch InBev SA, 4.00%, 24/09/2025	259	0,14
700.000	GBP	Anheuser-Busch InBev SA, 2.25%, 24/05/2029	552	0,31
100.000	GBP	Anheuser-Busch InBev SA, 2.85%, 25/05/2037	69	0,04
275.000	GBP	Anheuser-Busch InBev SA, FRN, 9.75%, 30/07/2024	292	0,16
325.000	GBP	Euroclear Bank SA, 1.25%, 30/09/2024	296	0,17
		<b>Belgio - Totale</b>	<b>1.468</b>	<b>0,82</b>
<b>Bermuda (31 marzo 2022: 0,26%)</b>				
150.000	GBP	FIL Ltd., 7.13%, 13/02/2024	151	0,08
125.000	GBP	Hiscox Ltd., 6.00%, 22/09/2027	117	0,07
200.000	GBP	Hiscox Ltd., FRN, 6.12%, 24/11/2045	180	0,10
		<b>Bermuda - Totale</b>	<b>448</b>	<b>0,25</b>
<b>Isole Vergini britanniche (31 marzo 2022: 0,16%)</b>				
			-	-
<b>Canada (31 marzo 2022: 0,85%)</b>				
1.025.000	GBP	Bank of Montreal, 1.00%, 09/09/2026	830	0,47
800.000	GBP	Royal Bank of Canada, 1.13%, 15/12/2025	683	0,38
500.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 2.88%, 05/04/2027	427	0,24
		<b>Canada - Totale</b>	<b>1.940</b>	<b>1,09</b>
<b>Isole Cayman (31 marzo 2022: 0,69%)</b>				
91.000	GBP	South East Water Finance Ltd., 5.58%, 29/03/2029	87	0,05
144.000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd., 6.64%, 31/03/2026	144	0,08
200.000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd., 2.38%, 28/05/2028	161	0,09
300.000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd., 6.19%, 31/03/2029	299	0,17
180.000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd., 3.00%, 28/05/2037	123	0,07
100.000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd., 5.00%, 31/03/2041	91	0,05
497.000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd., 4.50%, 31/03/2052	424	0,24
		<b>Isole Cayman - Totale</b>	<b>1.329</b>	<b>0,75</b>
<b>Danimarca (31 marzo 2022: 1,13%)</b>				
500.000	GBP	Danske Bank A/S, FRN, 2.25%, 14/01/2028	401	0,23

NM1222U-2615757-118/212



# BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di GBP	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Danimarca (continua)</b>				
300.000	GBP	Orsted A/S, 2.13%, 17/05/2027	253	0,14
100.000	GBP	Orsted A/S, 4.88%, 12/01/2032	91	0,05
500.000	GBP	Orsted A/S, 2.50%, 16/05/2033	363	0,21
500.000	GBP	Orsted A/S, 5.75%, 09/04/2040	485	0,27
100.000	GBP	Orsted A/S, 5.38%, 13/09/2042	93	0,05
<b>Danimarca - Totale</b>			<b>1.686</b>	<b>0,95</b>
<b>Finlandia (31 marzo 2022: 0,17%)</b>				
475.000	GBP	Nordea Bank Abp, FRN, 1.62%, 09/12/2032	352	0,20
<b>Finlandia - Totale</b>			<b>352</b>	<b>0,20</b>
<b>Francia (31 marzo 2022: 8,18%)</b>				
518.000	GBP	AXA SA, FRN, 5.63%, 16/01/2054	422	0,24
500.000	GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.25%, 18/12/2023	480	0,27
500.000	GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.25%, 05/12/2025	431	0,24
1.200.000	GBP	BNP Paribas SA, 1.88%, 14/12/2027	934	0,53
600.000	GBP	BNP Paribas SA, 1.25%, 13/07/2031	384	0,22
400.000	GBP	BNP Paribas SA, 2.00%, 13/09/2036	234	0,13
700.000	GBP	BNP Paribas SA, FRN, 2.00%, 24/05/2031	560	0,31
700.000	GBP	BPCE SA, 5.25%, 16/04/2029	607	0,34
250.000	GBP	Credit Agricole SA, 7.38%, 18/12/2023	252	0,14
300.000	GBP	Credit Agricole SA, FRN, 1.87%, 09/12/2031	232	0,13
250.000	GBP	Electricite de France SA, 6.25%, 30/05/2028	243	0,14
583.000	GBP	Electricite de France SA, 5.88%, 18/07/2031	547	0,31
700.000	GBP	Electricite de France SA, 6.13%, 02/06/2034	660	0,37
900.000	GBP	Electricite de France SA, 5.50%, 17/10/2041	772	0,43
600.000	GBP	Electricite de France SA, 5.13%, 22/09/2050	491	0,28
700.000	GBP	Electricite de France SA, 6.00%, 23/01/2114	618	0,35
300.000	GBP	Engie SA, 7.00%, 30/10/2028	306	0,17
650.000	GBP	Engie SA, 5.00%, 01/10/2060	566	0,32
300.000	GBP	Orange SA, 5.25%, 05/12/2025	294	0,17
475.000	GBP	Orange SA, 8.13%, 20/11/2028	522	0,29
300.000	GBP	Orange SA, 3.25%, 15/01/2032	242	0,14
425.000	GBP	Orange SA, 5.63%, 23/01/2034	413	0,23
300.000	GBP	Orange SA, 5.38%, 22/11/2050	292	0,16
200.000	GBP	Sodexo SA, 1.75%, 26/06/2028	158	0,09
300.000	GBP	Suez SA, 5.38%, 02/12/2030	288	0,16
500.000	GBP	TotalEnergies Capital International SA, 1.66%, 22/07/2026	429	0,24
800.000	GBP	TotalEnergies Capital International SA, 1.41%, 03/09/2031 <sup>1</sup>	577	0,32
150.000	GBP	Veolia Environnement SA, 6.13%, 29/10/2037	149	0,08
300.000	GBP	Vinci SA, 2.25%, 15/03/2027	257	0,15
300.000	GBP	Vinci SA, 2.75%, 15/09/2034	220	0,12
<b>Francia - Totale</b>			<b>12.580</b>	<b>7,07</b>
<b>Germania (31 marzo 2022: 1,61%)</b>				
1.000.000	GBP	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.88%, 13/02/2026	891	0,50
300.000	GBP	Deutsche Bank AG, 3.88%, 12/02/2024	287	0,16
800.000	GBP	Deutsche Bank AG, 2.63%, 16/12/2024	722	0,41
500.000	GBP	Deutsche Bank AG, FRN, 4.00%, 24/06/2026	450	0,25
300.000	GBP	Deutsche Bank AG, FRN, 1.88%, 22/12/2028	222	0,13
91.000	GBP	Deutsche Telekom AG, 3.13%, 06/02/2034	70	0,04
500.000	GBP	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 1.50%, 03/02/2025	444	0,25
<b>Germania - Totale</b>			<b>3.086</b>	<b>1,74</b>
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 0,67%)</b>				
400.000	GBP	GE Capital UK Funding Unlimited Co., 4.13%, 13/09/2023	393	0,22
250.000	GBP	GE Capital UK Funding Unlimited Co., 5.88%, 18/01/2033	235	0,13

# BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di GBP	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Irlanda (continua)</b>				
250.000	GBP	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co., FRN, 5.13%, 23/11/2052	207	0,12
		<b>Irlanda - Totale</b>	<b>835</b>	<b>0,47</b>
<b>Italia (31 marzo 2022: 0,45%)</b>				
200.000	GBP	Intesa Sanpaolo SpA, 2.50%, 15/01/2030	144	0,08
200.000	GBP	Intesa Sanpaolo SpA, 2.63%, 11/03/2036	116	0,07
		<b>Italia - Totale</b>	<b>260</b>	<b>0,15</b>
<b>Jersey (31 marzo 2022: 3,57%)</b>				
250.000	GBP	Gatwick Funding Ltd., 5.25%, 23/01/2026	245	0,14
275.000	GBP	Gatwick Funding Ltd., 4.63%, 27/03/2036	222	0,12
150.000	GBP	Gatwick Funding Ltd., 5.75%, 23/01/2039	130	0,07
100.000	GBP	Gatwick Funding Ltd., 3.13%, 28/09/2041	62	0,03
200.000	GBP	Gatwick Funding Ltd., 3.25%, 26/02/2048	117	0,07
555.000	GBP	Gatwick Funding Ltd., 2.63%, 07/10/2048	282	0,16
100.000	GBP	Gatwick Funding Ltd., 2.88%, 05/07/2051	53	0,03
1.095.000	GBP	Glencore Finance Europe Ltd., 3.13%, 26/03/2026	948	0,53
175.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 5.23%, 15/02/2023	175	0,10
325.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 7.13%, 14/02/2024	321	0,18
650.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 6.75%, 03/12/2028	637	0,36
100.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 7.08%, 04/08/2030	99	0,06
1.000.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 2.75%, 13/10/2031	762	0,43
850.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 6.45%, 10/12/2033	820	0,46
375.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 4.63%, 31/10/2046	282	0,16
605.000	GBP	Heathrow Funding Ltd., 2.75%, 09/08/2051	325	0,18
		<b>Jersey - Totale</b>	<b>5.480</b>	<b>3,08</b>
<b>Lussemburgo (31 marzo 2022: 1,33%)</b>				
300.000	GBP	Aroundtown SA, REIT, FRN, 4.75%, 25/06/2024 <sup>2</sup>	206	0,12
525.000	GBP	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 2.00%, 20/10/2025	440	0,25
525.000	GBP	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 2.63%, 20/10/2028	386	0,22
350.000	GBP	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 2.00%, 17/10/2027	274	0,15
200.000	GBP	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 2.63%, 17/10/2034	125	0,07
525.000	GBP	CPI Property Group SA, REIT, FRN, 2.75%, 22/01/2028	359	0,20
300.000	GBP	Logicor Financing Sarl, REIT, 2.75%, 15/01/2030	223	0,12
182.000	GBP	Nestle Finance International Ltd., 2.25%, 30/11/2023	176	0,10
250.000	GBP	Prologis International Funding II SA, REIT, 2.75%, 22/02/2032	188	0,11
175.000	GBP	Prologis International Funding II SA, REIT, 3.00%, 22/02/2042	115	0,06
		<b>Lussemburgo - Totale</b>	<b>2.492</b>	<b>1,40</b>
<b>Messico (31 marzo 2022: 0,83%)</b>				
500.000	GBP	America Movil SAB de CV, 5.00%, 27/10/2026	472	0,27
600.000	GBP	America Movil SAB de CV, 4.95%, 22/07/2033	531	0,30
390.000	GBP	America Movil SAB de CV, 4.38%, 07/08/2041	307	0,17
		<b>Messico - Totale</b>	<b>1.310</b>	<b>0,74</b>
<b>Paesi Bassi (31 marzo 2022: 8,42%)</b>				
400.000	GBP	Aegon NV, 6.63%, 16/12/2039	425	0,24
600.000	GBP	Allianz Finance II BV, 4.50%, 13/03/2043	530	0,30
600.000	GBP	Cooperatieve Rabobank UA, 1.25%, 14/01/2025	533	0,30
275.000	GBP	Cooperatieve Rabobank UA, 5.25%, 14/09/2027	248	0,14
775.000	GBP	Cooperatieve Rabobank UA, 4.63%, 23/05/2029	654	0,37
100.000	GBP	Cooperatieve Rabobank UA, 5.25%, 23/05/2041	100	0,06
250.000	GBP	Cooperatieve Rabobank UA, 5.38%, 03/08/2060	270	0,15
272.000	GBP	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.25%, 06/10/2023	261	0,15
400.000	GBP	Deutsche Telekom International Finance BV, 8.88%, 27/11/2028	454	0,25

# BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di GBP	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Paesi Bassi (continua)</b>				
484.000	GBP	Deutsche Telekom International Finance BV, 2.25%, 13/04/2029	386	0,22
100.000	GBP	Deutsche Telekom International Finance BV, FRN, 7.63%, 15/06/2030	110	0,06
363.000	GBP	E.ON International Finance BV, 5.63%, 06/12/2023	361	0,20
150.000	GBP	E.ON International Finance BV, 6.25%, 03/06/2030	145	0,08
900.000	GBP	E.ON International Finance BV, 4.75%, 31/01/2034	750	0,42
400.000	GBP	E.ON International Finance BV, 6.75%, 27/01/2039	393	0,22
950.000	GBP	E.ON International Finance BV, 6.13%, 06/07/2039	879	0,49
150.000	GBP	EDP Finance BV, 8.63%, 04/01/2024	155	0,09
650.000	GBP	Enel Finance International NV, 5.63%, 14/08/2024	640	0,36
1.040.000	GBP	Enel Finance International NV, 5.75%, 14/09/2040	926	0,52
300.000	GBP	ING Groep NV, 3.00%, 18/02/2026	264	0,15
900.000	GBP	ING Groep NV, FRN, 1.12%, 07/12/2028	667	0,38
450.000	GBP	JT International Financial Services BV, 2.75%, 28/09/2033	319	0,18
150.000	GBP	Koninklijke KPN NV, 5.00%, 18/11/2026	139	0,08
825.000	GBP	Koninklijke KPN NV, 5.75%, 17/09/2029	763	0,43
700.000	GBP	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.63%, 11/11/2024 <sup>1</sup>	643	0,36
200.000	GBP	Shell International Finance BV, 1.00%, 10/12/2030	140	0,08
400.000	GBP	Shell International Finance BV, 1.75%, 10/09/2052	186	0,10
500.000	GBP	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.75%, 10/09/2025 <sup>1</sup>	463	0,26
500.000	GBP	Volkswagen Financial Services NV, 2.75%, 10/07/2023	487	0,27
300.000	GBP	Volkswagen Financial Services NV, 2.13%, 27/06/2024 <sup>1</sup>	278	0,16
166.000	GBP	Volkswagen Financial Services NV, 2.25%, 12/04/2025	149	0,08
300.000	GBP	Volkswagen Financial Services NV, 1.13%, 05/07/2026	242	0,14
400.000	GBP	Volkswagen International Finance NV, 3.38%, 16/11/2026 <sup>1</sup>	345	0,19
400.000	GBP	Volkswagen International Finance NV, 4.13%, 17/11/2031 <sup>1</sup>	324	0,18
		<b>Paesi Bassi - Totale</b>	<b>13.629</b>	<b>7,66</b>
<b>Norvegia (31 marzo 2022: 0,99%)</b>				
1.075.000	GBP	DNB Bank ASA, FRN, 2.63%, 10/06/2026	978	0,55
227.000	GBP	Equinor ASA, 6.13%, 27/11/2028	230	0,13
475.000	GBP	Equinor ASA, 6.88%, 11/03/2031	513	0,29
375.000	GBP	Equinor ASA, 4.25%, 10/04/2041	313	0,17
		<b>Norvegia - Totale</b>	<b>2.034</b>	<b>1,14</b>
<b>Spagna (31 marzo 2022: 2,16%)</b>				
800.000	GBP	Abertis Infraestructuras SA, 3.38%, 27/11/2026	681	0,38
400.000	GBP	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 3.10%, 15/07/2031	323	0,18
500.000	GBP	Banco Santander SA, 2.75%, 12/09/2023	484	0,27
1.000.000	GBP	Banco Santander SA, 1.75%, 17/02/2027	787	0,44
500.000	GBP	Banco Santander SA, FRN, 2.25%, 04/10/2032	370	0,21
500.000	GBP	CaixaBank SA, FRN, 1.50%, 03/12/2026	415	0,23
600.000	GBP	CaixaBank SA, FRN, 3.50%, 06/04/2028	501	0,28
500.000	GBP	Iberdrola Finanzas SA, 7.38%, 29/01/2024 <sup>1</sup>	508	0,29
300.000	GBP	Telefonica Emisiones SA, 5.38%, 02/02/2026	287	0,16
500.000	GBP	Telefonica Emisiones SA, 5.45%, 08/10/2029	458	0,26
		<b>Spagna - Totale</b>	<b>4.814</b>	<b>2,70</b>
<b>Svezia (31 marzo 2022: 0,59%)</b>				
200.000	GBP	Akelius Residential Property AB, REIT, FRN, 2.38%, 15/08/2025	175	0,10
275.000	GBP	Investor AB, 5.50%, 05/05/2037	272	0,16
225.000	GBP	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 4.62%, 23/08/2032	196	0,11
375.000	GBP	Vattenfall AB, 6.88%, 15/04/2039	415	0,23
435.000	GBP	Vattenfall AB, FRN, 2.50%, 29/06/2083	329	0,18
		<b>Svezia - Totale</b>	<b>1.387</b>	<b>0,78</b>
<b>Svizzera (31 marzo 2022: 0,23%)</b>				
600.000	GBP	Credit Suisse Group AG, FRN, 2.13%, 12/09/2025	537	0,30
500.000	GBP	Credit Suisse Group AG, FRN, 7.00%, 30/09/2027	474	0,27

# BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di GBP	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Svizzera (continua)</b>				
500.000	GBP	Credit Suisse Group AG, FRN, 7.38%, 07/09/2033	466	0,26
<b>Svizzera - Totale</b>			<b>1.477</b>	<b>0,83</b>
<b>Regno Unito (31 marzo 2022: 44,79%)</b>				
250.000	GBP	3i Group plc, 6.88%, 09/03/2023	251	0,14
150.000	GBP	3i Group plc, 5.75%, 03/12/2032	138	0,08
225.000	GBP	3i Group plc, 3.75%, 05/06/2040	153	0,09
200.000	GBP	A2Dominion Housing Group Ltd., REIT, 3.50%, 15/11/2028	172	0,10
302.000	GBP	ABP Finance plc, 6.25%, 14/12/2026	299	0,17
400.000	GBP	Affinity Water Finance plc, 4.50%, 31/03/2036	352	0,20
475.000	GBP	Anglian Water Osprey Financing plc, 2.00%, 31/07/2028	343	0,19
150.000	GBP	Anglian Water Services Financing plc, 1.63%, 10/08/2025	133	0,07
500.000	GBP	Anglian Water Services Financing plc, 4.50%, 05/10/2027	465	0,26
121.000	GBP	Anglian Water Services Financing plc, 6.29%, 30/07/2030	123	0,07
33.000	GBP	Anglian Water Services Financing plc, FRN, 6.87%, 21/08/2023	33	0,02
182.000	GBP	Anglian Water Services Financing plc, FRN, 6.63%, 15/01/2029	187	0,11
400.000	GBP	Anglo American Capital plc, 3.38%, 11/03/2029	316	0,18
275.000	GBP	Annington Funding plc, REIT, 2.65%, 12/07/2025 <sup>1</sup>	244	0,14
700.000	GBP	Annington Funding plc, REIT, 3.18%, 12/07/2029	550	0,31
175.000	GBP	Annington Funding plc, REIT, 2.31%, 06/10/2032	118	0,07
200.000	GBP	Annington Funding plc, REIT, 4.75%, 09/08/2033	164	0,09
155.000	GBP	Annington Funding plc, REIT, 3.69%, 12/07/2034	115	0,06
650.000	GBP	Annington Funding plc, REIT, 3.94%, 12/07/2047	441	0,25
100.000	GBP	Annington Funding plc, REIT, 2.92%, 06/10/2051	54	0,03
210.000	GBP	Arqiva Financing plc, 4.88%, 31/12/2032	196	0,11
275.000	GBP	Associated British Foods plc, 2.50%, 16/06/2034 <sup>1</sup>	193	0,11
530.000	GBP	Aviva plc, FRN, 6.12%, 14/11/2036	489	0,28
100.000	GBP	Aviva plc, FRN, 4.38%, 12/09/2049	80	0,04
187.000	GBP	Aviva plc, FRN, 5.13%, 04/06/2050	153	0,09
325.000	GBP	Aviva plc, FRN, 4.00%, 03/06/2055	218	0,12
474.000	GBP	Aviva plc, FRN, 6.88%, 20/05/2058	429	0,24
853.000	GBP	Barclays plc, 3.13%, 17/01/2024	819	0,46
200.000	GBP	Barclays plc, 3.00%, 08/05/2026	172	0,10
1.125.000	GBP	Barclays plc, 3.25%, 12/02/2027	948	0,53
650.000	GBP	Barclays plc, 3.25%, 17/01/2033	462	0,26
300.000	GBP	Barclays plc, FRN, 3.75%, 22/11/2030	262	0,15
850.000	GBP	BAT International Finance plc, 7.25%, 12/03/2024	850	0,48
350.000	GBP	BAT International Finance plc, 4.00%, 04/09/2026	306	0,17
650.000	GBP	BAT International Finance plc, 6.00%, 24/11/2034 <sup>1</sup>	528	0,30
400.000	GBP	BAT International Finance plc, 2.25%, 09/09/2052	161	0,09
250.000	GBP	BAT International Finance plc, 4.00%, 23/11/2055	131	0,07
200.000	GBP	Bazalgette Finance plc, 2.38%, 29/11/2027	166	0,09
150.000	GBP	Bazalgette Finance plc, 2.75%, 10/03/2034	110	0,06
425.000	GBP	Berkeley Group plc (The), 2.50%, 11/08/2031	263	0,15
450.000	GBP	BG Energy Capital plc, 5.13%, 01/12/2025	435	0,24
500.000	GBP	BG Energy Capital plc, 5.00%, 04/11/2036	442	0,25
1.125.000	GBP	BP Capital Markets plc, FRN, 4.25%, 22/03/2027 <sup>2</sup>	949	0,53
691.000	GBP	British Telecommunications plc, 5.75%, 07/12/2028 <sup>1</sup>	643	0,36
425.000	GBP	British Telecommunications plc, 3.13%, 21/11/2031	318	0,18
100.000	GBP	British Telecommunications plc, 6.38%, 23/06/2037	92	0,05
100.000	GBP	British Telecommunications plc, 3.63%, 21/11/2047	64	0,04
275.000	GBP	Bunzl Finance plc, 1.50%, 30/10/2030	190	0,11
340.000	GBP	BUPA Finance plc, 5.00%, 08/12/2026	300	0,17
600.000	GBP	BUPA Finance plc, 1.75%, 14/06/2027	484	0,27
200.000	GBP	BUPA Finance plc, 4.13%, 14/06/2035	136	0,08
475.000	GBP	Burberry Group plc, 1.13%, 21/09/2025	406	0,23
650.000	GBP	Cadent Finance plc, 2.25%, 10/10/2035	405	0,23
725.000	GBP	Cadent Finance plc, FRN, 2.13%, 22/09/2028	568	0,32
690.000	GBP	Cadent Finance plc, FRN, 2.75%, 22/09/2046	389	0,22
325.000	GBP	Cardiff University, 3.00%, 07/12/2055	221	0,12

# BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di GBP	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Regno Unito (continua)</b>				
370.000	GBP	Centrica plc, 4.38%, 13/03/2029	321	0,18
125.000	GBP	Centrica plc, 4.25%, 12/09/2044	90	0,05
750.000	GBP	Centrica plc, FRN, 7.00%, 19/09/2033	746	0,42
250.000	GBP	Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge (The), 3.75%, 17/10/2052	212	0,12
150.000	GBP	Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge (The), 2.35%, 27/06/2078	87	0,05
286.000	GBP	Channel Link Enterprises Finance plc, 3.85%, 30/06/2050	207	0,12
300.000	GBP	Close Brothers Group plc, 2.75%, 26/04/2023	295	0,17
300.000	GBP	Compass Group plc, 2.00%, 05/09/2025	269	0,15
759.084	GBP	Connect Plus M25 Issuer plc, 2.61%, 31/03/2039	591	0,33
500.000	GBP	Coventry Building Society, 1.88%, 24/10/2023	480	0,27
350.000	GBP	Diageo Finance plc, 1.75%, 12/10/2026	301	0,17
400.000	GBP	Diageo Finance plc, 2.38%, 08/06/2028	334	0,19
600.000	GBP	Diageo Finance plc, 1.25%, 28/03/2033	395	0,22
260.000	GBP	Diageo Finance plc, 2.75%, 08/06/2038	184	0,10
200.000	GBP	Direct Line Insurance Group plc, 4.00%, 05/06/2032	143	0,08
348.000	GBP	DWR Cymru Financing UK plc, 6.02%, 31/03/2028	347	0,19
350.000	GBP	DWR Cymru Financing UK plc, 2.38%, 31/03/2034	239	0,13
200.000	GBP	DWR Cymru Financing UK plc, 2.50%, 31/03/2036	141	0,08
503.000	GBP	Eastern Power Networks plc, 5.75%, 08/03/2024	501	0,28
91.000	GBP	Eastern Power Networks plc, 8.50%, 31/03/2025	95	0,05
500.000	GBP	Eastern Power Networks plc, 1.88%, 01/06/2035	320	0,18
250.000	GBP	Eastern Power Networks plc, FRN, 6.25%, 12/11/2036	255	0,14
424.000	GBP	Electricity North West Ltd., 8.88%, 25/03/2026	456	0,26
100.000	GBP	ENW Finance plc, 1.42%, 30/07/2030	72	0,04
113.327	GBP	Exchequer Partnership No. 2 plc, 5.40%, 13/07/2036	115	0,06
500.000	GBP	Experian Finance plc, 0.74%, 29/10/2025	428	0,24
300.000	GBP	GlaxoSmithKline Capital plc, 3.38%, 20/12/2027	264	0,15
1.187.000	GBP	GlaxoSmithKline Capital plc, 5.25%, 19/12/2033	1.133	0,64
750.000	GBP	GlaxoSmithKline Capital plc, 5.25%, 10/04/2042	727	0,41
700.000	GBP	GlaxoSmithKline Capital plc, 4.25%, 18/12/2045 <sup>1</sup>	594	0,33
275.000	GBP	Grainger plc, REIT, FRN, 3.38%, 24/04/2028	217	0,12
775.000	GBP	GSK Consumer Healthcare Capital UK plc, 2.88%, 29/10/2028	644	0,36
200.000	GBP	GSK Consumer Healthcare Capital UK plc, 3.38%, 29/03/2038	144	0,08
400.000	GBP	Hammerson plc, REIT, 3.50%, 27/10/2025	334	0,19
100.000	GBP	Hammerson plc, REIT, 7.25%, 21/04/2028	86	0,05
212.000	GBP	HSBC Bank plc, 6.50%, 07/07/2023	213	0,12
442.000	GBP	HSBC Bank plc, 5.38%, 22/08/2033	378	0,21
61.000	GBP	HSBC Bank plc, 6.25%, 30/01/2041	55	0,03
350.000	GBP	HSBC Bank plc, 4.75%, 24/03/2046	264	0,15
242.000	GBP	HSBC Bank plc, FRN, 5.38%, 04/11/2030	227	0,13
272.000	GBP	HSBC Holdings plc, 5.75%, 20/12/2027	246	0,14
550.000	GBP	HSBC Holdings plc, 2.63%, 16/08/2028	432	0,24
525.000	GBP	HSBC Holdings plc, 6.00%, 29/03/2040	426	0,24
500.000	GBP	HSBC Holdings plc, FRN, 2.26%, 13/11/2026	431	0,24
1.000.000	GBP	HSBC Holdings plc, FRN, 1.75%, 24/07/2027	807	0,45
375.000	GBP	HSBC Holdings plc, FRN, 3.00%, 29/05/2030	286	0,16
250.000	GBP	Hutchison Whampoa Finance UK plc, 5.63%, 24/11/2026 <sup>1</sup>	243	0,14
475.000	GBP	IG Group Holdings plc, 3.13%, 18/11/2028	343	0,19
850.000	GBP	Imperial Brands Finance plc, FRN, 8.13%, 15/03/2024	862	0,48
600.000	GBP	Imperial Brands Finance plc, FRN, 4.88%, 07/06/2032	464	0,26
750.000	GBP	Informa plc, FRN, 3.13%, 05/07/2026	648	0,36
500.000	GBP	InterContinental Hotels Group plc, 3.38%, 08/10/2028	398	0,22
475.000	GBP	InterContinental Hotels Group plc, FRN, 3.75%, 14/08/2025	434	0,24
550.000	GBP	Investec plc, FRN, 2.63%, 04/01/2032	411	0,23
250.000	GBP	Just Group plc, FRN, 7.00%, 15/04/2031	236	0,13
300.000	GBP	Legal & General Group plc, FRN, 5.38%, 27/10/2045	277	0,16
300.000	GBP	Legal & General Group plc, FRN, 5.13%, 14/11/2048	253	0,14
725.000	GBP	Legal & General Group plc, FRN, 3.75%, 26/11/2049	541	0,30



# BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di GBP	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Regno Unito (continua)</b>				
525.000	GBP	Legal & General Group plc, FRN, 4.50%, 01/11/2050	405	0,23
225.000	GBP	Legal & General Group plc, FRN, 5.50%, 27/06/2064	171	0,10
250.000	GBP	Liberty Living Finance plc, REIT, 2.63%, 28/11/2024	228	0,13
350.000	GBP	Liberty Living Finance plc, REIT, 3.38%, 28/11/2029	277	0,16
350.000	GBP	Liverpool Victoria Friendly Society Ltd., FRN, 6.50%, 22/05/2043	342	0,19
250.000	GBP	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 1.75%, 11/07/2024	232	0,13
401.000	GBP	Lloyds Bank plc, 7.50%, 15/04/2024	410	0,23
552.000	GBP	Lloyds Bank plc, 6.50%, 17/09/2040	600	0,34
525.000	GBP	Lloyds Banking Group plc, 2.25%, 16/10/2024	483	0,27
1.250.000	GBP	Lloyds Banking Group plc, FRN, 1.99%, 15/12/2031 <sup>1</sup>	974	0,55
634.000	GBP	Lloyds Banking Group plc, FRN, 2.71%, 03/12/2035	425	0,24
136.000	GBP	London Merchant Securities Ltd., REIT, FRN, 6.50%, 16/03/2026	136	0,08
150.000	GBP	London Power Networks plc, 2.63%, 01/03/2029	122	0,07
150.000	GBP	M&G plc, FRN, 3.88%, 20/07/2049	140	0,08
550.000	GBP	M&G plc, FRN, 5.63%, 20/10/2051	442	0,25
225.000	GBP	M&G plc, FRN, 5.56%, 20/07/2055	169	0,10
250.000	GBP	M&G plc, FRN, 6.34%, 19/12/2063	192	0,11
500.000	GBP	M&G plc, FRN, 6.25%, 20/10/2068	377	0,21
300.000	GBP	Manchester Airport Group Funding plc, 4.13%, 02/04/2024	290	0,16
300.000	GBP	Manchester Airport Group Funding plc, 4.75%, 31/03/2034	251	0,14
225.000	GBP	Manchester Airport Group Funding plc, 2.88%, 30/09/2044	130	0,07
250.000	GBP	Motability Operations Group plc, 3.75%, 16/07/2026	233	0,13
250.000	GBP	Motability Operations Group plc, 4.38%, 08/02/2027 <sup>1</sup>	237	0,13
200.000	GBP	Motability Operations Group plc, 1.75%, 03/07/2029	156	0,09
250.000	GBP	Motability Operations Group plc, 2.38%, 14/03/2032	192	0,11
950.000	GBP	Motability Operations Group plc, 3.63%, 10/03/2036	779	0,44
275.000	GBP	Motability Operations Group plc, 2.38%, 03/07/2039	183	0,10
225.000	GBP	Motability Operations Group plc, 2.13%, 18/01/2042	139	0,08
182.000	GBP	National Grid Electricity Transmission plc, 5.88%, 02/02/2024	182	0,10
279.000	GBP	National Grid Electricity Transmission plc, 2.75%, 06/02/2035	195	0,11
300.000	GBP	National Grid Electricity Transmission plc, 2.00%, 16/09/2038	173	0,10
350.000	GBP	National Grid Electricity Transmission plc, 2.00%, 17/04/2040	196	0,11
525.000	GBP	National Grid Gas plc, 1.38%, 07/02/2031	358	0,20
250.000	GBP	National Grid Gas plc, 1.63%, 14/01/2043	117	0,07
300.000	GBP	National Grid plc, FRN, 3.50%, 16/10/2026	267	0,15
100.000	GBP	Nationwide Building Society, 3.00%, 06/05/2026	90	0,05
350.000	GBP	Nationwide Building Society, 3.25%, 20/01/2028	300	0,17
1.000.000	GBP	Nats En Route plc, 1.38%, 31/03/2031	801	0,45
375.000	GBP	NatWest Group plc, 3.62%, 14/08/2030	331	0,19
400.000	GBP	NatWest Group plc, FRN, 2.87%, 19/09/2026	353	0,20
300.000	GBP	NatWest Group plc, FRN, 3.12%, 28/03/2027	260	0,15
500.000	GBP	NatWest Group plc, FRN, 3.62%, 29/03/2029	409	0,23
900.000	GBP	NatWest Group plc, FRN, 2.10%, 28/11/2031	700	0,39
275.000	GBP	Next Group plc, 3.00%, 26/08/2025	246	0,14
350.000	GBP	NIE Finance plc, 2.50%, 27/10/2025	315	0,18
250.000	GBP	NIE Finance plc, 6.38%, 02/06/2026	251	0,14
150.000	GBP	Northern Electric Finance plc, 5.13%, 04/05/2035	138	0,08
100.000	GBP	Northern Gas Networks Finance plc, 4.88%, 15/11/2035	86	0,05
150.000	GBP	Northern Gas Networks Finance plc, 5.63%, 23/03/2040	136	0,08
450.000	GBP	Northern Powergrid Yorkshire plc, 2.25%, 09/10/2059	238	0,13
133.000	GBP	Northumbrian Water Finance plc, 5.63%, 29/04/2033	127	0,07
300.000	GBP	Northumbrian Water Finance plc, 5.13%, 23/01/2042	271	0,15
200.000	GBP	Pension Insurance Corp. plc, 6.50%, 03/07/2024	195	0,11
250.000	GBP	Pension Insurance Corp. plc, 8.00%, 23/11/2026	242	0,14
300.000	GBP	Pension Insurance Corp. plc, 5.63%, 20/09/2030	242	0,14
200.000	GBP	Pension Insurance Corp. plc, 4.63%, 07/05/2031 <sup>1</sup>	147	0,08
200.000	GBP	Pension Insurance Corp. plc, 3.63%, 21/10/2032	130	0,07
375.000	GBP	Phoenix Group Holdings plc, 6.63%, 18/12/2025 <sup>1</sup>	352	0,20
200.000	GBP	Phoenix Group Holdings plc, 5.87%, 13/06/2029	169	0,09
400.000	GBP	Phoenix Group Holdings plc, 5.63%, 28/04/2031	318	0,18



# BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di GBP	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Regno Unito (continua)</b>				
150.000	GBP	Places For People Treasury plc, REIT, 2.88%, 17/08/2026	133	0,07
300.000	GBP	Principality Building Society, 2.38%, 23/11/2023	285	0,16
100.000	GBP	Prudential plc, 6.13%, 19/12/2031	89	0,05
250.000	GBP	Quadgas Finance plc, 3.38%, 17/09/2029	193	0,11
200.000	GBP	Reckitt Benckiser Treasury Services plc, 1.75%, 19/05/2032	143	0,08
400.000	GBP	RL Finance Bonds No. 2 plc, FRN, 6.12%, 30/11/2043	392	0,22
275.000	GBP	RI Finance Bonds No. 3 plc, 6.13%, 13/11/2028	242	0,14
425.000	GBP	RL Finance Bonds No. 4 plc, FRN, 4.87%, 07/10/2049	284	0,16
326.201	GBP	RMPA Services plc, 5.34%, 30/09/2038	321	0,18
825.000	GBP	Rothesay Life plc, 3.38%, 12/07/2026 <sup>1</sup>	690	0,39
125.000	GBP	Rothesay Life plc, FRN, 5.50%, 17/09/2029	118	0,07
200.000	GBP	Sage Group plc (The), 1.63%, 25/02/2031	139	0,08
525.000	GBP	Santander UK Group Holdings plc, 3.63%, 14/01/2026	468	0,26
350.000	GBP	Santander UK Group Holdings plc, FRN, 2.92%, 08/05/2026	311	0,17
350.000	GBP	Santander UK Group Holdings plc, FRN, 2.42%, 17/01/2029	273	0,15
325.000	GBP	Santander UK plc, 3.88%, 15/10/2029	282	0,16
125.000	GBP	Scotland Gas Networks plc, 3.25%, 08/03/2027	111	0,06
800.000	GBP	Scottish Widows Ltd., 5.50%, 16/06/2023	795	0,45
375.000	GBP	Scottish Widows Ltd., 7.00%, 16/06/2043	339	0,19
300.000	GBP	Segro plc, REIT, 2.38%, 11/10/2029	236	0,13
121.000	GBP	Segro plc, REIT, 5.75%, 20/06/2035	117	0,07
514.000	GBP	Severn Trent Utilities Finance plc, 6.13%, 26/02/2024	514	0,29
484.000	GBP	Severn Trent Utilities Finance plc, 6.25%, 07/06/2029	484	0,27
200.000	GBP	Severn Trent Utilities Finance plc, 4.88%, 24/01/2042	178	0,10
150.000	GBP	Sky Ltd., 6.00%, 21/05/2027	150	0,08
100.000	GBP	Sky Ltd., 4.00%, 26/11/2029	88	0,05
400.000	GBP	Society of Lloyd's, 4.75%, 30/10/2024	376	0,21
300.000	GBP	Society of Lloyd's, FRN, 4.87%, 07/02/2047	260	0,15
450.000	GBP	South Eastern Power Networks plc, FRN, 6.37%, 12/11/2031	458	0,26
121.000	GBP	Southern Electric Power Distribution plc, 5.50%, 07/06/2032	115	0,06
275.000	GBP	Southern Electric Power Distribution plc, 4.63%, 20/02/2037	228	0,13
400.000	GBP	Southern Gas Networks plc, 4.88%, 05/10/2023	396	0,22
100.000	GBP	Southern Gas Networks plc, 2.50%, 03/02/2025	92	0,05
250.000	GBP	Southern Gas Networks plc, 4.88%, 21/03/2029	232	0,13
700.000	GBP	Southern Gas Networks plc, FRN, 3.10%, 15/09/2036	484	0,27
150.000	GBP	SP Transmission plc, 2.00%, 13/11/2031	110	0,06
450.000	GBP	SSE plc, 8.38%, 20/11/2028	490	0,28
550.000	GBP	SSE plc, 6.25%, 27/08/2038	531	0,30
150.000	GBP	SSE plc, FRN, 3.74%, 14/01/2026 <sup>2</sup>	129	0,07
400.000	GBP	Standard Chartered plc, 5.13%, 06/06/2034	329	0,18
350.000	GBP	Standard Chartered plc, 4.38%, 18/01/2038	293	0,16
550.000	GBP	Tesco Corporate Treasury Services plc, 1.88%, 02/11/2028	412	0,23
350.000	GBP	Tesco Corporate Treasury Services plc, 2.75%, 27/04/2030	266	0,15
200.000	GBP	Tesco Personal Finance Group plc, 3.50%, 25/07/2025	181	0,10
650.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 4.00%, 19/06/2025	611	0,34
250.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 3.50%, 25/02/2028	215	0,12
200.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 2.63%, 24/01/2032	147	0,08
100.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 6.50%, 09/02/2032	99	0,06
250.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 4.38%, 03/07/2034	206	0,12
339.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 5.13%, 28/09/2037	291	0,16
1.075.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 2.38%, 22/04/2040	614	0,34
300.000	GBP	Thames Water Utilities Finance plc, 4.63%, 04/06/2046	234	0,13
205.000	GBP	TP ICAP Finance plc, FRN, 5.25%, 26/01/2024 <sup>1</sup>	196	0,11
100.000	GBP	Tritax Big Box REIT plc, 2.63%, 14/12/2026	85	0,05
300.000	GBP	Tritax Big Box REIT plc, 1.50%, 27/11/2033	183	0,10
500.000	GBP	UNITE Group plc (The), REIT, 3.50%, 15/10/2028	405	0,23
300.000	GBP	United Utilities Water Finance plc, 0.88%, 28/10/2029	213	0,12
375.000	GBP	United Utilities Water Finance plc, 2.00%, 03/07/2033 <sup>1</sup>	260	0,15
150.000	GBP	United Utilities Water Finance plc, 1.75%, 10/02/2038	89	0,05
333.000	GBP	United Utilities Water Ltd., 5.63%, 20/12/2027 <sup>1</sup>	326	0,18

# BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di GBP	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Regno Unito (continua)</b>				
100.000	GBP	United Utilities Water Ltd., 5.00%, 28/02/2035	92	0,05
150.000	GBP	University of Leeds, 3.13%, 19/12/2050 <sup>1</sup>	104	0,06
150.000	GBP	University of Liverpool, 3.38%, 25/06/2055	114	0,06
150.000	GBP	University of Manchester, 4.25%, 04/07/2053	134	0,07
650.000	GBP	University of Oxford, 2.54%, 08/12/2117	366	0,21
270.000	GBP	University of Southampton, 2.25%, 11/04/2057	153	0,09
361.572	GBP	UPP Bond 1 Issuer plc, REIT, 4.90%, 28/02/2040	326	0,18
200.000	GBP	Utmost Group plc, 4.00%, 15/12/2031	147	0,08
250.000	GBP	Virgin Money UK plc, FRN, 3.12%, 22/06/2025	230	0,13
500.000	GBP	Virgin Money UK plc, FRN, 4.00%, 25/09/2026	445	0,25
197.000	GBP	Vodafone Group plc, 5.63%, 04/12/2025	193	0,11
575.000	GBP	Vodafone Group plc, 3.38%, 08/08/2049	371	0,21
610.000	GBP	Vodafone Group plc, 3.00%, 12/08/2056	349	0,20
275.000	GBP	Wales & West Utilities Finance plc, 5.75%, 29/03/2030	269	0,15
250.000	GBP	Wales & West Utilities Finance plc, 3.00%, 03/08/2038	173	0,10
250.000	GBP	Wales & West Utilities Finance plc, 1.88%, 28/05/2041	136	0,08
200.000	GBP	Wellcome Trust Finance plc, 4.63%, 25/07/2036	190	0,11
300.000	GBP	Wellcome Trust Ltd. (The), 4.00%, 09/05/2059	271	0,15
700.000	GBP	Wellcome Trust Ltd. (The), 1.50%, 14/07/2071	308	0,17
300.000	GBP	Wellcome Trust Ltd. (The), 2.52%, 07/02/2118	164	0,09
182.000	GBP	Wessex Water Services Finance plc, 5.38%, 10/03/2028	174	0,10
350.000	GBP	Wessex Water Services Finance plc, 1.50%, 17/09/2029 <sup>1</sup>	256	0,14
212.000	GBP	Wessex Water Services Finance plc, 5.75%, 14/10/2033	203	0,11
150.000	GBP	Wessex Water Services Finance plc, 1.25%, 12/01/2036	84	0,05
200.000	GBP	Western Power Distribution East Midlands plc, FRN, 6.25%, 10/12/2040	197	0,11
200.000	GBP	Western Power Distribution South West plc, 5.75%, 23/03/2040	188	0,11
425.000	GBP	Western Power Distribution West Midlands plc, 3.88%, 17/10/2024	407	0,23
600.000	GBP	Western Power Distribution West Midlands plc, 5.75%, 16/04/2032	571	0,32
250.000	GBP	Western Power Distribution West Midlands plc, FRN, 6.00%, 09/05/2025	244	0,14
340.000	GBP	Whitbread Group plc, 3.38%, 16/10/2025	304	0,17
250.000	GBP	WPP Finance 2013, 2.88%, 14/09/2046	134	0,08
355.000	GBP	WPP Finance 2017, 3.75%, 19/05/2032	276	0,16
375.000	GBP	Yorkshire Building Society, 3.50%, 21/04/2026	338	0,19
175.000	GBP	Yorkshire Building Society, FRN, 3.00%, 18/04/2025	164	0,09
275.000	GBP	Yorkshire Building Society, FRN, 3.38%, 13/09/2028	217	0,12
350.000	GBP	Yorkshire Water Finance plc, 1.75%, 26/11/2026	293	0,16
200.000	GBP	Yorkshire Water Finance plc, 3.63%, 01/08/2029	172	0,10
300.000	GBP	Yorkshire Water Finance plc, 6.38%, 19/08/2039	310	0,17
275.000	GBP	Yorkshire Water Finance plc, 2.75%, 18/04/2041	178	0,10
200.000	GBP	Yorkshire Water Services Finance Ltd., FRN, 5.50%, 28/05/2037	192	0,11
<b>Regno Unito - Totale</b>			<b>81.689</b>	<b>45,91</b>
<b>Stati Uniti (31 marzo 2022: 18,18%)</b>				
175.000	GBP	Apple, Inc., 3.60%, 31/07/2042	143	0,08
700.000	GBP	AT&T, Inc., 2.90%, 04/12/2026	607	0,34
450.000	GBP	AT&T, Inc., 5.50%, 15/03/2027	431	0,24
600.000	GBP	AT&T, Inc., 4.38%, 14/09/2029	522	0,29
150.000	GBP	AT&T, Inc., 5.20%, 18/11/2033	134	0,07
725.000	GBP	AT&T, Inc., 4.25%, 01/06/2043	551	0,31
1.150.000	GBP	AT&T, Inc., 4.88%, 01/06/2044	956	0,54
650.000	GBP	Athene Global Funding, 1.75%, 24/11/2027	496	0,28
150.000	GBP	Bank of America Corp., 8.13%, 02/06/2028	152	0,09
1.950.000	GBP	Bank of America Corp., 7.00%, 31/07/2028	1.986	1,12
225.000	GBP	BAT Capital Corp., 2.13%, 15/08/2025	195	0,11
725.000	GBP	Berkshire Hathaway Finance Corp., 2.38%, 19/06/2039	477	0,27
375.000	GBP	Berkshire Hathaway Finance Corp., 2.63%, 19/06/2059	216	0,12
200.000	GBP	Brown-Forman Corp., 2.60%, 07/07/2028	168	0,09
100.000	GBP	Cargill, Inc., 5.38%, 02/03/2037	96	0,05
275.000	GBP	Citigroup, Inc., 2.75%, 24/01/2024	264	0,15
348.000	GBP	Citigroup, Inc., 5.15%, 21/05/2026	330	0,19

# BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di GBP	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Stati Uniti (continua)</b>				
625.000	GBP	Citigroup, Inc., 1.75%, 23/10/2026	513	0,29
650.000	GBP	Citigroup, Inc., 4.50%, 03/03/2031	543	0,30
200.000	GBP	Citigroup, Inc., 6.80%, 25/06/2038	217	0,12
200.000	GBP	Comcast Corp., 1.50%, 20/02/2029	154	0,09
257.000	GBP	Comcast Corp., 5.50%, 23/11/2029	249	0,14
300.000	GBP	Comcast Corp., 1.88%, 20/02/2036	195	0,11
200.000	GBP	Digital Stout Holding LLC, REIT, 4.25%, 17/01/2025	189	0,11
425.000	GBP	Digital Stout Holding LLC, REIT, 3.30%, 19/07/2029	338	0,19
350.000	GBP	Digital Stout Holding LLC, REIT, 3.75%, 17/10/2030	280	0,16
300.000	GBP	Eli Lilly & Co., 1.63%, 14/09/2043	170	0,10
287.000	GBP	General Electric Co., 5.25%, 07/12/2028	266	0,15
750.000	GBP	General Motors Financial Co., Inc., 2.25%, 06/09/2024	686	0,39
325.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 7.13%, 07/08/2025	328	0,18
1.030.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 4.25%, 29/01/2026	947	0,53
500.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.50%, 07/12/2027	386	0,22
381.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 3.13%, 25/07/2029	303	0,17
350.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.88%, 16/12/2030 <sup>1</sup>	245	0,14
275.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 6.88%, 18/01/2038	266	0,15
350.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN, 1.00%, 16/12/2025	311	0,17
225.000	GBP	Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN, 3.63%, 29/10/2029	187	0,10
500.000	GBP	Johnson & Johnson, 5.50%, 06/11/2024	505	0,28
1.225.000	GBP	JPMorgan Chase & Co., FRN, 0.99%, 28/04/2026	1.061	0,60
100.000	GBP	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.90%, 28/04/2033	69	0,04
885.000	GBP	Kraft Heinz Foods Co., 4.13%, 01/07/2027	785	0,44
200.000	GBP	McDonald's Corp., 2.95%, 15/03/2034	153	0,09
300.000	GBP	McDonald's Corp., 4.13%, 11/06/2054	238	0,13
850.000	GBP	McKesson Corp., 3.13%, 17/02/2029	694	0,39
250.000	GBP	Metropolitan Life Global Funding I, 3.50%, 30/09/2026	228	0,13
1.500.000	GBP	Metropolitan Life Global Funding I, 1.63%, 12/10/2028	1.185	0,67
400.000	GBP	New York Life Global Funding, 1.50%, 15/07/2027	326	0,18
150.000	GBP	PepsiCo, Inc., 3.20%, 22/07/2029	129	0,07
827.000	GBP	Pfizer, Inc., 2.74%, 15/06/2043	566	0,32
325.000	GBP	Procter & Gamble Co. (The), 1.38%, 03/05/2025 <sup>1</sup>	293	0,16
550.000	GBP	Prologis LP, REIT, 2.25%, 30/06/2029	434	0,24
375.000	GBP	Realty Income Corp., REIT, 1.88%, 14/01/2027	312	0,18
500.000	GBP	Realty Income Corp., REIT, 1.13%, 13/07/2027 <sup>1</sup>	391	0,22
200.000	GBP	Realty Income Corp., REIT, 1.75%, 13/07/2033	128	0,07
400.000	GBP	Time Warner Cable LLC, 5.75%, 02/06/2031	350	0,20
400.000	GBP	Time Warner Cable LLC, 5.25%, 15/07/2042	300	0,17
300.000	GBP	United Parcel Service, Inc., 5.13%, 12/02/2050	301	0,17
568.000	GBP	Verizon Communications, Inc., 4.07%, 18/06/2024	550	0,31
300.000	GBP	Verizon Communications, Inc., 1.88%, 19/09/2030 <sup>1</sup>	220	0,12
300.000	GBP	Verizon Communications, Inc., 4.75%, 17/02/2034	266	0,15
1.000.000	GBP	Verizon Communications, Inc., 3.38%, 27/10/2036	746	0,42
200.000	GBP	Verizon Communications, Inc., 1.88%, 03/11/2038	114	0,06
169.000	GBP	Walmart, Inc., 5.75%, 19/12/2030	172	0,10
375.000	GBP	Walmart, Inc., 5.63%, 27/03/2034	382	0,21
830.000	GBP	Walmart, Inc., 5.25%, 28/09/2035	817	0,46
325.000	GBP	Wells Fargo & Co., 2.13%, 20/12/2023 <sup>1</sup>	310	0,17
850.000	GBP	Wells Fargo & Co., 2.00%, 28/07/2025	750	0,42
375.000	GBP	Wells Fargo & Co., 2.50%, 02/05/2029	291	0,16
400.000	GBP	Wells Fargo & Co., 3.50%, 12/09/2029	330	0,19
500.000	GBP	Wells Fargo & Co., 4.63%, 02/11/2035	425	0,24
600.000	GBP	Wells Fargo & Co., 4.88%, 29/11/2035	478	0,27
400.000	GBP	Wells Fargo Bank NA, 5.25%, 01/08/2023	398	0,22
536.000	GBP	Welltower, Inc., REIT, 4.80%, 20/11/2028	481	0,27

# BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di GBP	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
		<b>Stati Uniti (continua)</b>		
320.000	GBP	Welltower, Inc., REIT, 4.50%, 01/12/2034	257	0,14
		<b>Stati Uniti - Totale</b>	<b>29.932</b>	<b>16,81</b>
<b>Totale investimenti in titoli di debito societario</b>			<b>172.209</b>	<b>96,77</b>
<b>Totale investimenti in obbligazioni</b>			<b>174.543</b>	<b>98,08</b>
			<b>Valore equo Migliaia di GBP</b>	<b>% del valore patrimoniale netto</b>
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico			174.543	98,08
Liquidità			10	0,01
Strumenti liquidi equivalenti				
Partecipazione	Valuta	Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2022: 0,52%)		
		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni		
27.454	GBP	Agency (Dis) <sup>3</sup>	2.743	1,54
Totale in strumenti liquidi equivalenti			2.743	1,54
Altre attività e passività			659	0,37
<b>Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>			<b>177.955</b>	<b>100,00</b>
<b>Analisi del totale attività</b>				<b>% del totale attività</b>
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale				94,59
Organismi di investimento collettivo				1,49
Altre attività				3,92
<b>Totale attività</b>				<b>100,00</b>

<sup>1</sup>Titolo parzialmente o completamente in prestito.

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

<sup>3</sup>Una parte correlata al Fondo.

# BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI</b>				
<b>Titoli del debito societario (31 marzo 2022: 96,32%)</b>				
<b>Australia (31 marzo 2022: 1,51%)</b>				
300.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 2.00%, 22/03/2027	271	0,32
400.000	EUR	Brambles Finance Ltd., 2.38%, 12/06/2024	392	0,47
500.000	EUR	Goodman Australia Finance Pty. Ltd., REIT, 1.38%, 27/09/2025	460	0,55
100.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 0.63%, 30/08/2023	98	0,12
275.000	EUR	Toyota Finance Australia Ltd., 2.00%, 21/10/2024	270	0,32
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 1.88%, 16/09/2024	97	0,12
		<b>Australia - Totale</b>	<b>1.588</b>	<b>1,90</b>
<b>Austria (31 marzo 2022: 0,72%)</b>				
200.000	EUR	ams-OSRAM AG, 6.00%, 31/07/2025	177	0,22
175.000	EUR	Sappi Papier Holding GmbH, 3.63%, 15/03/2028	136	0,16
300.000	EUR	voestalpine AG, 1.38%, 27/09/2024 <sup>1</sup>	286	0,34
		<b>Austria - Totale</b>	<b>599</b>	<b>0,72</b>
<b>Belgio (31 marzo 2022: 0,33%)</b>				
100.000	EUR	Elia Group SA, FRN, 2.75%, 09/05/2023 <sup>2</sup>	96	0,12
200.000	EUR	Elia Transmission Belgium SA, 1.38%, 27/05/2024	195	0,23
		<b>Belgio - Totale</b>	<b>291</b>	<b>0,35</b>
<b>Isole Vergini britanniche (31 marzo 2022: 0,65%)</b>				
500.000	EUR	Global Switch Holdings Ltd., 1.50%, 31/01/2024	485	0,58
		<b>Isole Vergini britanniche - Totale</b>	<b>485</b>	<b>0,58</b>
<b>Canada (31 marzo 2022: 0,33%)</b>				
300.000	EUR	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.75%, 22/03/2023	298	0,36
		<b>Canada - Totale</b>	<b>298</b>	<b>0,36</b>
<b>Danimarca (31 marzo 2022: 0,62%)</b>				
500.000	EUR	Jyske Bank A/S, FRN, 0.25%, 17/02/2028	423	0,51
		<b>Danimarca - Totale</b>	<b>423</b>	<b>0,51</b>
<b>Finlandia (31 marzo 2022: 2,80%)</b>				
125.000	EUR	Citycon OYJ, REIT, FRN, 4.50%, 24/11/2024 <sup>2</sup>	92	0,11
300.000	EUR	Neste OYJ, 1.50%, 07/06/2024	292	0,35
200.000	EUR	Nokia OYJ, 2.38%, 15/05/2025	189	0,23
150.000	EUR	Nokia OYJ, 2.00%, 11/03/2026	138	0,17
175.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.38%, 29/08/2023	171	0,20
350.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.38%, 26/02/2024	338	0,40
350.000	EUR	SBB Treasury OYJ, REIT, FRN, 0.82%, 08/02/2024 <sup>1</sup>	299	0,36
300.000	EUR	Stora Enso OYJ, 2.13%, 16/06/2023	298	0,36
		<b>Finlandia - Totale</b>	<b>1.817</b>	<b>2,18</b>
<b>Francia (31 marzo 2022: 13,51%)</b>				
100.000	EUR	Accor SA, FRN, 2.63%, 30/01/2025 <sup>2</sup>	78	0,09
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 1.00%, 02/04/2025	96	0,11
200.000	EUR	ALD SA, 1.25%, 11/10/2022	200	0,24
300.000	EUR	Altice France SA, 2.50%, 15/01/2025	267	0,32
200.000	EUR	Altice France SA, 5.88%, 01/02/2027	173	0,21
300.000	EUR	Arkema SA, FRN, 2.75%, 17/06/2024 <sup>2</sup>	278	0,33
300.000	EUR	Arval Service Lease SA, 0.00%, 01/10/2025	265	0,32
100.000	EUR	AXA SA, FRN, 5.13%, 04/07/2043	101	0,12
125.000	EUR	Banijay Entertainment SASU, 3.50%, 01/03/2025	116	0,14
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 15/07/2025	189	0,23
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.13%, 23/01/2027	186	0,22
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.63%, 14/10/2027	200	0,24
100.000	EUR	BPCE SA, 1.13%, 18/01/2023	100	0,12
200.000	EUR	BPCE SA, 0.38%, 05/10/2023	195	0,23
200.000	EUR	Capgemini SE, 1.00%, 18/10/2024	192	0,23



# BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Francia (continua)</b>				
200.000	EUR	Carrefour Banque SA, FRN, 1.49%, 12/09/2023	201	0,24
400.000	EUR	Chrome Bidco SASU, 3.50%, 31/05/2028	319	0,38
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain, 1.75%, 03/04/2023	100	0,12
400.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 1.00%, 22/04/2026	373	0,45
300.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.00%, 26/01/2023	300	0,36
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.88%, 05/10/2023	98	0,12
200.000	EUR	Danone SA, FRN, 1.75%, 23/03/2023 <sup>2</sup>	194	0,23
100.000	EUR	Elis SA, 1.88%, 15/02/2023	99	0,12
100.000	EUR	Elis SA, 4.13%, 24/05/2027	92	0,11
200.000	EUR	ELO SACA, FRN, 2.38%, 25/04/2025	191	0,23
200.000	EUR	Engie SA, FRN, 1.62%, 04/08/2025 <sup>2</sup>	176	0,21
500.000	EUR	Getlink SE, 3.50%, 30/10/2025	458	0,55
		Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement, 0.13%, 16/09/2025	198	0,24
225.000	EUR	HSBC Continental Europe SA, 0.25%, 17/05/2024	96	0,11
100.000	EUR	iliad SA, 2.13%, 05/12/2022	200	0,24
200.000	EUR	Mobilux Finance SAS, 4.25%, 15/07/2028	87	0,10
125.000	EUR	Orange SA, FRN, 2.38%, 15/01/2025 <sup>2</sup>	277	0,33
300.000	EUR	Paprec Holding SA, 3.50%, 01/07/2028	116	0,14
150.000	EUR	Pernod Ricard SA, 0.00%, 24/10/2023	582	0,70
600.000	EUR	Picard Groupe SAS, 3.88%, 01/07/2026	84	0,10
100.000	EUR	PSA Banque France SA, 0.63%, 21/06/2024	119	0,14
125.000	EUR	RCI Banque SA, 1.63%, 11/04/2025	187	0,22
200.000	EUR	Rexel SA, 2.13%, 15/06/2028	176	0,21
225.000	EUR	Seche Environnement SA, 2.25%, 15/11/2028	100	0,12
125.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 1.37%, 23/02/2028	98	0,12
100.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 1.00%, 24/11/2030	170	0,21
200.000	EUR	SPIE SA, 3.13%, 22/03/2024	196	0,24
200.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 1.75%, 04/04/2024 <sup>2</sup>	277	0,33
300.000	EUR	Ubisoft Entertainment SA, 1.29%, 30/01/2023	297	0,36
300.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.63%, 04/05/2027 <sup>1</sup>	165	0,20
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, FRN, 2.13%, 25/07/2023 <sup>2</sup>	88	0,11
100.000	EUR	Verallia SA, 1.63%, 14/05/2028	158	0,19
200.000	EUR	Vivendi SE, 1.13%, 24/11/2023	294	0,35
300.000	EUR	Vivendi SE, 0.63%, 11/06/2025	466	0,56
500.000	EUR	Worldline SA, 0.25%, 18/09/2024	186	0,22
200.000	EUR	<b>Francia - Totale</b>	<b>9.854</b>	<b>11,81</b>
<b>Germania (31 marzo 2022: 7,44%)</b>				
400.000	EUR	Aareal Bank AG, 4.50%, 25/07/2025	394	0,47
200.000	EUR	Allianz SE, FRN, 5.63%, 17/10/2042	201	0,24
175.000	EUR	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4.38%, 15/01/2028	144	0,17
200.000	EUR	Clearstream Banking AG, 0.00%, 01/12/2025	183	0,22
175.000	EUR	Covestro AG, 0.88%, 03/02/2026	158	0,19
150.000	EUR	Ctec II GmbH, 5.25%, 15/02/2030	113	0,14
400.000	EUR	Deutsche Lufthansa AG, 2.00%, 14/07/2024	376	0,45
100.000	EUR	Deutsche Lufthansa AG, 2.88%, 16/05/2027	78	0,09
300.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.25%, 17/01/2025	271	0,33
75.000	EUR	E.ON SE, 1.00%, 07/10/2025	71	0,08
200.000	EUR	Evonik Industries AG, 2.25%, 25/09/2027	182	0,22
175.000	EUR	Gruenenthal GmbH, 3.63%, 15/11/2026 <sup>1</sup>	151	0,18
300.000	EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 0.75%, 23/11/2023	291	0,35
300.000	EUR	Hornbach Baumarkt AG, 3.25%, 25/10/2026 <sup>1</sup>	271	0,32
200.000	EUR	INEOS Styrolution Group GmbH, 2.25%, 16/01/2027	155	0,19
300.000	EUR	Infineon Technologies AG, 0.75%, 24/06/2023	296	0,35
400.000	EUR	Merck KGaA, FRN, 1.62%, 25/06/2079	371	0,45
100.000	EUR	Merck KGaA, FRN, 1.62%, 09/09/2080	87	0,10
525.000	EUR	Nidda Healthcare Holding GmbH, 3.50%, 30/09/2024	478	0,57
100.000	EUR	Novelis Sheet Ingot GmbH, 3.38%, 15/04/2029	79	0,10
300.000	EUR	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH, FRN, 1.75%, 05/07/2025	286	0,34



# BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Germania (continua)</b>				
200.000	EUR	Schaeffler AG, 2.75%, 12/10/2025	182	0,22
350.000	EUR	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH, 2.00%, 15/07/2025 <sup>1</sup>	308	0,37
300.000	EUR	thyssenkrupp AG, 2.88%, 22/02/2024	283	0,34
175.000	EUR	TK Elevator Midco GmbH, 4.38%, 15/07/2027	147	0,18
175.000	EUR	TUI Cruises GmbH, 6.50%, 15/05/2026	133	0,16
400.000	EUR	Vantage Towers AG, 0.00%, 31/03/2025	367	0,44
175.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.13%, 12/02/2027	148	0,18
375.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.38%, 20/07/2026	328	0,39
100.000	EUR	ZF Finance GmbH, 3.00%, 21/09/2025	89	0,11
400.000	EUR	ZF Finance GmbH, 2.75%, 25/05/2027	319	0,38
<b>Germania - Totale</b>			<b>6.940</b>	<b>8,32</b>
<b>Grecia (31 marzo 2022: 0,23%)</b>				
225.000	EUR	Mytilineos SA, 2.25%, 30/10/2026 <sup>1</sup>	197	0,24
<b>Grecia - Totale</b>			<b>197</b>	<b>0,24</b>
<b>Ungheria (31 marzo 2022: 0,33%)</b>				
300.000	EUR	MOL Hungarian Oil & Gas plc, 2.63%, 28/04/2023	298	0,36
<b>Ungheria - Totale</b>			<b>298</b>	<b>0,36</b>
<b>Islanda (31 marzo 2022: 0,86%)</b>				
575.000	EUR	Arion Banki HF, 0.38%, 14/07/2025 <sup>1</sup>	495	0,59
250.000	EUR	Islandsbanki HF, 0.50%, 20/11/2023	240	0,29
<b>Islanda - Totale</b>			<b>735</b>	<b>0,88</b>
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 2,92%)</b>				
300.000	EUR	Abbott Ireland Financing DAC, 0.88%, 27/09/2023	295	0,35
200.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 1.00%, 25/11/2025	185	0,22
175.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 1.88%, 05/06/2026	162	0,19
425.000	EUR	Dell Bank International DAC, 0.63%, 17/10/2022	425	0,51
225.000	EUR	Dell Bank International DAC, 0.50%, 27/10/2026	196	0,24
200.000	EUR	eircom Finance DAC, 1.75%, 01/11/2024	194	0,23
600.000	EUR	James Hardie International Finance DAC, 3.63%, 01/10/2026	544	0,65
400.000	EUR	Linde plc, 0.00%, 30/09/2026	352	0,42
<b>Irlanda - Totale</b>			<b>2.353</b>	<b>2,81</b>
<b>Isola di Man (31 marzo 2022: 0,11%)</b>				
100.000	EUR	Playtech plc, 3.75%, 12/10/2023	98	0,12
<b>Isola di Man - Totale</b>			<b>98</b>	<b>0,12</b>
<b>Italia (31 marzo 2022: 7,59%)</b>				
175.000	EUR	ACEA SpA, 1.50%, 08/06/2027	155	0,19
125.000	EUR	ASTM SpA, 1.00%, 25/11/2026	109	0,13
400.000	EUR	ASTM SpA, FRN, 3.38%, 13/02/2024	395	0,47
400.000	EUR	Atlantia SpA, 1.63%, 03/02/2025 <sup>1</sup>	363	0,44
100.000	EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 5.88%, 09/06/2024	102	0,12
300.000	EUR	Banca Popolare di Sondrio SpA, FRN, 1.25%, 13/07/2027 <sup>1</sup>	249	0,30
100.000	EUR	Banco BPM SpA, 2.50%, 21/06/2024	96	0,12
100.000	EUR	Banco BPM SpA, 1.75%, 28/01/2025	93	0,11
175.000	EUR	BPER Banca, 1.88%, 07/07/2025 <sup>1</sup>	159	0,19
250.000	EUR	BPER Banca, FRN, 3.38%, 30/06/2025	242	0,29
225.000	EUR	BPER Banca, FRN, 1.37%, 31/03/2027 <sup>1</sup>	190	0,23
250.000	EUR	doValue SpA, 3.38%, 31/07/2026 <sup>1</sup>	205	0,25
100.000	EUR	Enel SpA, FRN, 2.50%, 24/08/20232	95	0,11
225.000	EUR	Enel SpA, FRN, 3.50%, 24/02/20252	205	0,25
300.000	EUR	Eni SpA, 1.75%, 18/01/2024	295	0,35
125.000	EUR	FCA Bank SpA, 0.63%, 24/11/2022	125	0,15
125.000	EUR	FCA Bank SpA, 0.25%, 28/02/2023	124	0,15

# BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Italia (continua)</b>				
125.000	EUR	FCA Bank SpA, 0.00%, 16/04/2024	119	0,14
250.000	EUR	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA, 5.63%, 01/08/2027	209	0,25
200.000	EUR	Gamma Bidco SpA, 5.13%, 15/07/2025	181	0,22
175.000	EUR	Illimity Bank SpA, 3.38%, 11/12/2023	175	0,21
400.000	EUR	Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1.88%, 08/07/2026 <sup>1</sup>	355	0,43
200.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 6.63%, 13/09/2023	204	0,24
200.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.50%, 10/04/2024	195	0,23
325.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.00%, 04/07/2024	310	0,37
250.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.63%, 21/04/2025	232	0,28
200.000	EUR	Limacorporate SpA, FRN, 4.07%, 15/08/2023	192	0,23
300.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 5.75%, 18/04/2023 <sup>1</sup>	304	0,36
100.000	EUR	Pirelli & C SpA, 1.38%, 25/01/2023	100	0,12
325.000	EUR	Snam SpA, 0.00%, 12/05/2024	309	0,37
100.000	EUR	Snam SpA, 1.25%, 28/08/2025	94	0,11
100.000	EUR	TeamSystem SpA, 3.50%, 15/02/2028	83	0,10
200.000	EUR	UniCredit SpA, 6.95%, 31/10/2022	201	0,24
100.000	EUR	UniCredit SpA, 2.00%, 04/03/2023	100	0,12
100.000	EUR	Unipol Gruppo SpA, 3.00%, 18/03/2025	97	0,12
100.000	EUR	Webuild SpA, 3.88%, 28/07/2026	79	0,09
<b>Italia - Totale</b>			<b>6.741</b>	<b>8,08</b>
<b>Giappone (31 marzo 2022: 0,85%)</b>				
300.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 1.02%, 11/10/2023	294	0,35
200.000	EUR	Nidec Corp., 0.05%, 30/03/2026	174	0,21
300.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.08%, 13/12/2025	273	0,33
300.000	EUR	ORIX Corp., 1.92%, 20/04/2026	278	0,33
200.000	EUR	SoftBank Group Corp., 2.13%, 06/07/2024	184	0,22
200.000	EUR	SoftBank Group Corp., 2.88%, 06/01/2027	154	0,19
<b>Giappone - Totale</b>			<b>1.357</b>	<b>1,63</b>
<b>Jersey (31 marzo 2022: 1,33%)</b>				
127.000	EUR	Adient Global Holdings Ltd., 3.50%, 15/08/2024	118	0,14
225.000	EUR	Kane Bidco Ltd., 5.00%, 15/02/2027 <sup>1</sup>	190	0,23
<b>Jersey - Totale</b>			<b>308</b>	<b>0,37</b>
<b>Lussemburgo (31 marzo 2022: 6,18%)</b>				
175.000	EUR	Altice Financing SA, 2.25%, 15/01/2025	154	0,18
225.000	EUR	ArcelorMittal SA, 1.00%, 19/05/2023	222	0,27
100.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, FRN, 3.38%, 23/09/2024 <sup>2</sup>	66	0,08
100.000	EUR	BK LC Lux Finco1 Sarl, 5.25%, 30/04/2029	80	0,10
600.000	EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 0.38%, 17/10/2023	582	0,70
125.000	EUR	Cullinan Holdco Scsp, 4.63%, 15/10/2026	106	0,13
325.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.20%, 18/03/2026	292	0,35
100.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, FRN, 2.50%, 24/07/20232	82	0,10
200.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, FRN, 1.50%, 03/11/20262	143	0,17
200.000	EUR	Hanesbrands Finance Luxembourg SCA, 3.50%, 15/06/2024	186	0,22
200.000	EUR	Hannover Finance Luxembourg SA, FRN, 5.00%, 30/06/2043	202	0,24
275.000	EUR	Herens Midco Sarl, 5.25%, 15/05/2029	175	0,21
250.000	EUR	Highland Holdings Sarl, 0.00%, 12/11/2023	241	0,29
250.000	EUR	Highland Holdings Sarl, 0.32%, 15/12/2026	216	0,26
100.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 2.38%, 09/04/2025	97	0,12
200.000	EUR	John Deere Cash Management SARL, 1.38%, 02/04/2024	195	0,23
100.000	EUR	Kleopatra Finco Sarl, 4.25%, 01/03/2026	81	0,10
150.000	EUR	Lincoln Financing SARL, 3.63%, 01/04/2024	145	0,17
150.000	EUR	Logicor Financing Sarl, REIT, 0.63%, 17/11/2025	132	0,16
200.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.38%, 07/03/2023	199	0,24
125.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.25%, 02/07/2025	116	0,14
100.000	EUR	Picard Bondco SA, 5.38%, 01/07/2027	76	0,09
300.000	EUR	Rossini Sarl, FRN, 4.14%, 30/10/2025	286	0,34

# BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Lussemburgo (continua)</b>				
100.000	EUR	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl, 5.63%, 15/12/2026	95	0,11
275.000	EUR	Segro Capital Sarl, REIT, 1.25%, 23/03/2026	247	0,30
200.000	EUR	SES SA, 3.50%, 14/01/2029	181	0,22
200.000	EUR	SIG Combibloc PurchaseCo Sarl, 2.13%, 18/06/2025	185	0,22
200.000	EUR	SIX Finance Luxembourg SA, 0.00%, 02/12/2025	180	0,21
100.000	EUR	Stena International SA, 3.75%, 01/02/2025	92	0,11
<b>Lussemburgo - Totale</b>			<b>5.054</b>	<b>6,06</b>
<b>Paesi Bassi (31 marzo 2022: 12,77%)</b>				
100.000	EUR	ABB Finance BV, 0.63%, 03/05/2023	99	0,12
225.000	EUR	ABB Finance BV, 0.63%, 31/03/2024	218	0,26
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras Finance BV, FRN, 3.25%, 24/11/2025 <sup>2</sup>	163	0,19
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.88%, 15/01/2024	195	0,23
200.000	EUR	Aegon Bank NV, 0.63%, 21/06/2024	190	0,23
225.000	EUR	Alcon Finance BV, 2.38%, 31/05/2028	206	0,25
100.000	EUR	Allianz Finance II BV, 0.00%, 14/01/2025	94	0,11
200.000	EUR	Ashland Services BV, 2.00%, 30/01/2028	160	0,19
200.000	EUR	Citycon Treasury BV, REIT, 2.50%, 01/10/2024	190	0,23
100.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 2.75%, 23/09/2025	98	0,12
275.000	EUR	Conti-Gummi Finance BV, 2.13%, 27/11/2023	271	0,32
150.000	EUR	Conti-Gummi Finance BV, 1.13%, 25/09/2024	144	0,17
400.000	EUR	CTP NV, REIT, 0.63%, 27/09/2026	323	0,39
300.000	EUR	Danfoss Finance I BV, 0.13%, 28/04/2026	265	0,32
175.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 0.63%, 15/07/2025	157	0,19
200.000	EUR	Givaudan SA, 1.13%, 17/09/2025	189	0,23
225.000	EUR	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV, 1.25%, 29/03/2026	207	0,25
200.000	EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, REIT, FRN, 0.62%, 19/01/2024	199	0,24
100.000	EUR	Heineken NV, 2.25%, 30/03/2030	91	0,11
200.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.88%, 22/02/2023 <sup>2</sup>	197	0,24
200.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.87%, 28/01/2026 <sup>2</sup>	171	0,20
350.000	EUR	IMCD NV, 2.13%, 31/03/2027	311	0,37
200.000	EUR	ING Groep NV, 1.00%, 20/09/2023	196	0,23
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 2.13%, 23/05/2026	190	0,23
600.000	EUR	Intertrust Group BV, 3.38%, 15/11/2025	587	0,70
400.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.75%, 25/05/2023	398	0,48
375.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.00%, 16/01/2026	327	0,39
175.000	EUR	Koninklijke FrieslandCampina NV, FRN, 2.85%, 09/10/2025 <sup>2</sup>	148	0,18
300.000	EUR	Koninklijke KPN NV, FRN, 2.00%, 11/08/2024 <sup>2</sup>	273	0,33
110.000	EUR	Koninklijke KPN NV, FRN, 6.00%, 21/09/2027 <sup>2</sup>	108	0,13
200.000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 0.75%, 03/10/2022	200	0,24
200.000	EUR	Louis Dreyfus Co. Finance BV, 2.38%, 27/11/2025	189	0,23
225.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.63%, 22/08/2023	223	0,27
200.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.25%, 06/11/2023	194	0,23
175.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 2.63%, 07/04/2025	174	0,21
200.000	EUR	Naturgy Finance BV, FRN, 4.13%, 18/11/2022 <sup>2</sup>	196	0,23
200.000	EUR	NN Group NV, 0.88%, 13/01/2023	200	0,24
200.000	EUR	Nobel Bidco BV, 3.13%, 15/06/2028	135	0,16
300.000	EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 0.00%, 04/06/2024	288	0,34
300.000	EUR	Phoenix PIB Dutch Finance BV, 2.38%, 05/08/2025 <sup>1</sup>	282	0,34
200.000	EUR	Prosus NV, 1.21%, 19/01/2026	169	0,20
300.000	EUR	RELX Finance BV, 1.50%, 13/05/2027	275	0,33
100.000	EUR	Repsol International Finance BV, FRN, 3.75%, 03/11/2026 <sup>2</sup>	89	0,11
200.000	EUR	Repsol International Finance BV, FRN, 2.50%, 22/12/2026 <sup>2</sup>	159	0,19
500.000	EUR	Samvardhana Motherson Automotive Systems Group BV, 1.80%, 06/07/2024	450	0,54
425.000	EUR	Signify NV, 2.00%, 11/05/2024	413	0,50
176.000	EUR	Stellantis NV, 3.38%, 07/07/2023	176	0,21
200.000	EUR	Stellantis NV, 3.75%, 29/03/2024	201	0,24
200.000	EUR	Stellantis NV, 2.00%, 20/03/2025	192	0,23
100.000	EUR	Stellantis NV, 3.88%, 05/01/2026	99	0,12

# BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Paesi Bassi (continua)</b>				
600.000	EUR	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 3.75%, 09/05/2027	507	0,61
175.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.00%, 18/11/2025	159	0,19
100.000	EUR	Trivium Packaging Finance BV, FRN, 4.07%, 15/08/2026	93	0,11
250.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 0.75%, 28/02/2026	232	0,28
150.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.75%, 16/11/2028	138	0,16
125.000	EUR	United Group BV, FRN, 3.57%, 15/02/2026	107	0,13
150.000	EUR	Wolters Kluwer NV, 3.00%, 23/09/2026	148	0,18
<b>Paesi Bassi - Totale</b>			<b>12.053</b>	<b>14,45</b>
<b>Nuova Zelanda (31 marzo 2022: 0,32%)</b>				
200.000	EUR	Westpac Securities NZ Ltd., 0.30%, 25/06/2024	191	0,23
<b>Nuova Zelanda - Totale</b>			<b>191</b>	<b>0,23</b>
<b>Norvegia (31 marzo 2022: 0,43%)</b>				
125.000	EUR	Adevinta ASA, 2.63%, 15/11/2025	114	0,14
100.000	EUR	Norsk Hydro ASA, 1.13%, 11/04/2025	94	0,11
175.000	EUR	Sparebank 1 Oestlandet, 0.88%, 13/03/2023	174	0,21
<b>Norvegia - Totale</b>			<b>382</b>	<b>0,46</b>
<b>Portogallo (31 marzo 2022: 0,29%)</b>				
300.000	EUR	Banco Comercial Portugues SA, FRN, 4.00%, 17/05/2032	226	0,27
<b>Portogallo - Totale</b>			<b>226</b>	<b>0,27</b>
<b>Romania (31 marzo 2022: 0,22%)</b>				
200.000	EUR	UniCredit Leasing Corp. IFN SA, 0.50%, 18/10/2022	200	0,24
<b>Romania - Totale</b>			<b>200</b>	<b>0,24</b>
<b>Singapore (31 marzo 2022: 0,44%)</b>				
400.000	EUR	DBS Group Holdings Ltd., FRN, 1.50%, 11/04/2028	394	0,47
<b>Singapore - Totale</b>			<b>394</b>	<b>0,47</b>
<b>Corea del Sud (31 marzo 2022: 0,30%)</b>				
100.000	EUR	LG Chem Ltd., 0.50%, 15/04/2023	99	0,12
175.000	EUR	POSCO, 0.50%, 17/01/2024	167	0,20
<b>Corea del Sud - Totale</b>			<b>266</b>	<b>0,32</b>
<b>Spagna (31 marzo 2022: 5,18%)</b>				
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 0.63%, 15/07/2025	92	0,11
125.000	EUR	Almirall SA, 2.13%, 30/09/2026	112	0,13
100.000	EUR	Amadeus IT Group SA, 0.88%, 18/09/2023	98	0,12
500.000	EUR	Amadeus IT Group SA, FRN, 0.74%, 25/01/2024	498	0,60
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.75%, 26/11/2025	189	0,23
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 2.57%, 22/02/2029 <sup>1</sup>	288	0,35
200.000	EUR	Banco de Sabadell SA, 1.75%, 10/05/2024	191	0,23
300.000	EUR	Banco Santander SA, 2.50%, 18/03/2025	286	0,34
300.000	EUR	CaixaBank SA, 0.75%, 18/04/2023	298	0,36
100.000	EUR	CaixaBank SA, 2.38%, 01/02/2024	98	0,12
300.000	EUR	CaixaBank SA, 0.88%, 25/03/2024	290	0,35
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 2.25%, 17/04/2030	179	0,21
100.000	EUR	Cellnex Finance Co. SA, 2.25%, 12/04/2026	90	0,11
100.000	EUR	Cellnex Telecom SA, 2.88%, 18/04/2025	96	0,12
325.000	EUR	eDreams ODIGEO SA, 5.50%, 15/07/2027	262	0,31
200.000	EUR	Grifols SA, 1.63%, 15/02/2025	178	0,21
400.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 0.88%, 16/06/2025	379	0,45
200.000	EUR	Neinor Homes SA, REIT, 4.50%, 15/10/2026	168	0,20
300.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.38%, 17/01/2025	279	0,33
200.000	EUR	Unicaja Banco SA, FRN, 4.50%, 30/06/2025	199	0,24

# BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Spagna (continua)</b>				
200.000	EUR	Werfenlife SA, 0.50%, 28/10/2026	175	0,21
		<b>Spagna - Totale</b>	<b>4.445</b>	<b>5,33</b>
<b>Svezia (31 marzo 2022: 4,31%)</b>				
125.000	EUR	Dometic Group AB, 2.00%, 29/09/2028	92	0,11
300.000	EUR	Intrum AB, 4.88%, 15/08/2025	266	0,32
200.000	EUR	Lansforsakringar Bank AB, 0.88%, 25/09/2023	196	0,23
400.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 1.00%, 15/04/2025	381	0,46
125.000	EUR	Tele2 AB, 1.13%, 15/05/2024	121	0,14
475.000	EUR	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1.13%, 08/02/2027	397	0,48
100.000	EUR	Verisure Holding AB, 3.50%, 15/05/2023	100	0,12
300.000	EUR	Volvo Car AB, 2.13%, 02/04/2024	287	0,34
100.000	EUR	Volvo Car AB, 2.00%, 24/01/2025	92	0,11
275.000	EUR	Volvo Treasury AB, 0.00%, 11/02/2023	273	0,33
100.000	EUR	Volvo Treasury AB, 0.13%, 17/09/2024	94	0,11
425.000	EUR	Volvo Treasury AB, 1.63%, 26/05/2025	407	0,49
		<b>Svezia - Totale</b>	<b>2.706</b>	<b>3,24</b>
<b>Svizzera (31 marzo 2022: 0,91%)</b>				
100.000	EUR	Credit Suisse Group AG, FRN, 3.25%, 02/04/2026	95	0,11
500.000	EUR	UBS AG, 0.75%, 21/04/2023	496	0,59
300.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 2.75%, 15/06/2027	283	0,34
		<b>Svizzera - Totale</b>	<b>874</b>	<b>1,04</b>
<b>Regno Unito (31 marzo 2022: 4,59%)</b>				
200.000	EUR	Barclays plc, FRN, 3.38%, 02/04/2025	197	0,24
125.000	EUR	Barclays plc, FRN, 0.75%, 09/06/2025	117	0,14
200.000	EUR	Barclays plc, FRN, 1.37%, 24/01/2026	186	0,22
200.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.13%, 26/05/2024	194	0,23
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.75%, 27/03/2026	95	0,11
150.000	EUR	Diageo Finance plc, 1.00%, 22/04/2025	143	0,17
375.000	EUR	Drax Finco plc, 2.63%, 01/11/2025	334	0,40
400.000	EUR	EC Finance plc, 3.00%, 15/10/2026	349	0,42
325.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 3.02%, 15/06/2027	306	0,37
178.000	EUR	Informa plc, FRN, 1.50%, 05/07/2023	176	0,21
200.000	EUR	Jaguar Land Rover Automotive plc, 2.20%, 15/01/2024 <sup>1</sup>	179	0,21
150.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 3.50%, 01/04/2026	147	0,18
150.000	EUR	Mitsubishi HC Capital UK plc, 0.13%, 29/11/2022	149	0,18
225.000	EUR	Mitsubishi HC Capital UK plc, 0.25%, 03/02/2025	206	0,25
175.000	EUR	National Grid Electricity Transmission plc, 0.19%, 20/01/2025	164	0,20
225.000	EUR	National Grid plc, 2.18%, 30/06/2026	213	0,26
350.000	EUR	NGG Finance plc, FRN, 1.62%, 05/12/2079	316	0,38
200.000	EUR	Nomad Foods Bondco plc, 2.50%, 24/06/2028	155	0,19
200.000	EUR	OTE plc, 0.88%, 24/09/2026	182	0,22
175.000	EUR	SIG plc, 5.25%, 30/11/2026	137	0,16
275.000	EUR	Synthomer plc, 3.88%, 01/07/2025 <sup>1</sup>	226	0,27
100.000	EUR	TI Automotive Finance plc, 3.75%, 15/04/2029	68	0,08
125.000	EUR	Virgin Money UK plc, FRN, 0.38%, 27/05/2024	122	0,14
		<b>Regno Unito - Totale</b>	<b>4.361</b>	<b>5,23</b>
<b>Stati Uniti (31 marzo 2022: 18,25%)</b>				
400.000	EUR	American Honda Finance Corp., 1.95%, 18/10/2024	391	0,47
150.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 0.40%, 15/02/2027	126	0,15
150.000	EUR	AT&T, Inc., 1.05%, 05/09/2023	147	0,18
400.000	EUR	Athene Global Funding, 1.88%, 23/06/2023	397	0,48
175.000	EUR	Athene Global Funding, 1.24%, 08/04/2024	169	0,20
100.000	EUR	Autoliv, Inc., 0.75%, 26/06/2023	98	0,12
375.000	EUR	Avantor Funding, Inc., 2.63%, 01/11/2025 <sup>1</sup>	343	0,41
300.000	EUR	Ball Corp., 1.50%, 15/03/2027	251	0,30



# BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>				
<b>Stati Uniti (continua)</b>				
250.000	EUR	Baxter International, Inc., 0.40%, 15/05/2024	240	0,29
200.000	EUR	Becton Dickinson and Co., 1.00%, 15/12/2022	199	0,24
100.000	EUR	Becton Dickinson and Co., 0.00%, 13/08/2023	98	0,12
100.000	EUR	Becton Dickinson and Co., 0.03%, 13/08/2025	91	0,11
200.000	EUR	Belden, Inc., 3.38%, 15/07/2027	177	0,21
175.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 0.00%, 12/03/2025	163	0,19
675.000	EUR	Berry Global, Inc., 1.00%, 15/01/2025 <sup>1</sup>	616	0,74
300.000	EUR	Blackstone Private Credit Fund, 1.75%, 30/11/2026	245	0,29
200.000	EUR	Capital One Financial Corp., 0.80%, 12/06/2024	190	0,23
350.000	EUR	Catalent Pharma Solutions, Inc., 2.38%, 01/03/2028	271	0,33
300.000	EUR	Citigroup, Inc., 0.75%, 26/10/2023	293	0,35
100.000	EUR	Citigroup, Inc., 2.38%, 22/05/2024	99	0,12
200.000	EUR	Comcast Corp., 0.00%, 14/09/2026	175	0,21
350.000	EUR	Coty, Inc., 3.88%, 15/04/2026	317	0,38
225.000	EUR	Danaher Corp., 1.70%, 30/03/2024	220	0,26
600.000	EUR	Digital Euro Finco LLC, REIT, 2.63%, 15/04/2024	583	0,70
200.000	EUR	Ecolab, Inc., 1.00%, 15/01/2024	195	0,23
100.000	EUR	Encore Capital Group, Inc., 4.88%, 15/10/2025	93	0,11
200.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 0.13%, 03/12/2022	200	0,24
275.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 0.75%, 21/05/2023	272	0,33
725.000	EUR	Fiserv, Inc., 0.38%, 01/07/2023	712	0,85
150.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 1.51%, 17/02/2023	149	0,18
125.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 1.74%, 19/07/2024	115	0,14
200.000	EUR	General Mills, Inc., 0.13%, 15/11/2025	181	0,22
200.000	EUR	General Mills, Inc., 0.45%, 15/01/2026	181	0,22
300.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 0.96%, 07/09/2023	292	0,35
275.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 2.20%, 01/04/2024	268	0,32
100.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.38%, 15/05/2024	97	0,12
150.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.13%, 19/08/2024	141	0,17
400.000	EUR	Harley-Davidson Financial Services, Inc., 0.90%, 19/11/2024 <sup>1</sup>	378	0,45
100.000	EUR	Harley-Davidson Financial Services, Inc., FRN, 3.88%, 19/05/2023	100	0,12
500.000	EUR	IQVIA, Inc., 2.88%, 15/09/2025	471	0,57
125.000	EUR	IQVIA, Inc., 1.75%, 15/03/2026 <sup>1</sup>	109	0,13
300.000	EUR	Kronos International, Inc., 3.75%, 15/09/2025	261	0,31
100.000	EUR	Levi Strauss & Co., 3.38%, 15/03/2027	92	0,11
300.000	EUR	McKesson Corp., 1.50%, 17/11/2025	284	0,34
200.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.38%, 09/04/2024	193	0,23
400.000	EUR	MMS USA Holdings, Inc., 0.63%, 13/06/2025	371	0,44
100.000	EUR	Morgan Stanley, 1.75%, 11/03/2024	98	0,12
225.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 0.64%, 26/07/2024	220	0,27
175.000	EUR	MPT Operating Partnership LP, REIT, FRN, 0.99%, 15/10/2026	142	0,17
125.000	EUR	National Grid North America, Inc., 0.41%, 20/01/2026	112	0,13
175.000	EUR	Netflix, Inc., FRN, 3.00%, 15/06/2025	170	0,20
100.000	EUR	Netflix, Inc., FRN, 3.63%, 15/05/2027	95	0,11
175.000	EUR	Organon & Co., 2.88%, 30/04/2028	140	0,17
225.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.25%, 06/05/2024	217	0,26
125.000	EUR	PPG Industries, Inc., 1.88%, 01/06/2025	119	0,14
175.000	EUR	Primo Water Holdings, Inc., 3.88%, 31/10/2028	142	0,17
300.000	EUR	Prologis LP, REIT, 3.00%, 02/06/2026 <sup>1</sup>	293	0,35
300.000	EUR	Silgan Holdings, Inc., 3.25%, 15/03/2025	283	0,34
100.000	EUR	Silgan Holdings, Inc., 2.25%, 01/06/2028	81	0,10
200.000	EUR	Standard Industries, Inc., 2.25%, 21/11/2026	159	0,19
400.000	EUR	Stryker Corp., 1.13%, 30/11/2023	392	0,47
250.000	EUR	Stryker Corp., 0.25%, 03/12/2024	234	0,28
400.000	EUR	Sysco Corp., 1.25%, 23/06/2023	394	0,47
500.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 0.75%, 12/09/2024	480	0,58
300.000	EUR	Xylem, Inc., 2.25%, 11/03/2023	296	0,35



# BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto	
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>					
<b>Titoli del debito societario (continua)</b>					
		<b>Stati Uniti (continua)</b>			
100.000	EUR	ZF North America Capital, Inc., 2.75%, 27/04/2023	99	0,12	
		<b>Stati Uniti - Totale</b>	<b>15.220</b>	<b>18,25</b>	
Totale investimenti in titoli di debito societario			<b>80.754</b>	<b>96,81</b>	
<b>Titoli sovranazionali (31 marzo 2022: 0,74%)</b>					
250.000	EUR	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC, 2.00%, 01/09/2028	192	0,23	
275.000	EUR	Ardagh Packaging Finance plc, 2.13%, 15/08/2026	212	0,26	
200.000	EUR	Clarios Global LP, 4.38%, 15/05/2026	177	0,21	
Totale investimenti in titoli sovranazionali			<b>581</b>	<b>0,70</b>	
Totale investimenti in obbligazioni			<b>81.335</b>	<b>97,51</b>	
Descrizione		Controparte	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti di cambio a termine<sup>3</sup></b>					
<b>Classe D CHF coperta ad accumulazione</b>					
Buy CHF 1,851,586; Sell EUR 1,915,683		J.P. Morgan	14/10/2022	5	0,01
Buy EUR 42,104; Sell CHF 40,328 <sup>4</sup>		J.P. Morgan	14/10/2022	-	-
Totale utili non realizzati (31 marzo 2022: 0,00%)				<b>5</b>	<b>0,01</b>
<b>Classe Z CHF coperta ad accumulazione</b>					
Buy CHF 9,400,472; Sell EUR 9,725,889		J.P. Morgan	14/10/2022	26	0,03
Buy EUR 277,551; Sell CHF 265,850		J.P. Morgan	14/10/2022	1	-
Totale utili non realizzati (31 marzo 2022: 0,00%)				<b>27</b>	<b>0,03</b>
Totale utili non realizzati su contratti di cambio a termine (31 marzo 2022: 0,00%)				<b>32</b>	<b>0,04</b>
<b>Contratti di cambio a termine<sup>3</sup></b>					
<b>Classe D CHF coperta ad accumulazione</b>					
Totale perdite non realizzate (31 marzo 2022: 0,00%) <sup>5</sup>				<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Classe Z CHF coperta ad accumulazione</b>					
Buy EUR 14,888; Sell CHF 14,355 <sup>4</sup>		J.P. Morgan	14/10/2022	-	-
Totale perdite non realizzate (31 marzo 2022: (0,01)%)				<b>-</b>	<b>-</b>
Totale perdite non realizzate su contratti di cambio a termine (31 marzo 2022: (0,01)%)				<b>-</b>	<b>-</b>

# BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

		Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico		81.367	97,55
Liquidità		55	0,07
Strumenti liquidi equivalenti			
Partecipazione	Valuta	Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2022: 2,48%) BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0) <sup>6</sup>	
15.602	EUR	1.531	1,83
Totale in strumenti liquidi equivalenti		<u>1.531</u>	<u>1,83</u>
Altre attività e passività		<u>462</u>	<u>0,55</u>
<b>Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>		<b><u>83.415</u></b>	<b><u>100,00</u></b>

### Analisi del totale attività

	% del totale attività
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	97,27
Organismi di investimento collettivo	1,83
Strumenti finanziari derivati OTC	0,04
Altre attività	<u>0,86</u>
<b>Totale attività</b>	<b><u>100,00</u></b>

<sup>1</sup>Titolo parzialmente o completamente in prestito.

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

<sup>3</sup>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.

<sup>4</sup>Gli investimenti inferiori a EUR 500 sono stati arrotondati a zero.

<sup>5</sup>Percentuale del valore patrimoniale netto dell'anno precedente arrotondata allo 0,00%.

<sup>6</sup>Una parte correlata al Fondo.

	Sui guadagni Migliaia di EUR	Sulle perdite Migliaia di EUR
<b>Valore dell'esposizione</b>		
Contratti di cambio a termine	11.987	15

# BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI</b>				
<b>Titoli di Stato (31 marzo 2022: 98,67%)</b>				
<b>Australia (31 marzo 2022: 7,69%)</b>				
1.167.000	AUD	Australia Government Bond, 2.75%, 21/04/2024	759	0,79
665.000	AUD	Australia Government Bond, 0.25%, 21/11/2024	408	0,43
320.000	AUD	Australia Government Bond, 3.25%, 21/04/2025	209	0,22
767.000	AUD	Australia Government Bond, 0.25%, 21/11/2025	454	0,48
11.000	AUD	Australia Government Bond, 4.25%, 21/04/2026	7	0,01
2.214.000	AUD	Australia Government Bond, 4.75%, 21/04/2027	1.519	1,60
595.000	AUD	Australia Government Bond, 2.75%, 21/11/2027	373	0,39
365.000	AUD	Australia Government Bond, 2.75%, 21/11/2028	227	0,24
630.000	AUD	Australia Government Bond, 3.25%, 21/04/2029	401	0,42
660.000	AUD	Australia Government Bond, 2.75%, 21/11/2029	405	0,43
295.000	AUD	Australia Government Bond, 1.00%, 21/12/2030	155	0,16
225.000	AUD	Australia Government Bond, 1.50%, 21/06/2031	122	0,13
335.000	AUD	Australia Government Bond, 1.00%, 21/11/2031	172	0,18
328.000	AUD	Australia Government Bond, 1.25%, 21/05/2032	170	0,18
833.000	AUD	Australia Government Bond, 4.50%, 21/04/2033	575	0,60
100.000	AUD	Australia Government Bond, 3.75%, 21/04/2037	63	0,07
850.000	AUD	Australia Government Bond, 3.25%, 21/06/2039	501	0,53
421.000	AUD	Australia Government Bond, 3.00%, 21/03/2047	229	0,24
582.000	AUD	Australia Government Bond, 1.75%, 21/06/2051	232	0,24
<b>Australia - Totale</b>			<b>6.981</b>	<b>7,34</b>
<b>Austria (31 marzo 2022: 2,69%)</b>				
400.000	EUR	Austria Government Bond, 1.65%, 21/10/2024	398	0,42
69.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/04/2025	66	0,07
360.000	EUR	Austria Government Bond, 1.20%, 20/10/2025	351	0,37
250.000	EUR	Austria Government Bond, 0.75%, 20/10/2026	236	0,25
311.000	EUR	Austria Government Bond, 0.75%, 20/02/2028	285	0,30
112.000	EUR	Austria Government Bond, 0.50%, 20/02/2029	99	0,10
90.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/02/2030	74	0,08
303.000	EUR	Austria Government Bond, 0.00%, 20/02/2031	243	0,25
222.000	EUR	Austria Government Bond, 4.15%, 15/03/2037	253	0,27
72.000	EUR	Austria Government Bond, 3.15%, 20/06/2044	76	0,08
90.000	EUR	Austria Government Bond, 1.50%, 20/02/2047	68	0,07
36.000	EUR	Austria Government Bond, 1.85%, 23/05/2049	29	0,03
89.000	EUR	Austria Government Bond, 0.75%, 20/03/2051	53	0,05
60.000	EUR	Austria Government Bond, 3.80%, 26/01/2062	72	0,08
92.000	EUR	Austria Government Bond, 0.70%, 20/04/2071	43	0,04
70.000	EUR	Austria Government Bond, 1.50%, 02/11/2086	44	0,05
34.000	EUR	Austria Government Bond, 2.10%, 20/09/2117	26	0,03
8.000	EUR	Austria Government Bond, 0.85%, 30/06/2120	3	-
<b>Austria - Totale</b>			<b>2.419</b>	<b>2,54</b>
<b>Belgio (31 marzo 2022: 1,65%)</b>				
125.000	EUR	Belgium Government Bond, 2.25%, 22/06/2023	126	0,13
90.000	EUR	Belgium Government Bond, 2.60%, 22/06/2024	91	0,10
180.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.80%, 22/06/2025	175	0,18
406.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.80%, 22/06/2028	372	0,39
131.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.10%, 22/06/2030	109	0,12
50.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.00%, 22/10/2031	39	0,04
69.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.35%, 22/06/2032	55	0,06
265.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.25%, 22/04/2033	230	0,24
43.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.90%, 22/06/2038	37	0,04
203.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.40%, 22/06/2040	129	0,14
27.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.60%, 22/06/2047	20	0,02
102.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.70%, 22/06/2050	76	0,08
10.000	EUR	Belgium Government Bond, 1.40%, 22/06/2053	7	0,01
50.000	EUR	Belgium Government Bond, 2.25%, 22/06/2057	42	0,04
23.000	EUR	Belgium Government Bond, 2.15%, 22/06/2066	19	0,02

# BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
<b>Belgio (continua)</b>				
30.000	EUR	Belgium Government Bond, 0.65%, 22/06/2071	13	0,01
		<b>Belgio - Totale</b>	<b>1.540</b>	<b>1,62</b>
<b>Canada (31 marzo 2022: 8,71%)</b>				
590.000	CAD	Canada Government Bond, 2.00%, 01/09/2023	431	0,45
154.000	CAD	Canada Government Bond, 0.50%, 01/11/2023	110	0,12
838.000	CAD	Canada Government Bond, 0.25%, 01/04/2024	591	0,62
553.000	CAD	Canada Government Bond, 1.50%, 01/09/2024	394	0,41
140.000	CAD	Canada Government Bond, 1.50%, 01/04/2025	98	0,10
370.000	CAD	Canada Government Bond, 0.50%, 01/09/2025	251	0,26
580.000	CAD	Canada Government Bond, 0.25%, 01/03/2026	386	0,41
260.000	CAD	Canada Government Bond, 1.50%, 01/06/2026	180	0,19
102.000	CAD	Canada Government Bond, 8.00%, 01/06/2027	91	0,10
522.000	CAD	Canada Government Bond, 2.00%, 01/06/2028	363	0,38
430.000	CAD	Canada Government Bond, 2.25%, 01/06/2029	301	0,32
161.000	CAD	Canada Government Bond, 1.25%, 01/06/2030	104	0,11
244.000	CAD	Canada Government Bond, 0.50%, 01/12/2030	146	0,15
398.000	CAD	Canada Government Bond, 1.50%, 01/06/2031	258	0,27
301.000	CAD	Canada Government Bond, 1.50%, 01/12/2031	194	0,20
227.000	CAD	Canada Government Bond, 2.00%, 01/06/2032	152	0,16
115.000	CAD	Canada Government Bond, 5.75%, 01/06/2033	105	0,11
130.000	CAD	Canada Government Bond, 5.00%, 01/06/2037	116	0,12
159.000	CAD	Canada Government Bond, 4.00%, 01/06/2041	131	0,14
90.000	CAD	Canada Government Bond, 3.50%, 01/12/2045	70	0,07
218.000	CAD	Canada Government Bond, 2.75%, 01/12/2048	151	0,16
452.000	CAD	Canada Government Bond, 2.00%, 01/12/2051	265	0,28
275.000	CAD	Canada Government Bond, 1.75%, 01/12/2053	150	0,16
79.000	CAD	Canada Government Bond, 2.75%, 01/12/2064	54	0,06
		<b>Canada - Totale</b>	<b>5.092</b>	<b>5,35</b>
<b>Cina (31 marzo 2022: 6,66%)</b>				
6.180.000	CNY	China Government Bond, 2.75%, 01/09/2023	892	0,94
4.600.000	CNY	China Government Bond, 2.18%, 25/06/2024	659	0,69
12.860.000	CNY	China Government Bond, 1.99%, 09/04/2025	1.828	1,92
7.100.000	CNY	China Government Bond, 2.69%, 12/08/2026	1.024	1,08
3.590.000	CNY	China Government Bond, 2.85%, 04/06/2027	521	0,55
15.200.000	CNY	China Government Bond, 2.68%, 21/05/2030	2.166	2,28
2.450.000	CNY	China Government Bond, 4.09%, 27/04/2035	394	0,41
1.320.000	CNY	China Government Bond, 3.52%, 25/04/2046	200	0,21
2.610.000	CNY	China Government Bond, 4.08%, 22/10/2048	433	0,45
4.000.000	CNY	China Government Bond, 3.72%, 12/04/2051	625	0,66
4.290.000	CNY	China Government Bond, 4.33%, 10/11/2061	770	0,81
200.000	CNY	China Government Bond, 3.76%, 22/03/2071	33	0,03
500.000	CNY	People's Republic of China, 3.02%, 27/05/2031	73	0,08
		<b>Cina - Totale</b>	<b>9.618</b>	<b>10,11</b>
<b>Colombia (31 marzo 2022: 0,53%)</b>				
			-	-
<b>Cipro (31 marzo 2022: 0,02%)</b>				
20.000	EUR	Cyprus Government Bond, 2.25%, 16/04/2050	14	0,01
		<b>Cipro - Totale</b>	<b>14</b>	<b>0,01</b>
<b>Repubblica ceca (31 marzo 2022: 0,00%)</b>				
4.020.000	CZK	Czech Government Bond, 1.25%, 14/02/2025	147	0,15
3.220.000	CZK	Czech Government Bond, 0.25%, 10/02/2027	105	0,11
4.960.000	CZK	Czech Government Bond, 2.75%, 23/07/2029	173	0,18
3.980.000	CZK	Czech Government Bond, 1.75%, 23/06/2032	119	0,13

# BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
<b>Repubblica Ceca (continua)</b>				
1.740.000	CZK	Czech Government Bond, 4.20%, 04/12/2036	63	0,07
		<b>Repubblica Ceca - Totale</b>	<b>607</b>	<b>0,64</b>
<b>Danimarca (31 marzo 2022: 1,24%)</b>				
1.709.000	DKK	Denmark Government Bond, 1.50%, 15/11/2023	229	0,24
2.421.000	DKK	Denmark Government Bond, 0.50%, 15/11/2027	297	0,31
657.000	DKK	Denmark Government Bond, 0.50%, 15/11/2029	77	0,08
2.685.000	DKK	Denmark Government Bond, 4.50%, 15/11/2039	455	0,48
625.000	DKK	Denmark Government Bond, 0.25%, 15/11/2052	44	0,05
		<b>Danimarca - Totale</b>	<b>1.102</b>	<b>1,16</b>
<b>Finlandia (31 marzo 2022: 1,18%)</b>				
311.000	EUR	Finland Government Bond, 0.00%, 15/09/2023	306	0,32
384.000	EUR	Finland Government Bond, 2.75%, 04/07/2028	390	0,41
88.000	EUR	Finland Government Bond, 1.13%, 15/04/2034	73	0,08
128.000	EUR	Finland Government Bond, 0.13%, 15/04/2036	90	0,10
80.000	EUR	Finland Government Bond, 0.25%, 15/09/2040	51	0,05
47.000	EUR	Finland Government Bond, 2.63%, 04/07/2042	45	0,05
104.000	EUR	Finland Government Bond, 1.38%, 15/04/2047	80	0,08
26.000	EUR	Finland Government Bond, 0.13%, 15/04/2052	13	0,01
		<b>Finlandia - Totale</b>	<b>1.048</b>	<b>1,10</b>
<b>Francia (31 marzo 2022: 4,71%)</b>				
253.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2024	247	0,26
253.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2025	241	0,25
685.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2025	658	0,69
220.000	EUR	France Government Bond OAT, 3.50%, 25/04/2026	230	0,24
475.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.00%, 25/05/2027	449	0,47
219.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2028	201	0,21
436.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/11/2028	396	0,42
104.000	EUR	France Government Bond OAT, 5.50%, 25/04/2029	123	0,13
701.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2029	620	0,65
96.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2031	89	0,09
110.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/11/2031 <sup>1</sup>	87	0,09
394.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/05/2032	306	0,32
170.000	EUR	France Government Bond OAT, 5.75%, 25/10/2032	215	0,23
54.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.00%, 25/11/2032	51	0,05
150.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.75%, 25/04/2035	178	0,19
88.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.25%, 25/05/2036	71	0,08
242.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.25%, 25/05/2038	189	0,20
104.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2040	68	0,07
115.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.50%, 25/04/2041	137	0,15
116.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/06/2044	71	0,08
119.000	EUR	France Government Bond OAT, 2.00%, 25/05/2048	98	0,10
173.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2053	96	0,10
74.000	EUR	France Government Bond OAT, 4.00%, 25/04/2060	90	0,09
60.000	EUR	France Government Bond OAT, 1.75%, 25/05/2066	43	0,05
57.000	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2072	23	0,02
		<b>Francia - Totale</b>	<b>4.977</b>	<b>5,23</b>
<b>Germania (31 marzo 2022: 9,28%)</b>				
689.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.00%, 15/08/2023	692	0,73
190.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.25%, 04/01/2024	201	0,21
960.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.75%, 15/02/2024 <sup>1</sup>	963	1,01
280.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.50%, 15/05/2024 <sup>1</sup>	280	0,29
150.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.00%, 15/08/2025 <sup>1</sup>	147	0,15
188.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2026 <sup>1</sup>	175	0,19
640.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/02/2027 <sup>1</sup>	597	0,63
1.310.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.50%, 04/07/2027	1.576	1,66

# BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
<b>Germania (continua)</b>				
928.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/08/2028 <sup>1</sup>	840	0,88
140.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2029 <sup>1</sup>	122	0,13
380.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.50%, 04/01/2031	479	0,50
277.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/02/2031 <sup>1</sup>	234	0,25
58.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/02/2032 <sup>1</sup>	48	0,05
250.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.75%, 04/07/2034 <sup>1</sup>	318	0,33
411.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.00%, 04/01/2037	501	0,53
137.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.25%, 04/07/2039	176	0,19
196.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.75%, 04/07/2040	269	0,28
213.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 3.25%, 04/07/2042	249	0,26
278.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.50%, 04/07/2044	296	0,31
434.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.25%, 15/08/2048 <sup>1</sup>	362	0,38
238.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2050	134	0,14
198.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2050	112	0,12
231.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2052	125	0,13
		<b>Germania - Totale</b>	<b>8.896</b>	<b>9,35</b>
<b>Hong Kong (31 marzo 2022: 0,00%)</b>				
500.000	HKD	Hong Kong Government Bond, 1.97%, 17/01/2029	59	0,06
		<b>Hong Kong - Totale</b>	<b>59</b>	<b>0,06</b>
<b>Indonesia (31 marzo 2022: 2,23%)</b>				
8.412.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 6.50%, 15/06/2025	560	0,59
639.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 7.25%, 15/02/2026	44	0,04
4.443.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 8.25%, 15/05/2029	313	0,33
8.026.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 7.00%, 15/09/2030	528	0,55
7.168.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 7.50%, 15/06/2035	481	0,51
1.220.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 6.25%, 15/06/2036	74	0,08
3.654.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 8.38%, 15/04/2039	263	0,28
1.225.000.000	IDR	Indonesia Government Bond, 7.13%, 15/06/2042	80	0,08
		<b>Indonesia - Totale</b>	<b>2.343</b>	<b>2,46</b>
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 1,52%)</b>				
205.000	EUR	Ireland Government Bond, 3.40%, 18/03/2024	210	0,22
27.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.00%, 15/05/2026	26	0,03
340.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.20%, 15/05/2027	310	0,33
160.000	EUR	Ireland Government Bond, 0.90%, 15/05/2028	148	0,15
90.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.10%, 15/05/2029	83	0,09
70.000	EUR	Ireland Government Bond, 2.40%, 15/05/2030	70	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	27	0,03
180.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.70%, 15/05/2037	155	0,16
196.000	EUR	Ireland Government Bond, 2.00%, 18/02/2045	165	0,17
71.000	EUR	Ireland Government Bond, 1.50%, 15/05/2050	51	0,05
		<b>Irlanda - Totale</b>	<b>1.280</b>	<b>1,34</b>
<b>Israele (31 marzo 2022: 0,77%)</b>				
1.205.000	ILS	Israel Government Bond, 3.75%, 31/03/2024	349	0,37
991.000	ILS	Israel Government Bond, 2.00%, 31/03/2027	272	0,29
306.000	ILS	Israel Government Bond, 1.00%, 31/03/2030	74	0,08
426.000	ILS	Israel Government Bond, 1.30%, 30/04/2032	102	0,11
486.000	ILS	Israel Government Bond, 1.50%, 31/05/2037	108	0,11
293.000	ILS	Israel Government Bond, 5.50%, 31/01/2042	109	0,11
303.000	ILS	Israel Government Bond, 3.75%, 31/03/2047	87	0,09
		<b>Israele - Totale</b>	<b>1.101</b>	<b>1,16</b>
<b>Italia (31 marzo 2022: 3,04%)</b>				
253.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.85%, 15/05/2024	249	0,26



# BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
<b>Italia (continua)</b>				
181.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.75%, 01/07/2024	178	0,19
565.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.50%, 01/03/2026	586	0,62
87.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.00%, 01/08/2026	76	0,08
85.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.00%, 01/02/2028	78	0,08
436.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.00%, 01/08/2029	410	0,43
456.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.50%, 01/03/2030	440	0,46
16.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.60%, 01/08/2031	12	0,01
94.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.50%, 01/12/2032 <sup>1</sup>	79	0,08
337.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.35%, 01/03/2035	301	0,32
330.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.95%, 01/09/2038	273	0,29
28.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.80%, 01/03/2041	19	0,02
96.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.45%, 01/03/2048	82	0,09
37.000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.15%, 01/03/2072	22	0,02
<b>Italia - Totale</b>			<b>2.805</b>	<b>2,95</b>
<b>Giappone (31 marzo 2022: 4,89%)</b>				
4.300.000	JPY	Japan Government Forty Year Bond, 2.20%, 20/03/2051	36	0,04
2.750.000	JPY	Japan Government Forty Year Bond, 2.00%, 20/03/2052	22	0,02
18.550.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.60%, 20/03/2024	132	0,14
80.350.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.60%, 20/06/2024	573	0,60
4.100.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.40%, 20/09/2025	29	0,03
27.550.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.10%, 20/03/2026	195	0,21
19.950.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.10%, 20/09/2027	141	0,15
21.500.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.10%, 20/06/2028	151	0,16
4.000.000	JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.10%, 20/06/2030	28	0,03
7.850.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.50%, 20/09/2036	69	0,07
15.800.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.30%, 20/12/2036	136	0,14
7.900.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.30%, 20/03/2039	68	0,07
16.050.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.30%, 20/03/2040	139	0,15
8.100.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.00%, 20/09/2040	67	0,07
29.250.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.00%, 20/09/2041	243	0,26
25.150.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.50%, 20/03/2045	191	0,20
3.550.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.60%, 20/06/2045	27	0,03
7.250.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.60%, 20/12/2046	45	0,05
13.000.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.80%, 20/03/2047	84	0,09
6.050.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.80%, 20/12/2047	39	0,04
11.750.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.70%, 20/09/2051	70	0,07
7.050.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.00%, 20/03/2052	45	0,05
38.800.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.10%, 20/12/2026	298	0,31
33.150.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.10%, 20/03/2027	255	0,27
13.600.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.10%, 20/09/2029	109	0,11
31.850.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.90%, 20/09/2030	254	0,27
43.500.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.00%, 20/03/2031	351	0,37
6.850.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.80%, 20/09/2031	55	0,06
6.500.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.70%, 20/09/2032	52	0,05
15.100.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.70%, 20/09/2033	121	0,13
10.150.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.60%, 20/12/2033	81	0,08
18.550.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.40%, 20/09/2034	145	0,15
17.750.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.40%, 20/03/2036	122	0,13
12.350.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.20%, 20/06/2036	82	0,09
1.700.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.60%, 20/06/2037	12	0,01
12.950.000	JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.60%, 20/12/2037	89	0,09
31.250.000	JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.01%, 01/08/2024	221	0,23
<b>Giappone - Totale</b>			<b>4.777</b>	<b>5,02</b>
<b>Lettonia (31 marzo 2022: 0,08%)</b>				
100.000	EUR	Latvia Government Bond, 0.00%, 17/03/2031	75	0,08
<b>Lettonia - Totale</b>			<b>75</b>	<b>0,08</b>

# BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
<b>Lituania (31 marzo 2022: 0,05%)</b>				
56.000	EUR	Lithuania Government Bond, 0.75%, 06/05/2030	45	0,05
		<b>Lituania - Totale</b>	<b>45</b>	<b>0,05</b>
<b>Lussemburgo (31 marzo 2022: 0,03%)</b>				
36.000	EUR	State of the Grand-Duchy of Luxembourg, 0.00%, 24/03/2031	28	0,03
		<b>Lussemburgo - Totale</b>	<b>28</b>	<b>0,03</b>
<b>Malesia (31 marzo 2022: 1,73%)</b>				
1.619.000	MYR	Malaysia Government Bond, 4.09%, 30/11/2023	360	0,38
613.000	MYR	Malaysia Government Bond, 3.48%, 14/06/2024	135	0,14
710.000	MYR	Malaysia Government Bond, 3.90%, 30/11/2026	156	0,16
1.390.000	MYR	Malaysia Government Bond, 4.13%, 09/07/2029	302	0,32
210.000	MYR	Malaysia Government Bond, 2.63%, 15/04/2031	40	0,04
394.000	MYR	Malaysia Government Bond, 4.72%, 15/06/2033	88	0,09
1.588.000	MYR	Malaysia Government Bond, 3.83%, 05/07/2034	322	0,34
842.000	MYR	Malaysia Government Bond, 3.76%, 22/05/2040	160	0,17
655.000	MYR	Malaysia Government Bond, 4.64%, 15/11/2049	138	0,15
319.000	MYR	Malaysia Government Bond, 4.07%, 15/06/2050	60	0,06
		<b>Malesia - Totale</b>	<b>1.761</b>	<b>1,85</b>
<b>Paesi Bassi (31 marzo 2022: 3,57%)</b>				
328.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/01/2024	321	0,34
87.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.25%, 15/07/2025	83	0,09
894.496	EUR	Netherlands Government Bond, 0.50%, 15/07/2026	847	0,89
177.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.75%, 15/07/2027	166	0,17
306.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.75%, 15/07/2028	282	0,30
61.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.25%, 15/07/2029	53	0,05
180.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.50%, 15/07/2032	150	0,16
315.000	EUR	Netherlands Government Bond, 2.50%, 15/01/2033	317	0,33
83.000	EUR	Netherlands Government Bond, 4.00%, 15/01/2037	96	0,10
192.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/01/2038	130	0,14
90.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.50%, 15/01/2040	64	0,07
245.000	EUR	Netherlands Government Bond, 3.75%, 15/01/2042	290	0,30
214.000	EUR	Netherlands Government Bond, 2.75%, 15/01/2047	227	0,24
188.000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.00%, 15/01/2052	95	0,10
		<b>Paesi Bassi - Totale</b>	<b>3.121</b>	<b>3,28</b>
<b>Nuova Zelanda (31 marzo 2022: 1,18%)</b>				
626.000	NZD	New Zealand Government Bond, 0.50%, 15/05/2024	341	0,36
199.000	NZD	New Zealand Government Bond, 4.50%, 15/04/2027	116	0,12
245.000	NZD	New Zealand Government Bond, 3.00%, 20/04/2029	132	0,14
63.000	NZD	New Zealand Government Bond, 2.00%, 15/05/2032	30	0,03
220.000	NZD	New Zealand Government Bond, 3.50%, 14/04/2033	118	0,12
210.000	NZD	New Zealand Government Bond, 2.75%, 15/04/2037	98	0,10
148.000	NZD	New Zealand Government Bond, 1.75%, 15/05/2041	54	0,06
83.000	NZD	New Zealand Government Bond, 2.75%, 15/05/2051	34	0,04
		<b>Nuova Zelanda - Totale</b>	<b>923</b>	<b>0,97</b>
<b>Norvegia (31 marzo 2022: 0,73%)</b>				
3.175.000	NOK	Norway Government Bond, 1.75%, 13/03/2025 <sup>1</sup>	288	0,30
982.000	NOK	Norway Government Bond, 1.50%, 19/02/2026	87	0,09
775.000	NOK	Norway Government Bond, 2.00%, 26/04/2028	68	0,07
869.000	NOK	Norway Government Bond, 1.38%, 19/08/2030	71	0,08
705.000	NOK	Norway Government Bond, 1.25%, 17/09/2031	56	0,06
357.000	NOK	Norway Government Bond, 2.13%, 18/05/2032	30	0,03
		<b>Norvegia - Totale</b>	<b>600</b>	<b>0,63</b>

# BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
		<b>Perù (31 marzo 2022: 0,28%)</b>	-	-
		<b>Russia (31 marzo 2022: 0,04%)</b>	-	-
		<b>Singapore (31 marzo 2022: 1,44%)</b>		
320.000	SGD	Singapore Government Bond, 3.00%, 01/09/2024	226	0,24
508.000	SGD	Singapore Government Bond, 3.50%, 01/03/2027	360	0,38
90.000	SGD	Singapore Government Bond, 2.63%, 01/05/2028	61	0,06
576.000	SGD	Singapore Government Bond, 2.88%, 01/09/2030	392	0,41
131.000	SGD	Singapore Government Bond, 2.63%, 01/08/2032	87	0,09
117.000	SGD	Singapore Government Bond, 2.25%, 01/08/2036	72	0,08
130.000	SGD	Singapore Government Bond, 2.38%, 01/07/2039	81	0,08
4.000	SGD	Singapore Government Bond, 2.75%, 01/04/2042	3	-
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	25	0,03
		<b>Singapore - Totale</b>	<b>1.457</b>	<b>1,53</b>
		<b>Slovacchia (31 marzo 2022: 0,21%)</b>		
223.000	EUR	Slovakia Government Bond, 0.75%, 09/04/2030	188	0,20
		<b>Slovacchia - Totale</b>	<b>188</b>	<b>0,20</b>
		<b>Slovenia (31 marzo 2022: 0,14%)</b>		
147.000	EUR	Slovenia Government Bond, 1.19%, 14/03/2029	132	0,14
		<b>Slovenia - Totale</b>	<b>132</b>	<b>0,14</b>
		<b>Corea del Sud (31 marzo 2022: 8,16%)</b>		
543.860.000	KRW	Korea Government Bond, 1.88%, 10/03/2024	378	0,40
545.270.000	KRW	Korea Government Bond, 2.13%, 10/03/2024	380	0,40
642.600.000	KRW	Korea Government Bond, 3.00%, 10/09/2024	450	0,47
639.760.000	KRW	Korea Government Bond, 1.50%, 10/03/2025	428	0,45
720.000.000	KRW	Korea Government Bond, 2.25%, 10/06/2025	488	0,51
408.180.000	KRW	Korea Government Bond, 2.25%, 10/12/2025	274	0,29
949.690.000	KRW	Korea Government Bond, 2.13%, 10/06/2027	617	0,65
120.000.000	KRW	Korea Government Bond, 5.50%, 10/03/2028	91	0,10
1.166.090.000	KRW	Korea Government Bond, 2.38%, 10/12/2028	751	0,79
127.520.000	KRW	Korea Government Bond, 1.38%, 10/12/2029	76	0,08
255.860.000	KRW	Korea Government Bond, 2.00%, 10/06/2031	155	0,16
632.060.000	KRW	Korea Government Bond, 4.00%, 10/12/2031	450	0,47
154.570.000	KRW	Korea Government Bond, 3.75%, 10/12/2033	107	0,11
589.340.000	KRW	Korea Government Bond, 2.63%, 10/09/2035	361	0,38
64.530.000	KRW	Korea Government Bond, 1.50%, 10/09/2036	34	0,04
67.780.000	KRW	Korea Government Bond, 2.38%, 10/09/2038	39	0,04
200.440.000	KRW	Korea Government Bond, 1.13%, 10/09/2039	92	0,10
626.530.000	KRW	Korea Government Bond, 3.00%, 10/12/2042	392	0,41
43.510.000	KRW	Korea Government Bond, 2.00%, 10/03/2046	22	0,02
200.000.000	KRW	Korea Government Bond, 2.13%, 10/03/2047	102	0,11
570.000.000	KRW	Korea Government Bond, 2.63%, 10/03/2048	320	0,34
910.330.000	KRW	Korea Government Bond, 2.00%, 10/03/2049	443	0,47
451.810.000	KRW	Korea Government Bond, 1.50%, 10/03/2050	191	0,20
455.580.000	KRW	Korea Government Bond, 1.88%, 10/03/2051	211	0,22
268.840.000	KRW	Korea Government Bond, 2.00%, 10/09/2068	118	0,12
258.400.000	KRW	Korea Government Bond, 1.63%, 10/09/2070	97	0,10
		<b>Corea del Sud - Totale</b>	<b>7.067</b>	<b>7,43</b>
		<b>Spagna (31 marzo 2022: 0,76%)</b>		
71.000	EUR	Spain Government Bond, 0.00%, 31/05/2024	69	0,07
289.000	EUR	Spain Government Bond, 0.80%, 30/07/2027	265	0,28
110.000	EUR	Spain Government Bond, 5.15%, 31/10/2028	124	0,13

# BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
<b>Spagna (continua)</b>				
204.000	EUR	Spain Government Bond, 1.45%, 30/04/2029	187	0,20
15.000	EUR	Spain Government Bond, 0.10%, 30/04/2031	12	0,01
216.000	EUR	Spain Government Bond, 1.85%, 30/07/2035	181	0,19
		<b>Spagna - Totale</b>	<b>838</b>	<b>0,88</b>
<b>Svezia (31 marzo 2022: 0,88%)</b>				
165.000	SEK	Sweden Government Bond, 1.50%, 13/11/2023	15	0,02
2.560.000	SEK	Sweden Government Bond, 2.50%, 12/05/2025	236	0,25
2.920.000	SEK	Sweden Government Bond, 1.00%, 12/11/2026	254	0,27
940.000	SEK	Sweden Government Bond, 0.75%, 12/05/2028	79	0,08
650.000	SEK	Sweden Government Bond, 0.75%, 12/11/2029	54	0,06
1.375.000	SEK	Sweden Government Bond, 3.50%, 30/03/2039	151	0,16
160.000	SEK	Sweden Government Bond, 0.50%, 24/11/2045	11	0,01
250.000	SEK	Sweden Government Bond, 1.38%, 23/06/2071	15	0,01
		<b>Svezia - Totale</b>	<b>815</b>	<b>0,86</b>
<b>Svizzera (31 marzo 2022: 1,10%)</b>				
185.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.25%, 11/06/2024	193	0,20
58.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 4.00%, 08/04/2028	70	0,07
220.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.00%, 22/06/2029	213	0,22
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
178.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 2.50%, 08/03/2036	215	0,23
155.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.50%, 30/04/2042	172	0,18
30.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.50%, 28/06/2045	28	0,03
38.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.50%, 24/05/2055	35	0,04
78.000	CHF	Swiss Confederation Government Bond, 2.00%, 25/06/2064	113	0,12
		<b>Svizzera - Totale</b>	<b>1.116</b>	<b>1,17</b>
<b>Tailandia (31 marzo 2022: 1,50%)</b>				
4.695.000	THB	Thailand Government Bond, 3.63%, 16/06/2023	129	0,14
13.236.000	THB	Thailand Government Bond, 1.45%, 17/12/2024	354	0,37
12.808.000	THB	Thailand Government Bond, 1.60%, 17/12/2029	314	0,33
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	17	0,02
5.230.000	THB	Thailand Government Bond, 4.68%, 29/06/2044	157	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	109	0,11
1.870.000	THB	Thailand Government Bond, 4.00%, 17/06/2066	44	0,05
		<b>Tailandia - Totale</b>	<b>1.388</b>	<b>1,46</b>
<b>Regno Unito (31 marzo 2022: 6,51%)</b>				
545.000	GBP	UK Treasury, 0.75%, 22/07/2023 <sup>1</sup>	606	0,64
238.000	GBP	UK Treasury, 2.25%, 07/09/2023 <sup>1</sup>	267	0,28
560.000	GBP	UK Treasury, 2.75%, 07/09/2024 <sup>1</sup>	620	0,65
260.000	GBP	UK Treasury, 5.00%, 07/03/2025 <sup>1</sup>	300	0,31
126.000	GBP	UK Treasury, 0.38%, 22/10/2026 <sup>1</sup>	122	0,13
16.000	GBP	UK Treasury, 0.13%, 31/01/2028 <sup>1</sup>	15	0,01
215.000	GBP	UK Treasury, 1.63%, 22/10/2028 <sup>1</sup>	211	0,22
117.000	GBP	UK Treasury, 6.00%, 07/12/2028	145	0,15
130.000	GBP	UK Treasury, 0.50%, 31/01/2029 <sup>1</sup>	117	0,12
259.000	GBP	UK Treasury, 0.38%, 22/10/2030	220	0,23
315.000	GBP	UK Treasury, 4.25%, 07/06/2032 <sup>1</sup>	364	0,38
613.000	GBP	UK Treasury, 0.63%, 31/07/2035	454	0,48
191.000	GBP	UK Treasury, 1.75%, 07/09/2037	160	0,17
178.000	GBP	UK Treasury, 1.13%, 31/01/2039	130	0,14
101.000	GBP	UK Treasury, 1.25%, 22/10/2041	72	0,08
415.000	GBP	UK Treasury, 4.50%, 07/12/2042	504	0,53
73.000	GBP	UK Treasury, 0.88%, 31/01/2046	44	0,05

# BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
<b>Regno Unito (continua)</b>				
61.000	GBP	UK Treasury, 4.25%, 07/12/2046	73	0,08
163.000	GBP	UK Treasury, 1.50%, 22/07/2047	117	0,12
64.000	GBP	UK Treasury, 1.75%, 22/01/2049	47	0,05
120.000	GBP	UK Treasury, 4.25%, 07/12/2049	144	0,15
180.000	GBP	UK Treasury, 0.63%, 22/10/2050 <sup>1</sup>	93	0,10
89.000	GBP	UK Treasury, 1.25%, 31/07/2051	56	0,06
30.000	GBP	UK Treasury, 3.75%, 22/07/2052	34	0,04
70.000	GBP	UK Treasury, 1.50%, 31/07/2053	47	0,05
103.000	GBP	UK Treasury, 1.63%, 22/10/2054	71	0,07
233.000	GBP	UK Treasury, 4.25%, 07/12/2055	295	0,31
112.000	GBP	UK Treasury, 1.75%, 22/07/2057	83	0,09
28.000	GBP	UK Treasury, 4.00%, 22/01/2060	34	0,04
113.000	GBP	UK Treasury, 0.50%, 22/10/2061	51	0,05
71.000	GBP	UK Treasury, 2.50%, 22/07/2065	66	0,07
107.000	GBP	UK Treasury, 3.50%, 22/07/2068	127	0,13
32.000	GBP	UK Treasury, 1.63%, 22/10/2071	23	0,02
20.000	GBP	UK Treasury, 1.13%, 22/10/2073	11	0,01
<b>Regno Unito - Totale</b>			<b>5.723</b>	<b>6,01</b>
<b>Stati Uniti (31 marzo 2022: 13,47%)</b>				
430.000	USD	US Treasury, 0.25%, 30/09/2023	422	0,44
385.000	USD	US Treasury, 0.75%, 31/12/2023	376	0,40
605.000	USD	US Treasury, 2.25%, 31/12/2023	603	0,63
430.000	USD	US Treasury, 0.88%, 31/01/2024	419	0,44
420.000	USD	US Treasury, 3.00%, 30/06/2024	420	0,44
98.000	USD	US Treasury, 3.00%, 31/07/2024	98	0,10
1.292.000	USD	US Treasury, 2.25%, 15/11/2024	1.265	1,33
40.000	USD	US Treasury, 2.88%, 15/06/2025	39	0,04
420.000	USD	US Treasury, 3.00%, 15/07/2025	415	0,44
613.000	USD	US Treasury, 2.25%, 15/11/2025	589	0,62
300.000	USD	US Treasury, 1.63%, 15/02/2026	281	0,30
119.000	USD	US Treasury, 0.88%, 30/09/2026	107	0,11
299.000	USD	US Treasury, 1.63%, 30/09/2026	277	0,29
789.000	USD	US Treasury, 1.25%, 30/11/2026	717	0,75
330.000	USD	US Treasury, 2.25%, 15/02/2027	312	0,33
234.000	USD	US Treasury, 1.13%, 28/02/2027	210	0,22
420.000	USD	US Treasury, 2.50%, 31/03/2027	401	0,42
50.000	USD	US Treasury, 2.38%, 15/05/2027	47	0,05
433.000	USD	US Treasury, 1.25%, 31/03/2028	381	0,40
260.000	USD	US Treasury, 1.38%, 31/12/2028	227	0,24
282.000	USD	US Treasury, 2.63%, 15/02/2029	265	0,28
440.000	USD	US Treasury, 1.88%, 28/02/2029	395	0,42
138.000	USD	US Treasury, 2.38%, 15/05/2029	128	0,13
126.000	USD	US Treasury, 3.25%, 30/06/2029	123	0,13
303.000	USD	US Treasury, 0.63%, 15/08/2030	242	0,25
868.000	USD	US Treasury, 0.88%, 15/11/2030	706	0,74
47.000	USD	US Treasury, 5.38%, 15/02/2031	53	0,06
460.000	USD	US Treasury, 1.38%, 15/11/2031	382	0,40
440.000	USD	US Treasury, 1.88%, 15/02/2032	381	0,40
100.000	USD	US Treasury, 2.88%, 15/05/2032	94	0,10
40.000	USD	US Treasury, 5.00%, 15/05/2037	46	0,05
214.000	USD	US Treasury, 4.25%, 15/11/2040	226	0,24
637.500	USD	US Treasury, 1.88%, 15/02/2041	461	0,49
43.000	USD	US Treasury, 4.75%, 15/02/2041	48	0,05
12.000	USD	US Treasury, 4.38%, 15/05/2041	13	0,01
258.000	USD	US Treasury, 3.13%, 15/11/2041	229	0,24
60.000	USD	US Treasury, 2.88%, 15/05/2043	51	0,05
439.000	USD	US Treasury, 3.00%, 15/05/2045	375	0,39
137.000	USD	US Treasury, 2.75%, 15/11/2047	112	0,12
70.000	USD	US Treasury, 3.13%, 15/05/2048	62	0,07



# BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>OBBLIGAZIONI (continua)</b>				
<b>Titoli di Stato (continua)</b>				
		<b>Stati Uniti (continua)</b>		
247.000	USD	US Treasury, 1.25%, 15/05/2050	141	0,15
278.000	USD	US Treasury, 1.38%, 15/08/2050	165	0,17
71.000	USD	US Treasury, 1.88%, 15/02/2051	48	0,05
275.000	USD	US Treasury, 2.00%, 15/08/2051	192	0,20
		<b>Stati Uniti - Totale</b>	<b>12.544</b>	<b>13,18</b>
<b>Totale investimenti in titoli di Stato</b>			<b>92.480</b>	<b>97,19</b>
<b>Totale investimenti in obbligazioni</b>			<b>92.480</b>	<b>97,19</b>

Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti di cambio a termine<sup>2</sup></b>				
Buy EUR 90,000; Sell USD 86,769	J.P. Morgan	04/10/2022	1	–
Buy USD 3,582,129; Sell AUD 5,216,782	State Street	04/10/2022	233	0,24
Buy USD 3,575,216; Sell AUD 5,215,000	BNP Paribas	04/10/2022	227	0,24
Buy USD 527,032; Sell AUD 773,000	Morgan Stanley	04/10/2022	31	0,03
Buy USD 2,810,330; Sell CAD 3,685,000	BNP Paribas	04/10/2022	131	0,14
Buy USD 2,811,985; Sell CAD 3,689,000	Citibank	04/10/2022	130	0,14
Buy USD 1,230,038; Sell CHF 1,201,000	State Street	04/10/2022	10	0,01
Buy USD 34,840; Sell CLP 32,462,000	Morgan Stanley	21/12/2022	1	–
Buy USD 10,175,288; Sell CNY 70,123,000	HSBC	11/10/2022	345	0,36
Buy USD 130,631; Sell CNY 900,000	J.P. Morgan	11/10/2022	5	–
Buy USD 671,235; Sell CZK 16,557,000	Morgan Stanley	04/10/2022	11	0,01
Buy USD 1,269,900; Sell DKK 9,447,000	Bank of America	04/10/2022	26	0,03
Buy USD 1,702,979; Sell EUR 1,690,000	J.P. Morgan	04/10/2022	48	0,05
Buy USD 809,653; Sell EUR 820,000	BNP Paribas	04/10/2022	6	0,01
Buy USD 292,561; Sell EUR 293,000	Toronto-Dominion Bank	04/10/2022	6	0,01
Buy USD 3,389,883; Sell GBP 2,912,000	BNY Mellon	04/10/2022	142	0,15
Buy USD 3,389,906; Sell GBP 2,915,000	BNP Paribas	04/10/2022	139	0,15
Buy USD 417,066; Sell GBP 362,000	Standard Chartered	04/10/2022	13	0,01
Buy USD 96,146; Sell HKD 754,000 <sup>3</sup>	RBC	05/10/2022	–	–
Buy USD 22,990; Sell HUF 9,366,000	UBS	04/10/2022	1	–
Buy USD 2,532,535; Sell IDR 37,881,652,000	Morgan Stanley	21/12/2022	64	0,07
Buy USD 1,368,360; Sell ILS 4,560,000	Morgan Stanley	06/10/2022	88	0,09
Buy USD 2,519,671; Sell JPY 348,510,000	State Street	04/10/2022	114	0,12
Buy USD 2,518,076; Sell JPY 348,507,000	Bank of America	04/10/2022	113	0,12
Buy USD 45,795; Sell JPY 6,620,000 <sup>3</sup>	Citibank	04/10/2022	–	–
Buy USD 7,459,928; Sell KRW 10,378,177,812	Morgan Stanley	21/12/2022	219	0,23
Buy USD 1,865,545; Sell MYR 8,447,000	Barclays	21/12/2022	38	0,04
Buy USD 707,576; Sell NOK 7,021,000	NatWest Markets	04/10/2022	65	0,07
Buy USD 741,568; Sell NZD 1,209,000	UBS	04/10/2022	59	0,06
Buy USD 332,725; Sell NZD 544,000	Morgan Stanley	04/10/2022	26	0,03
Buy USD 9,474; Sell PEN 37,000 <sup>3</sup>	Morgan Stanley	21/12/2022	–	–
Buy USD 35,313; Sell PLN 168,000	Toronto-Dominion Bank	04/10/2022	1	–
Buy USD 34,966; Sell RON 171,000	UBS	04/10/2022	1	–
Buy USD 903,056; Sell SEK 9,651,000	UBS	04/10/2022	34	0,04
Buy USD 1,570,771; Sell SGD 2,197,000	HSBC	04/10/2022	40	0,04
Buy USD 1,534,818; Sell THB 55,920,000	Barclays	04/10/2022	53	0,06
<b>Totale utili non realizzati su contratti di cambio a termine (31 marzo 2022: 0,55%)</b>			<b>2.421</b>	<b>2,55</b>



# BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti di cambio a termine<sup>2</sup></b>				
Buy AUD 70,000; Sell USD 45,353 <sup>3</sup>	Bank of America	04/10/2022	–	–
Buy AUD 240,000; Sell USD 164,618	J.P. Morgan	04/10/2022	(10)	(0,01)
Buy CAD 160,000; Sell USD 122,145	J.P. Morgan	04/10/2022	(6)	(0,01)
Buy CAD 180,000; Sell USD 137,411	Deutsche Bank	04/10/2022	(7)	(0,01)
Buy CHF 48,000; Sell USD 49,052 <sup>3</sup>	UBS	04/10/2022	–	–
Buy CHF 30,000; Sell USD 30,818 <sup>3</sup>	J.P. Morgan	04/10/2022	–	–
Buy CNY 750,000; Sell USD 105,619 <sup>3</sup>	HSBC	11/10/2022	–	–
Buy CNY 2,500,000; Sell USD 361,000	J.P. Morgan	11/10/2022	(10)	(0,01)
Buy DKK 490,000; Sell USD 66,388	J.P. Morgan	04/10/2022	(2)	–
Buy EUR 100,000; Sell USD 100,766	Deutsche Bank	04/10/2022	(3)	–
Buy EUR 3,615,000; Sell USD 3,622,592	Bank of America	04/10/2022	(83)	(0,09)
Buy EUR 12,288,658; Sell USD 12,304,818	HSBC	04/10/2022	(272)	(0,29)
Buy EUR 20,295,000; Sell USD 20,352,044	BNY Mellon	04/10/2022	(480)	(0,50)
Buy EUR 36,135,000; Sell USD 36,216,260	Citibank	04/10/2022	(834)	(0,88)
Buy GBP 600,000; Sell USD 698,595	J.P. Morgan	04/10/2022	(29)	(0,03)
Buy ILS 90,000; Sell USD 27,102	J.P. Morgan	06/10/2022	(2)	–
Buy ILS 395,000; Sell USD 116,624	Citibank	06/10/2022	(6)	(0,01)
Buy KRW 153,250,000; Sell USD 107,926	Citibank	21/12/2022	(1)	–
Buy NZD 60,000; Sell USD 36,784	J.P. Morgan	04/10/2022	(3)	–
Buy SEK 340,000; Sell USD 32,026	J.P. Morgan	04/10/2022	(1)	–
Buy SGD 40,000; Sell USD 28,676	J.P. Morgan	04/10/2022	(1)	–
Buy THB 1,788,000; Sell USD 48,804	Morgan Stanley	04/10/2022	(1)	–
Buy USD 378,668; Sell GBP 350,000	Bank of America	04/10/2022	(13)	(0,02)
Buy USD 30,288; Sell MXN 616,000 <sup>3</sup>	UBS	04/10/2022	–	–
Buy USD 54,060; Sell MXN 1,100,000	RBC	04/10/2022	(1)	–

**Totale perdite non realizzate su contratti di cambio a termine (31 marzo 2022: (1,34)%)**

	(1.765)	(1,86)
	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico	94.901	99,74
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico	(1.765)	(1,86)
Liquidità e garanzia liquida	1.430	1,50
Altre attività e passività	587	0,62
<b>Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>	<b>95.153</b>	<b>100,00</b>

### Analisi del totale attività

	% del totale attività
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	92,05
Valori mobiliari negoziati su un altro mercato regolamentato	3,24
Strumenti finanziari derivati OTC	2,50
Altre attività	2,21
<b>Totale attività</b>	<b>100,00</b>

<sup>1</sup>Titolo parzialmente o completamente in prestito.

<sup>2</sup>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.

<sup>3</sup>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	119.718	79.433

# BLACKROCK DIVERSIFYING FIXED INCOME FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO</b>				
<b>Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2022: 58,06%)</b>				
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 58,06%)</b>				
136.162	EUR	BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe Z EUR Hedged Accumulating <sup>1</sup>	12.741	17,79
4.951	EUR	BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund - Azioni Agency <sup>1</sup>	542	0,76
803.116	EUR	iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni Flexible Euro Hedged Accumulating <sup>1</sup>	6.668	9,31
1.361.633	EUR	iShares ESG Screened Euro Corporate Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni Flexible Euro Accumulating <sup>1</sup>	12.108	16,90
1.255.264	EUR	iShares ESG Screened Global Corporate Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni D EUR Hedged Accumulating <sup>1</sup>	10.534	14,71
<b>Irlanda - Totale</b>			<b>42.593</b>	<b>59,47</b>
<b>Totale investimenti in organismi di investimento collettivo</b>			<b>42.593</b>	<b>59,47</b>
<b>Totale investimenti in organismi di investimento collettivo</b>			<b>42.593</b>	<b>59,47</b>

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>ETF (31 marzo 2022: 36,10%)</b>				
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 36,10%)</b>				
167.372	EUR	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) <sup>1</sup>	842	1,18
130.033	EUR	iShares € High Yield Corp Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) <sup>1/2</sup>	11.140	15,56
8.553	EUR	iShares € Inflation Linked Govt Bond UCITS ETF - EUR (Acc) Share Class <sup>1</sup>	1.822	2,54
138.507	EUR	iShares J.P. Morgan \$ EM Corp Bond UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) <sup>1</sup>	11.766	16,43
<b>Irlanda - Totale</b>			<b>25.570</b>	<b>35,71</b>
<b>Totale investimenti in ETF</b>			<b>25.570</b>	<b>35,71</b>

Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti di cambio a termine<sup>3</sup></b>				
Buy EUR 3,160,166; Sell USD 3,075,000	Toronto-Dominion Bank	12/01/2023	47	0,06
Buy EUR 3,157,036; Sell USD 3,075,000	Morgan Stanley	12/01/2023	44	0,06
Buy EUR 3,156,213; Sell USD 3,075,000	NatWest Markets	12/01/2023	43	0,06
Buy EUR 3,154,836; Sell USD 3,075,000	BNP Paribas	12/01/2023	42	0,06
Buy EUR 3,159,635; Sell USD 3,080,944	HSBC	12/01/2023	41	0,06
<b>Totale utili non realizzati su contratti di cambio a termine (31 marzo 2022: 0,29%)</b>			<b>217</b>	<b>0,30</b>

<b>Contratti di cambio a termine<sup>3</sup></b>				
Buy EUR 2,902,449; Sell USD 3,075,000	Morgan Stanley	05/10/2022	(236)	(0,33)
Buy EUR 2,900,930; Sell USD 3,075,000	Societe Generale	05/10/2022	(238)	(0,33)
Buy EUR 2,906,305; Sell USD 3,080,944	Barclays	05/10/2022	(238)	(0,33)
Buy EUR 2,899,598; Sell USD 3,075,000	Toronto-Dominion Bank	05/10/2022	(239)	(0,33)
Buy EUR 2,899,111; Sell USD 3,075,000	BNP Paribas	05/10/2022	(240)	(0,34)
Buy USD 3,080,944; Sell EUR 3,186,085	HSBC	05/10/2022	(41)	(0,06)
Buy USD 3,075,000; Sell EUR 3,181,109	BNP Paribas	05/10/2022	(42)	(0,06)
Buy USD 3,075,000; Sell EUR 3,182,755	NatWest Markets	05/10/2022	(44)	(0,06)
Buy USD 3,075,000; Sell EUR 3,183,428	Morgan Stanley	05/10/2022	(45)	(0,06)
Buy USD 3,075,000; Sell EUR 3,186,529	Toronto-Dominion Bank	05/10/2022	(48)	(0,07)

NM1222U-2615757-150/212

# BLACKROCK DIVERSIFYING FIXED INCOME FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti di cambio a termine<sup>3</sup>(continua)</b>				
Buy USD 3,423,138; Sell EUR 3,523,959	Morgan Stanley	12/01/2023	(59)	(0,08)
<b>Totale perdite non realizzate su contratti di cambio a termine (31 marzo 2022: (0,66)%)</b>			<b>(1.470)</b>	<b>(2,05)</b>

Numero di contratti	Valuta	Importo	Descrizione	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti future</b>						
<b>Stati Uniti (31 marzo 2022: 0,11%)</b>						
					-	-
<b>Totale utili non realizzati su contratti future (31 marzo 2022: 0,11%)</b>						
					-	-
<b>Giappone (31 marzo 2022: (0,01)%)</b>						
					-	-
<b>Totale perdite non realizzate su contratti future (31 marzo 2022: (0,01)%)</b>						
					-	-

	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico	68.380	95,48
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico	(1.470)	(2,05)
Liquidità	15	0,02
Strumenti liquidi equivalenti		
Partecipazione Valuta	Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2022: 5,87%) BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0) <sup>1</sup>	
44.957 EUR	4.412	6,16
Totale in strumenti liquidi equivalenti	4.412	6,16
Altre attività e passività	281	0,39
<b>Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>	<b>71.618</b>	<b>100,00</b>

	% del totale attività
<b>Analisi del totale attività</b>	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	32,00
Organismi di investimento collettivo	58,82
Strumenti finanziari derivati OTC	0,27
Altre attività	8,91
<b>Totale attività</b>	<b>100,00</b>

<sup>1</sup>Una parte correlata al Fondo.

<sup>2</sup>Titolo parzialmente o completamente in prestito.

<sup>3</sup>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.

Valore dell'esposizione	Sui guadagni Migliaia di EUR	Sulle perdite Migliaia di EUR
Contratti di cambio a termine	15.701	34.895

# BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Azioni (31 marzo 2022: 84,53%)</b>				
<b>Bermuda (31 marzo 2022: 0,91%)</b>				
16.503	USD	Genpact Ltd.	723	0,24
634.000	HKD	Kunlun Energy Co. Ltd.	460	0,15
		<b>Bermuda - Totale</b>	<b>1.183</b>	<b>0,39</b>
<b>Brasile (31 marzo 2022: 0,95%)</b>				
782.775	USD	Ambev SA ADR	2.219	0,74
		<b>Brasile - Totale</b>	<b>2.219</b>	<b>0,74</b>
<b>Isole Cayman (31 marzo 2022: 14,69%)</b>				
1.662.000	HKD	3SBio, Inc.	1.180	0,39
817.156	HKD	Alibaba Group Holding Ltd.	8.112	2,70
38.200	HKD	ANTA Sports Products Ltd.	405	0,14
4.846	USD	Autohome, Inc. ADR	139	0,05
169.002	HKD	Baidu, Inc. 'A'	2.459	0,82
1.385	USD	BeiGene Ltd. ADR	187	0,06
106.200	TWD	Chailease Holding Co. Ltd.	611	0,20
381.000	HKD	China Hongqiao Group Ltd. <sup>1</sup>	315	0,11
70.000	HKD	China Meidong Auto Holdings Ltd.	111	0,04
1.182.500	HKD	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd.	633	0,21
56.400	HKD	ENN Energy Holdings Ltd.	755	0,25
554.000	HKD	Geely Automobile Holdings Ltd.	763	0,25
4.003	USD	H World Group Ltd. ADR	134	0,05
108.235	HKD	JD.com, Inc. 'A'	2.738	0,91
35.772	USD	KE Holdings, Inc., REIT ADR	626	0,21
23.600	HKD	Kuaishou Technology	153	0,05
18.773	USD	Li Auto, Inc. ADR	432	0,14
56.299	USD	Lufax Holding Ltd. ADR	142	0,05
127.600	HKD	Meituan 'B'	2.693	0,90
121.555	HKD	NetEase, Inc.	1.836	0,61
48.700	HKD	New Oriental Education & Technology Group, Inc.	123	0,04
50.231	USD	NIO, Inc. ADR 'A'	792	0,26
27.395	USD	Pinduoduo, Inc. ADR	1.714	0,57
18.484	USD	StoneCo Ltd. 'A'	176	0,06
857.000	HKD	Sunac China Holdings Ltd. <sup>2</sup>	218	0,07
21.463	USD	TAL Education Group ADR	106	0,04
384.200	HKD	Tencent Holdings Ltd.	13.053	4,35
56.535	USD	Tencent Music Entertainment Group ADR	230	0,08
4.500	HKD	Trip.com Group Ltd. <sup>1</sup>	121	0,04
31.076	USD	Trip.com Group Ltd. ADR	849	0,28
41.376	USD	Vipshop Holdings Ltd. ADR	349	0,12
62.000	TWD	Wisdom Marine Lines Co. Ltd.	101	0,03
64.500	HKD	Wuxi Biologics Cayman, Inc.	390	0,13
90.000	HKD	Yadea Group Holdings Ltd.	144	0,05
22.500	HKD	Zhongsheng Group Holdings Ltd.	90	0,03
7.972	USD	ZTO Express Cayman, Inc. ADR	192	0,06
		<b>Isole Cayman - Totale</b>	<b>43.072</b>	<b>14,35</b>
<b>Cile (31 marzo 2022: 0,11%)</b>				
4.494.190	CLP	Banco Santander Chile	159	0,05
		<b>Cile - Totale</b>	<b>159</b>	<b>0,05</b>
<b>Cina (31 marzo 2022: 14,46%)</b>				
2.430.000	HKD	Angang Steel Co. Ltd. 'H'	607	0,20
9.300	CNY	Anhui Gujing Distillery Co. Ltd. 'A'	355	0,12
136.100	CNY	Avary Holding Shenzhen Co. Ltd. 'A'	495	0,16
2.385.000	HKD	BAIC Motor Corp. Ltd. 'H'	524	0,17
2.049.000	HKD	Bank of China Ltd. 'H'	672	0,22
305.000	HKD	Bank of Communications Co. Ltd. 'H'	161	0,05

# BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Azioni (continua)</b>				
<b>Cina (continua)</b>				
50.500	CNY	Beijing Easpring Material Technology Co. Ltd. 'A'	468	0,16
26.100	CNY	BYD Co. Ltd. 'A'	923	0,31
100.000	HKD	BYD Co. Ltd. 'H'	2.477	0,83
100	CNY	China Construction Bank Corp. 'A' <sup>3</sup>	–	–
4.244.000	HKD	China Construction Bank Corp. 'H'	2.452	0,82
395.000	HKD	China Life Insurance Co. Ltd. 'H'	506	0,17
673.000	HKD	China Merchants Bank Co. Ltd. 'H'	3.127	1,04
319.000	HKD	China Minsheng Banking Corp. Ltd. 'H'	91	0,03
305.400	HKD	China Pacific Insurance Group Co. Ltd. 'H'	563	0,19
5.452.000	HKD	China Petroleum & Chemical Corp. 'H'	2.337	0,78
6.391	USD	China Petroleum & Chemical Corp. ADR	268	0,09
44.500	CNY	Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. 'A'	2.502	0,83
43.500	HKD	CSC Financial Co. Ltd. 'H'	33	0,01
1.322.000	HKD	Datang International Power Generation Co. Ltd. 'H'	253	0,08
318.000	HKD	Dongfeng Motor Group Co. Ltd. 'H'	171	0,06
182.900	CNY	Eve Energy Co. Ltd. 'A'	2.171	0,72
888.000	HKD	Great Wall Motor Co. Ltd. 'H'	1.020	0,34
412.700	CNY	Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai 'A'	1.878	0,63
358.000	HKD	Guangzhou Automobile Group Co. Ltd. 'H'	256	0,09
20.300	CNY	Hithink RoyalFlush Information Network Co. Ltd. 'A'	221	0,07
3.461.000	HKD	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 'H'	1.620	0,54
205.500	CNY	LONGi Green Energy Technology Co. Ltd. 'A'	1.381	0,46
311.600	CNY	Luxshare Precision Industry Co. Ltd. 'A'	1.285	0,43
29.600	HKD	Nongfu Spring Co. Ltd. 'H'	172	0,06
1.177.000	HKD	People's Insurance Co. Group of China Ltd. (The) 'H'	341	0,11
385.700	CNY	PetroChina Co. Ltd. 'A'	277	0,09
5.150.000	HKD	PetroChina Co. Ltd. 'H'	2.109	0,70
8.601	USD	PetroChina Co. Ltd. ADR	351	0,12
774.000	HKD	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H' <sup>1</sup>	3.868	1,29
1.395.000	HKD	Postal Savings Bank of China Co. Ltd. 'H' <sup>1</sup>	822	0,27
339.100	CNY	Qinghai Salt Lake Industry Co. Ltd. 'A'	1.136	0,38
238.900	CNY	SF Holding Co. Ltd. 'A'	1.582	0,53
36.500	HKD	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co. Ltd. 'H'	88	0,03
405.100	HKD	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd. 'H'	559	0,19
95.700	CNY	Shanghai Putailai New Energy Technology Co. Ltd. 'A'	749	0,25
88.100	CNY	Shenzhen Inovance Technology Co. Ltd. 'A'	711	0,24
42.800	HKD	Sinopharm Group Co. Ltd. 'H' <sup>1</sup>	86	0,03
131.800	CNY	Sunwoda Electronic Co. Ltd. 'A'	430	0,14
359.500	CNY	TBEA Co. Ltd. 'A'	1.093	0,36
38.124	HKD	WuXi AppTec Co. Ltd. 'H'	308	0,10
280.900	CNY	YTO Express Group Co. Ltd. 'A'	818	0,27
826.000	HKD	Zijin Mining Group Co. Ltd. 'H' <sup>1</sup>	804	0,27
620.600	HKD	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co. Ltd. 'H'	215	0,07
351.500	CNY	ZTE Corp. 'A'	1.055	0,35
233.200	HKD	ZTE Corp. 'H' <sup>1</sup>	418	0,14
		<b>Cina - Totale</b>	<b>46.809</b>	<b>15,59</b>
		<b>Colombia (31 marzo 2022: 0,18%)</b>	–	–
		<b>Repubblica ceca (31 marzo 2022: 0,05%)</b>	–	–
		<b>Grecia (31 marzo 2022: 0,63%)</b>		
49.670	EUR	Hellenic Telecommunications Organization SA	723	0,24
37.480	EUR	OPAP SA	449	0,15
		<b>Grecia - Totale</b>	<b>1.172</b>	<b>0,39</b>
		<b>Hong Kong (31 marzo 2022: 1,24%)</b>		
50.500	HKD	Beijing Enterprises Holdings Ltd.	142	0,05
18.000	HKD	China Resources Beer Holdings Co. Ltd.	125	0,04

# BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Azioni (continua)</b>				
<b>Hong Kong (continua)</b>				
2.724.000	HKD	China Resources Pharmaceutical Group Ltd.	1.872	0,62
197.000	HKD	CITIC Ltd.	186	0,06
751.920	HKD	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	745	0,25
206.000	HKD	Lenovo Group Ltd.	143	0,05
1.788.000	HKD	Shougang Fushan Resources Group Ltd.	523	0,18
413.500	HKD	Sun Art Retail Group Ltd.	89	0,03
		<b>Hong Kong - Totale</b>	<b>3.825</b>	<b>1,28</b>
		<b>Ungheria (31 marzo 2022: 0,62%)</b>	-	-
		<b>India (31 marzo 2022: 1,49%)</b>		
38.628	USD	HDFC Bank Ltd. ADR	2.259	0,75
		<b>India - Totale</b>	<b>2.259</b>	<b>0,75</b>
		<b>Indonesia (31 marzo 2022: 1,41%)</b>		
2.619.300	IDR	Astra International Tbk. PT	1.142	0,38
6.848.900	IDR	Bank Central Asia Tbk. PT	3.851	1,28
1.258.300	IDR	Bank Mandiri Persero Tbk. PT	778	0,26
10.982.000	IDR	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk. PT	3.242	1,08
17.514.500	IDR	Perusahaan Gas Negara Tbk. PT	2.016	0,67
2.532.600	IDR	Telkom Indonesia Persero Tbk. PT	742	0,25
		<b>Indonesia - Totale</b>	<b>11.771</b>	<b>3,92</b>
		<b>Isola di Man (31 marzo 2022: 0,07%)</b>	-	-
		<b>Kuwait (31 marzo 2022: 0,00%)</b>		
62.084	KWD	Kuwait Finance House KSCP	168	0,06
308.524	KWD	National Bank of Kuwait SAKP	972	0,32
		<b>Kuwait - Totale</b>	<b>1.140</b>	<b>0,38</b>
		<b>Malesia (31 marzo 2022: 1,16%)</b>		
581.500	MYR	Axiata Group Bhd.	331	0,11
207.900	MYR	Genting Bhd.	201	0,07
524.800	MYR	Genting Malaysia Bhd.	315	0,10
103.200	MYR	IHH Healthcare Bhd.	131	0,04
231.800	MYR	Maxis Bhd.	176	0,06
41.300	MYR	Petronas Gas Bhd.	147	0,05
30.800	MYR	PPB Group Bhd.	107	0,04
198.400	MYR	Public Bank Bhd.	181	0,06
847.500	MYR	Tenaga Nasional Bhd.	1.474	0,49
		<b>Malesia - Totale</b>	<b>3.063</b>	<b>1,02</b>
		<b>Messico (31 marzo 2022: 2,53%)</b>		
477.942	MXN	Aalsea SAB de CV	860	0,29
163.021	MXN	America Movil SAB de CV 'C'	135	0,04
148.043	MXN	Coca-Cola Femsa SAB de CV	866	0,29
2.908	USD	Coca-Cola Femsa SAB de CV ADR	170	0,06
42.198	MXN	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	265	0,09
29.377	MXN	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV 'B'	373	0,12
261.960	MXN	Grupo Bimbo SAB de CV 'A'	922	0,31
154.075	MXN	Grupo Financiero Banorte SAB de CV 'O'	990	0,33
14.611	MXN	Sitios Latinoamerica SAB de CV	6	-
549.973	MXN	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	1.938	0,64
		<b>Messico - Totale</b>	<b>6.525</b>	<b>2,17</b>



# BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Azioni (continua)</b>				
<b>Filippine (31 marzo 2022: 0,34%)</b>				
15	PHP	ACEN Corp. <sup>3</sup>	-	-
5	PHP	Ayala Corp., REIT <sup>3</sup>	-	-
23.340	PHP	International Container Terminal Services, Inc.	62	0,02
35.420	PHP	SM Investments Corp.	440	0,15
		<b>Filippine - Totale</b>	<b>502</b>	<b>0,17</b>
<b>Polonia (31 marzo 2022: 0,09%)</b>				
			-	-
<b>Qatar (31 marzo 2022: 0,88%)</b>				
97.439	QAR	Industries Qatar QSC	447	0,15
384.169	QAR	Masraf Al Rayan QSC	431	0,15
41.143	QAR	Ooredoo QPSC	100	0,03
26.087	QAR	Qatar Electricity & Water Co. QSC	125	0,04
60.096	QAR	Qatar Islamic Bank SAQ	403	0,14
290.823	QAR	Qatar National Bank QPSC	1.571	0,52
		<b>Qatar - Totale</b>	<b>3.077</b>	<b>1,03</b>
<b>Russia (31 marzo 2022: 0,00%)<sup>4</sup></b>				
2.082.843	RUB	Alrosa PJSC <sup>2/3</sup>	-	-
59.018	RUB	Lukoil PJSC <sup>2/3</sup>	-	-
3.024	RUB	MMC Norilsk Nickel PJSC <sup>2/3</sup>	-	-
43.498	RUB	Mobile TeleSystems PJSC <sup>2/3</sup>	-	-
43.510	RUB	Novatek PJSC <sup>2/3</sup>	-	-
13.465	RUB	Severstal PAO <sup>2/3</sup>	-	-
121.387	RUB	Tatneft PJSC <sup>2/3</sup>	-	-
		<b>Russia - Totale</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Arabia Saudita (31 marzo 2022: 4,18%)</b>				
3.711	SAR	Abdullah Al Othaim Markets Co.	122	0,04
27.305	SAR	Al Hammadi Holding	327	0,11
136.674	SAR	Al Rajhi Bank	2.959	0,99
1	SAR	Aldrees Petroleum and Transport Services Co. <sup>3</sup>	-	-
137.941	SAR	Alinma Bank	1.330	0,44
12.353	SAR	Almarai Co. JSC	175	0,06
1	SAR	Arabian Centres Co. Ltd., REIT <sup>3</sup>	-	-
1	SAR	Bank Al-Jazira <sup>3</sup>	-	-
52.400	SAR	Saudi Arabian Mining Co.	971	0,32
210.977	SAR	Saudi Arabian Oil Co.	2.012	0,67
128.907	SAR	Saudi Basic Industries Corp.	3.042	1,01
57.164	SAR	Saudi National Bank (The)	959	0,32
		<b>Totale Arabia Saudita</b>	<b>11.897</b>	<b>3,96</b>
<b>Sudafrica (31 marzo 2022: 5,84%)</b>				
30.645	ZAR	Anglo American Platinum Ltd.	2.199	0,73
21.584	ZAR	AngloGold Ashanti Ltd.	300	0,10
26.019	ZAR	Aspen Pharmacare Holdings Ltd. <sup>1</sup>	194	0,07
206.174	ZAR	AVI Ltd.	835	0,28
15.609	ZAR	Capitec Bank Holdings Ltd.	1.352	0,45
728.630	ZAR	FirstRand Ltd.	2.463	0,82
54.161	ZAR	Foschini Group Ltd. (The)	354	0,12
43.600	ZAR	Gold Fields Ltd. <sup>1</sup>	358	0,12
76.148	USD	Gold Fields Ltd. ADR <sup>1</sup>	616	0,21
26.917	ZAR	Impala Platinum Holdings Ltd. <sup>1</sup>	254	0,08
764.231	ZAR	Life Healthcare Group Holdings Ltd.	733	0,24
150.544	ZAR	MTN Group Ltd.	1.003	0,33
776	ZAR	Naspers Ltd. 'N'	98	0,03
662.660	ZAR	Old Mutual Ltd.	361	0,12

# BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Azioni (continua)</b>				
<b>Sudafrica (continua)</b>				
1	ZAR	Pepkor Holdings Ltd. <sup>3</sup>	–	–
208.143	ZAR	Sanlam Ltd.	598	0,20
63.240	ZAR	Sasol Ltd. <sup>1</sup>	1.006	0,34
17.888	ZAR	Shoprite Holdings Ltd. <sup>1</sup>	216	0,07
102.316	ZAR	Sibanye Stillwater Ltd. <sup>1</sup>	239	0,08
168.716	ZAR	Standard Bank Group Ltd.	1.352	0,45
27.408	ZAR	Tiger Brands Ltd.	258	0,09
370.825	ZAR	Truworths International Ltd.	1.029	0,34
108.960	ZAR	Woolworths Holdings Ltd.	370	0,12
		<b>Sudafrica - Totale</b>	<b>16.188</b>	<b>5,39</b>
<b>Corea del Sud (31 marzo 2022: 11,94%)</b>				
1.100	KRW	Green Cross Corp.	95	0,03
11.039	KRW	GS Retail Co. Ltd.	197	0,07
14.029	KRW	Hite Jinro Co. Ltd.	260	0,09
15.664	KRW	HL Mando Co. Ltd.	486	0,16
14.000	KRW	Hugel, Inc.	1.002	0,33
3.840	KRW	Hyundai Department Store Co. Ltd.	146	0,05
14.902	KRW	Hyundai Mobis Co. Ltd.	1.987	0,66
2.384	KRW	Hyundai Wia Corp.	100	0,03
10.650	KRW	KB Financial Group, Inc.	325	0,11
1.696	KRW	KCC Corp.	273	0,09
3.742	KRW	Kia Corp.	188	0,06
7.719	KRW	Korea Electric Power Corp.	108	0,04
40.167	KRW	Korea Gas Corp.	950	0,32
35.304	KRW	Korean Air Lines Co. Ltd.	545	0,18
18.607	KRW	KT&G Corp.	1.126	0,38
9.740	KRW	POSCO Holdings, Inc.	1.438	0,48
283.377	KRW	Samsung Electronics Co. Ltd.	10.508	3,50
4.853	KRW	Samsung SDS Co. Ltd.	389	0,13
79.101	KRW	Shinhan Financial Group Co. Ltd.	1.854	0,62
6.291	KRW	Shinsegae International, Inc.	119	0,04
6.959	KRW	Shinsegae, Inc.	1.122	0,37
		<b>Corea del Sud - Totale</b>	<b>23.218</b>	<b>7,74</b>
<b>Taiwan (31 marzo 2022: 16,22%)</b>				
656.000	TWD	ASE Technology Holding Co. Ltd.	1.656	0,55
76.000	TWD	Cathay Financial Holding Co. Ltd.	96	0,03
390.000	TWD	Chicony Electronics Co. Ltd.	1.013	0,34
202.000	TWD	Chroma ATE, Inc.	1.144	0,38
249.000	TWD	Delta Electronics, Inc.	1.982	0,66
137.000	TWD	FLEXium Interconnect, Inc.	375	0,13
73.000	TWD	Formosa Sumco Technology Corp.	314	0,10
335.031	TWD	Hiwin Technologies Corp.	1.870	0,62
1.072.000	TWD	Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	3.436	1,14
16.644	USD	Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. GDR	106	0,04
63.000	TWD	Kinsus Interconnect Technology Corp.	185	0,06
11.000	TWD	Largan Precision Co. Ltd.	580	0,19
358.000	TWD	Makalot Industrial Co. Ltd.	2.066	0,69
127.000	TWD	MediaTek, Inc.	2.202	0,73
963.000	TWD	Primax Electronics Ltd.	1.937	0,65
99.000	TWD	Realtek Semiconductor Corp.	841	0,28
43.000	TWD	Simplo Technology Co. Ltd.	357	0,12
1.259.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	16.744	5,58
31.070	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ADR	2.134	0,71
415.000	TWD	Taiwan Union Technology Corp.	585	0,20
160.000	TWD	U-Ming Marine Transport Corp.	184	0,06
126.000	TWD	Uni-President Enterprises Corp.	267	0,09
1.682.000	TWD	United Microelectronics Corp.	1.895	0,63
97.747	USD	United Microelectronics Corp. ADR	547	0,18

# BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Azioni (continua)</b>				
682.000	TWD	<b>Taiwan (continua)</b> Wistron NeWeb Corp.	1.756	0,59
		<b>Taiwan - Totale</b>	<b>44.272</b>	<b>14,75</b>
		<b>Tailandia (31 marzo 2022: 2,08%)</b>		
1.939.400	THB	Bangchak Corp. PCL NVDR	1.523	0,51
2.573.000	THB	Bangkok Dusit Medical Services PCL NVDR	2.004	0,67
122.200	THB	Bumrungrad Hospital PCL NVDR	734	0,24
437.800	THB	Mega Lifesciences PCL NVDR	538	0,18
317.700	THB	PTT Exploration & Production PCL NVDR	1.354	0,45
		<b>Tailandia - Totale</b>	<b>6.153</b>	<b>2,05</b>
		<b>Turchia (31 marzo 2022: 0,24%)</b>		
139.486	TRY	Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii A/S	302	0,10
60.703	TRY	BIM Birlesik Magazalar A/S	378	0,13
73.130	TRY	Migros Ticaret A/S	399	0,13
		<b>Turchia - Totale</b>	<b>1.079</b>	<b>0,36</b>
		<b>Emirati Arabi Uniti (31 marzo 2022: 1,74%)</b>		
178.424	AED	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	440	0,15
245.952	AED	Aldar Properties PJSC, REIT	283	0,09
986.562	AED	Dubai Islamic Bank PJSC	1.597	0,53
72.672	AED	Emaar Development PJSC, REIT	91	0,03
374.610	AED	Emaar Properties PJSC, REIT	591	0,20
230.470	AED	Emirates Telecommunications Group Co. PJSC	1.462	0,49
190.610	AED	First Abu Dhabi Bank PJSC	931	0,31
		<b>Emirati Arabi Uniti - Totale</b>	<b>5.395</b>	<b>1,80</b>
		<b>Regno Unito (31 marzo 2022: 0,06%)</b>		
130.704	GBP	Hochschild Mining plc	86	0,03
		<b>Regno Unito - Totale</b>	<b>86</b>	<b>0,03</b>
		<b>Stati Uniti (31 marzo 2022: 0,42%)</b>		
22.343	USD	Southern Copper Corp.	1.002	0,33
19.631	USD	Yum China Holdings, Inc.	929	0,31
		<b>Stati Uniti - Totale</b>	<b>1.931</b>	<b>0,64</b>
		<b>Totale investimenti in azioni</b>	<b>236.995</b>	<b>78,95</b>

Partecipazione	Valuta	Controparte	Descrizione	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti per differenze</b>					
			<b>Brasile (31 marzo 2022: 0,52%)</b>		
1.466.846	USD	HSBC	Cogna Educacao	49	0,02
89.493	USD	Merrill Lynch	Cogna Educacao <sup>3</sup>	-	-
229.370	USD	Merrill Lynch	Fleury SA	28	0,01
166.198	USD	HSBC	Fleury SA	5	-
206.748	USD	HSBC	Gerdau SA	1	-
243.033	USD	HSBC	Itau Unibanco Holding SA	29	0,01
21.685	USD	Merrill Lynch	Itau Unibanco Holding SA	2	-
89.278	USD	HSBC	Vale SA	89	0,03

# BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Controparte	Descrizione	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti per differenze (continua)</b>					
<b>Brasile (continua)</b>					
114.575	USD	Merrill Lynch	Vale SA	1	-
<b>Brasile - Totale</b>				<b>204</b>	<b>0,07</b>
<b>Totale utili non realizzati su contratti per differenze (31 marzo 2022: 0,52%)</b>				<b>204</b>	<b>0,07</b>
<b>Brasile (31 marzo 2022: 0,00%)<sup>4</sup></b>					
117.919	USD	Merrill Lynch	Ambev SA	(5)	-
140.673	USD	HSBC	Ambev SA	(12)	-
91.273	USD	Merrill Lynch	Azul SA	(49)	(0,02)
127.037	USD	HSBC	Azul SA	(51)	(0,02)
214.272	USD	Merrill Lynch	Banco Bradesco SA	(1)	-
62.249	USD	HSBC	Banco do Brasil SA	(1)	-
47.844	USD	HSBC	Centrais Eletricas Brasileiras SA	(27)	(0,01)
71.123	USD	Merrill Lynch	Centrais Eletricas Brasileiras SA	(35)	(0,01)
110.953	USD	HSBC	Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA	(28)	(0,01)
271.460	USD	Merrill Lynch	Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA	(30)	(0,01)
12.618	USD	HSBC	Cia Energetica de Minas Gerais	(4)	-
70.966	USD	Merrill Lynch	Cia Energetica de Minas Gerais	(15)	(0,01)
26.438	USD	Merrill Lynch	Cia Siderurgica Nacional SA	(3)	-
26.201	USD	HSBC	Cia Siderurgica Nacional SA	(3)	-
682.791	USD	Merrill Lynch	Cielo SA	(12)	-
78.913	USD	HSBC	CPFL Energia SA	(42)	(0,01)
265.024	USD	HSBC	CSN Mineracao SA <sup>3</sup>	-	-
374.465	USD	Merrill Lynch	CSN Mineracao SA	(24)	(0,01)
25.180	USD	HSBC	EDP - Energias do Brasil SA	(6)	-
176.237	USD	Merrill Lynch	Embraer SA	(78)	(0,03)
41.443	USD	HSBC	lochpe Maxion SA <sup>3</sup>	-	-
71.097	USD	Merrill Lynch	lochpe Maxion SA	(8)	-
116.855	USD	HSBC	JBS SA	(73)	(0,02)
1	USD	HSBC	Klabin SA <sup>3</sup>	-	-
178.709	USD	Merrill Lynch	Light SA	(13)	-
503.539	USD	HSBC	Light SA	(54)	(0,02)
50.264	USD	HSBC	Marfrig Global Foods SA	(23)	(0,01)
98.985	USD	HSBC	Petroleo Brasileiro SA	(56)	(0,02)
444.407	USD	Merrill Lynch	Petroleo Brasileiro SA	(185)	(0,06)
53.075	USD	Merrill Lynch	Qualicorp Consultoria e Corretora de Seguros SA	(6)	-
86.881	USD	Merrill Lynch	Raia Drogasil SA	(11)	-
64.755	USD	Merrill Lynch	Sao Martinho SA	(16)	(0,01)
29.168	USD	HSBC	Sao Martinho SA	(20)	(0,01)
190.611	USD	HSBC	Ultrapar Participacoes SA	(73)	(0,02)
78.526	USD	HSBC	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA Usiminas <sup>3</sup>	-	-
192.411	USD	Merrill Lynch	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA Usiminas	(18)	(0,01)
185.329	USD	HSBC	Via SA <sup>3</sup>	-	-
67.456	USD	Merrill Lynch	Zamp SA	(17)	(0,01)
<b>Brasile - Totale</b>				<b>(999)</b>	<b>(0,33)</b>
<b>Kuwait (31 marzo 2022: 0,00%)</b>					
109.082	USD	HSBC	Kuwait Finance House KSCP	(16)	(0,01)
<b>Kuwait - Totale</b>				<b>(16)</b>	<b>(0,01)</b>
<b>Totale perdite non realizzate su contratti per differenze (31 marzo 2022: 0,00%)<sup>4</sup></b>				<b>(1.015)</b>	<b>(0,34)</b>

# BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Numero di contratti	Valuta	Importo	Descrizione	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti future</b>						
<b>Regno Unito (31 marzo 2022: 0,38%)</b>					-	-
<b>Stati Uniti (31 marzo 2022: 0,07%)</b>					-	-
<b>Totale utili non realizzati su contratti future (31 marzo 2022: 0,45%)</b>					<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Regno Unito (31 marzo 2022: 0,00%)</b>						
363	USD	36.300	MSCI India Index	16/12/2022	(2.981)	(0,99)
<b>Regno Unito - Totale</b>					<b>(2.981)</b>	<b>(0,99)</b>
<b>Stati Uniti (31 marzo 2022: 0,00%)</b>						
136	USD	6.800	MSCI Emerging Markets Index	16/12/2022	(784)	(0,26)
<b>Stati Uniti - Totale</b>					<b>(784)</b>	<b>(0,26)</b>
<b>Totale perdite non realizzate su contratti future (31 marzo 2022: 0,00%)</b>					<b>(3.765)</b>	<b>(1,25)</b>
					<b>Valore equo Migliaia di USD</b>	<b>% del valore patrimoniale netto</b>
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico					237.199	79,02
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico					(4.780)	(1,59)
Liquidità, liquidità a margine e garanzia liquida					64.494	21,49
Altre attività e passività					3.257	1,08
<b>Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>					<b>300.170</b>	<b>100,00</b>

	% del totale attività
<b>Analisi del totale attività</b>	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	76,63
Valori mobiliari negoziati su un altro mercato regolamentato	0,07
Strumenti finanziari derivati OTC	0,07
Altre attività	23,23
<b>Totale attività</b>	<b>100,00</b>

<sup>1</sup>Titolo parzialmente o completamente in prestito.

<sup>2</sup>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.

<sup>3</sup>Gli investimenti inferiori a USD 500 sono stati arrotondati a zero.

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

	Sulle perdite Sui guadagni Migliaia di USD	Sulle perdite Migliaia di USD
<b>Valore dell'esposizione</b>		
Contratti per differenze	7.161	13.573
Contratti future	-	38.606

# BLACKROCK FIXED INCOME SELECTION FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO</b>				
<b>Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2022: 83,10%)</b>				
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 15,62%)</b>				
26.184	EUR	BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating <sup>1</sup>	2.474	6,50
24.865	EUR	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating <sup>1</sup>	2.661	6,99
		<b>Irlanda - Totale</b>	<b>5.135</b>	<b>13,49</b>
<b>Lussemburgo (31 marzo 2022: 67,48%)</b>				
75.156	USD	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD Hedged <sup>1</sup>	757	1,99
123.114	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	761	2,00
38.970	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	378	0,99
162.153	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	1.685	4,43
437.438	EUR	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	4.243	11,15
276.566	EUR	BlackRock Global Funds - ESG Multi-Asset Fund - Classe I2 EUR <sup>1</sup>	3.454	9,08
103.128	EUR	BlackRock Global Funds - Euro Short Duration Bond Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	1.686	4,43
76.963	EUR	BlackRock Global Funds - Global Inflation Linked Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged <sup>1</sup>	1.144	3,01
70.566	USD	BlackRock Global Funds - Global Multi-Asset Income Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	1.145	3,01
3.523	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	380	1,00
13.731	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	1.242	3,26
23.455	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	2.077	5,46
38.931	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	5.181	13,61
		<b>Lussemburgo - Totale</b>	<b>24.133</b>	<b>63,42</b>
<b>Totale investimenti in organismi di investimento collettivo</b>			<b>29.268</b>	<b>76,91</b>
<b>Totale investimenti in organismi di investimento collettivo</b>			<b>29.268</b>	<b>76,91</b>
<b>ETF (31 marzo 2022: 15,54%)</b>				
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 15,54%)</b>				
772.935	EUR	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) <sup>1</sup>	3.154	8,29
4.642	USD	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) <sup>1</sup>	839	2,20
76.880	EUR	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) <sup>1</sup>	313	0,82
218.067	EUR	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) <sup>1</sup>	935	2,46
31.374	EUR	iShares Global Corp Bond EUR Hedged UCITS ETF (Dist) <sup>1</sup>	2.656	6,98
74.632	EUR	iShares Global Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) <sup>1</sup>	314	0,82
5.508	EUR	iShares Italy Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) <sup>1</sup>	775	2,04
		<b>Irlanda - Totale</b>	<b>8.986</b>	<b>23,61</b>
<b>Totale investimenti in ETF</b>			<b>8.986</b>	<b>23,61</b>

NM1222U-2615757-160/212



# BLACKROCK FIXED INCOME SELECTION FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti di cambio a termine<sup>2</sup></b>				
<b>Totale utili non realizzati su contratti di cambio a termine (31 marzo 2022: 0,01%)</b>			<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Contratti di cambio a termine<sup>2</sup></b>				
Buy EUR 4,440,531; Sell USD 4,474,079	State Street	06/10/2022	(126)	(0,33)
Buy USD 243,992; Sell EUR 250,538	J.P. Morgan	06/10/2022	(1)	(0,01)
Buy USD 236,248; Sell EUR 245,860	Morgan Stanley	06/10/2022	(5)	(0,01)
<b>Totale perdite non realizzate su contratti di cambio a termine (31 marzo 2022: (0,18)%)</b>			<b>(132)</b>	<b>(0,35)</b>
			<b>Valore equo Migliaia di EUR</b>	<b>% del valore patrimoniale netto</b>
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico			38.254	100,52
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico			(132)	(0,35)
Liquidità			29	0,08
Altre attività e passività			(96)	(0,25)
<b>Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>			<b>38.055</b>	<b>100,00</b>

	% del totale attività
<b>Analisi del totale attività</b>	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	23,14
Organismi di investimento collettivo	75,35
Altre attività	1,51
<b>Totale attività</b>	<b>100,00</b>

<sup>1</sup>Una parte correlata al Fondo.

<sup>2</sup>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.

	Sui guadagni Migliaia di EUR	Sulle perdite Migliaia di EUR
<b>Valore dell'esposizione</b>		
Contratti di cambio a termine	-	5.057

# BLACKROCK GLOBAL EQUITY SELECTION FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO</b>				
<b>Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2022: 72,53%)</b>				
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 13,63%)</b>				
23.665	EUR	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Classe X EUR Accumulating <sup>1</sup>	2.798	9,88
10.782	USD	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating <sup>1</sup>	1.271	4,48
14.273	USD	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating <sup>1</sup>	2.019	7,12
		<b>Irlanda - Totale</b>	<b>6.088</b>	<b>21,48</b>
<b>Lussemburgo (31 marzo 2022: 58,90%)</b>				
81.662	EUR	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	3.135	11,06
32.818	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	450	1,59
163.808	EUR	BlackRock Global Funds - European Special Situations Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	2.362	8,34
2.123	JPY	BlackRock Global Funds - Japan Small & MidCap Opportunities Fund - Class X2 JPY <sup>1</sup>	148	0,52
16.693	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	306	1,08
11.903	USD	BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Opportunities Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	142	0,50
4.795	EUR	BlackRock Global Funds - Systematic Global SmallCap Fund - Classe D2 EUR <sup>1</sup>	606	2,14
5.699	EUR	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Class X2 EUR <sup>1</sup>	849	3,00
4.835	USD	BlackRock Global Funds - US Basic Value Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	639	2,26
12.965	EUR	BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	376	1,33
87.181	USD	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	1.446	5,10
13.980	USD	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	1.026	3,62
2.653	USD	BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	197	0,70
21.965	USD	BlackRock Global Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	267	0,94
50.540	USD	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	993	3,50
3.945	USD	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	703	2,48
		<b>Lussemburgo - Totale</b>	<b>13.645</b>	<b>48,16</b>
<b>Totale investimenti in organismi di investimento collettivo</b>			<b>19.733</b>	<b>69,64</b>
<b>Totale investimenti in organismi di investimento collettivo</b>			<b>19.733</b>	<b>69,64</b>
<b>ETF (31 marzo 2022: 27,62%)</b>				
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 27,62%)</b>				
30.097	GBP	iShares Core FTSE 100 UCITS ETF - Classe di Azioni GBP (Acc) <sup>1/2</sup>	242	0,85
497.232	EUR	iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc) <sup>1/2</sup>	3.123	11,02
210.080	EUR	iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	1.164	4,11
84.626	EUR	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	389	1,37
118.643	EUR	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	587	2,07
7.951	EUR	iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) <sup>1</sup>	310	1,10
416.418	EUR	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	2.801	9,89
		<b>Irlanda - Totale</b>	<b>8.616</b>	<b>30,41</b>
<b>Totale investimenti in ETF</b>			<b>8.616</b>	<b>30,41</b>

NMI2220-2615/57-162/212

# BLACKROCK GLOBAL EQUITY SELECTION FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico	28.349	100,05
Liquidità	20	0,07
Altre attività e passività	(34)	(0,12)
<b>Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>	<b>28.335</b>	<b>100,00</b>

	% del totale attività
<b>Analisi del totale attività</b>	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	30,10
Organismi di investimento collettivo	68,95
Altre attività	0,95
<b>Totale attività</b>	<b>100,00</b>

<sup>1</sup> Una parte correlata al Fondo.

<sup>2</sup> Titolo parzialmente o completamente in prestito.

# BLACKROCK MULTI ASSET BALANCED SELECTION FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO</b>				
<b>Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2022: 82,75%)</b>				
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 16,42%)</b>				
17.843	EUR	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Classe X EUR Accumulating <sup>1</sup>	2.110	5,98
22.412	EUR	BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating <sup>1</sup>	2.117	6,01
7.179	USD	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating <sup>1</sup>	846	2,40
6.279	USD	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating <sup>1</sup>	888	2,52
3.396	EUR	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating <sup>1</sup>	363	1,03
18.655	EUR	iShares UK Index Fund (IE) - Classe di Azioni Euro (Hedged) Flexible Accumulating <sup>1</sup>	194	0,55
		<b>Irlanda - Totale</b>	<b>6.518</b>	<b>18,49</b>
<b>Lussemburgo (31 marzo 2022: 66,33%)</b>				
91.830	USD	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD Hedged <sup>1</sup>	925	2,63
51.347	EUR	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	1.971	5,59
41.783	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	574	1,63
58.813	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	363	1,03
42.936	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	416	1,18
116.786	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	1.214	3,44
83.991	EUR	BlackRock Global Funds - Global Inflation Linked Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged <sup>1</sup>	1.248	3,54
19.466	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	357	1,01
28.019	USD	BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Opportunities Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	335	0,95
2.872	EUR	BlackRock Global Funds - Systematic Global SmallCap Fund - Classe D2 EUR <sup>1</sup>	363	1,03
4.811	EUR	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Class X2 EUR <sup>1</sup>	717	2,03
4.115	USD	BlackRock Global Funds - US Basic Value Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	544	1,54
155.401	USD	BlackRock Global Funds - US Dollar Bond Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	1.602	4,55
7.714	EUR	BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	224	0,63
41.291	USD	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	685	1,94
6.146	USD	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	451	1,28
1.767	USD	BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	131	0,37
13.779	USD	BlackRock Global Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	168	0,48
23.996	USD	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	471	1,34
2.750	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	297	0,84
37.652	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	3.406	9,66
24.038	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	2.129	6,04
2.340	USD	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	361	1,02
		<b>Lussemburgo - Totale</b>	<b>18.952</b>	<b>53,75</b>
<b>Totale investimenti in organismi di investimento collettivo</b>			<b>25.470</b>	<b>72,24</b>
<b>Totale investimenti in organismi di investimento collettivo</b>			<b>25.470</b>	<b>72,24</b>

# BLACKROCK MULTI ASSET BALANCED SELECTION FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>ETF (31 marzo 2022: 17,21%)</b>				
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 17,21%)</b>				
770.327	EUR	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) <sup>1</sup>	3.144	8,92
47.905	EUR	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) <sup>1</sup>	177	0,50
6.757	USD	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) <sup>1</sup>	1.221	3,46
34.951	EUR	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) <sup>1</sup>	142	0,40
150.678	EUR	iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) <sup>1</sup>	747	2,12
56.226	EUR	iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc) <sup>1</sup>	353	1,00
197.347	EUR	iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	1.093	3,10
217.402	EUR	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) <sup>1</sup>	933	2,65
114.296	EUR	iShares Global Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) <sup>1</sup>	480	1,36
30.491	EUR	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	140	0,40
63.678	EUR	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	315	0,89
2.857	EUR	iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) <sup>1</sup>	112	0,32
77.749	EUR	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	523	1,48
11.363	USD	iShares Physical Gold ETC <sup>1</sup>	378	1,07
<b>Irlanda - Totale</b>			<b>9.758</b>	<b>27,67</b>
<b>Totale investimenti in ETF</b>			<b>9.758</b>	<b>27,67</b>
Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti di cambio a termine<sup>2</sup></b>				
Buy USD 434,802; Sell EUR 434,525	Barclays	06/10/2022	9	0,03
<b>Totale utili non realizzati su contratti di cambio a termine (31 marzo 2022: 0,01%)</b>			<b>9</b>	<b>0,03</b>
<b>Contratti di cambio a termine<sup>2</sup></b>				
Buy EUR 6,617,090; Sell USD 6,667,082	State Street	06/10/2022	(188)	(0,53)
Buy USD 219,897; Sell EUR 225,796	J.P. Morgan	06/10/2022	(1)	(0,01)
Buy USD 214,367; Sell EUR 223,089	Morgan Stanley	06/10/2022	(4)	(0,01)
<b>Totale perdite non realizzate su contratti di cambio a termine (31 marzo 2022: (0,32)%)</b>			<b>(193)</b>	<b>(0,55)</b>
			<b>Valore equo Migliaia di EUR</b>	<b>% del valore patrimoniale netto</b>
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico			35.237	99,94
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico			(193)	(0,55)
Liquidità			36	0,10
Altre attività e passività			178	0,51
<b>Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>			<b>35.258</b>	<b>100,00</b>
<b>Analisi del totale attività</b>				<b>% del totale attività</b>
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale				27,13
Organismi di investimento collettivo				70,80
Strumenti finanziari derivati OTC				0,03
Altre attività				2,04
<b>Totale attività</b>				<b>100,00</b>

# BLACKROCK MULTI ASSET BALANCED SELECTION FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

<sup>1</sup>Una parte correlata al Fondo.

<sup>2</sup>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.

<b>Valore dell'esposizione</b>	<b>Sui guadagni Migliaia di EUR</b>	<b>Sulle perdite Migliaia di EUR</b>
Contratti di cambio a termine	444	7.249



# BLACKROCK MULTI ASSET CONSERVATIVE SELECTION FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO</b>				
<b>Organismi di investimento collettivo (31 marzo 2022: 73,96%)</b>				
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 9,94%)</b>				
40.316	EUR	BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating <sup>1</sup>	3.809	4,14
10.821	USD	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating <sup>1</sup>	1.275	1,39
23.222	EUR	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating <sup>1</sup>	2.486	2,71
		<b>Irlanda - Totale</b>	<b>7.570</b>	<b>8,24</b>
<b>Lussemburgo (31 marzo 2022: 64,02%)</b>				
235.106	USD	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD Hedged <sup>1</sup>	2.369	2,58
277.223	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	1.713	1,86
277.495	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	2.884	3,14
333.753	EUR	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	3.237	3,52
280.341	EUR	BlackRock Global Funds - Global Inflation Linked Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged <sup>1</sup>	4.166	4,53
48.077	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	466	0,51
35.502	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	651	0,71
73.638	USD	BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Opportunities Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	881	0,96
6.676	EUR	BlackRock Global Funds - Systematic Global SmallCap Fund - Classe D2 EUR <sup>1</sup>	844	0,92
1.878	EUR	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Class X2 EUR <sup>1</sup>	280	0,30
16.872	EUR	BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	489	0,53
101.556	USD	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	1.684	1,83
17.037	USD	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	1.250	1,36
6.199	USD	BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	461	0,50
27.396	USD	BlackRock Global Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	334	0,36
73.417	USD	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	1.442	1,57
7.632	USD	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	1.360	1,48
7.348	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	793	0,86
68.061	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	6.156	6,69
55.552	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	4.920	5,35
41.624	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Class X2 EUR <sup>1</sup>	4.508	4,90
27.940	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	3.718	4,04
17.569	USD	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	2.707	2,94
		<b>Lussemburgo - Totale</b>	<b>47.313</b>	<b>51,44</b>
<b>Totale investimenti in organismi di investimento collettivo</b>			<b>54.883</b>	<b>59,68</b>
<b>Totale investimenti in organismi di investimento collettivo</b>			<b>54.883</b>	<b>59,68</b>

# BLACKROCK MULTI ASSET CONSERVATIVE SELECTION FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>ETF (31 marzo 2022: 25,31%)</b>				
<b>Germania (31 marzo 2022: 1,15%)</b>				
32.982	EUR	iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF (DE) <sup>1</sup>	964	1,05
<b>Germania - Totale</b>			<b>964</b>	<b>1,05</b>
<b>Irlanda (31 marzo 2022: 24,16%)</b>				
2.171.308	EUR	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) <sup>1</sup>	8.861	9,64
118.786	EUR	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) <sup>1</sup>	440	0,48
23.687	USD	iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) <sup>1</sup>	3.009	3,27
14.617	USD	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) <sup>1</sup>	2.641	2,87
447.720	EUR	iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) <sup>1</sup>	2.221	2,41
215.626	EUR	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) <sup>1</sup>	1.110	1,21
56.140	GBP	iShares Core FTSE 100 UCITS ETF - Classe di Azioni GBP (Acc) <sup>1/2</sup>	432	0,47
384.216	EUR	iShares Edge MSCI USA Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	2.311	2,51
958.663	EUR	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) <sup>1</sup>	4.112	4,47
12.872	EUR	iShares Italy Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) <sup>1</sup>	1.812	1,97
134.835	EUR	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	619	0,67
220.748	EUR	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	1.092	1,19
9.170	EUR	iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) <sup>1</sup>	358	0,39
687.288	EUR	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	4.623	5,03
58.420	USD	iShares Physical Gold ETC <sup>1</sup>	1.943	2,11
<b>Irlanda - Totale</b>			<b>35.584</b>	<b>38,69</b>
<b>Totale investimenti in ETF</b>			<b>36.548</b>	<b>39,74</b>
Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti di cambio a termine<sup>3</sup></b>				
Buy EUR 358,243; Sell GBP 310,000	Bank of America	06/10/2022	5	0,01
Buy EUR 62,503; Sell GBP 54,084	Toronto-Dominion Bank	06/10/2022	1	-
Buy USD 1,840,392; Sell EUR 1,849,356	J.P. Morgan	06/10/2022	29	0,03
<b>Totale utili non realizzati su contratti di cambio a termine (31 marzo 2022: 0,01%)</b>			<b>35</b>	<b>0,04</b>
<b>Contratti di cambio a termine<sup>3</sup></b>				
Buy EUR 20,123,808; Sell USD 20,275,843	State Street	06/10/2022	(570)	(0,62)
Buy USD 550,170; Sell EUR 568,326	Morgan Stanley	06/10/2022	(7)	(0,01)
<b>Totale perdite non realizzate su contratti di cambio a termine (31 marzo 2022: (0,30)%)</b>			<b>(577)</b>	<b>(0,63)</b>
			Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico			91.466	99,46
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico			(577)	(0,63)
Liquidità			548	0,60
Altre attività e passività			529	0,57
<b>Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>			<b>91.966</b>	<b>100,00</b>

# BLACKROCK MULTI ASSET CONSERVATIVE SELECTION FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

	<b>% del totale attività</b>
<b>Analisi del totale attività</b>	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	36,76
Organismi di investimento collettivo	55,20
Strumenti finanziari derivati OTC	0,04
Altre attività	8,00
<b>Totale attività</b>	<b><u>100,00</u></b>

<sup>1</sup>Una parte correlata al Fondo.

<sup>2</sup>Titolo parzialmente o completamente in prestito.

<sup>3</sup>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.

	<b>Sui guadagni Migliaia di EUR</b>	<b>Sulle perdite Migliaia di EUR</b>
<b>Valore dell'esposizione</b>		
Contratti di cambio a termine	2.293	21.259

# BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Azioni (31 marzo 2022: 84,98%)</b>				
<b>Bermuda (31 marzo 2022: 1,38%)</b>				
68.000	HKD	Beijing Enterprises Water Group Ltd.	16	0,16
3.800	HKD	China Resources Gas Group Ltd.	12	0,12
8.000	HKD	Kunlun Energy Co. Ltd.	6	0,06
		<b>Bermuda - Totale</b>	<b>34</b>	<b>0,34</b>
<b>Brasile (31 marzo 2022: 0,07%)</b>				
11.484	USD	Ambev SA ADR	33	0,33
1.729	USD	Cia Energetica de Minas Gerais ADR	3	0,03
		<b>Brasile - Totale</b>	<b>36</b>	<b>0,36</b>
<b>Isole Cayman (31 marzo 2022: 17,07%)</b>				
74.500	HKD	3SBio, Inc.	53	0,53
23.340	HKD	Alibaba Group Holding Ltd.	232	2,32
200	HKD	ANTA Sports Products Ltd.	2	0,02
143	USD	Autohome, Inc. ADR	4	0,04
3.598	HKD	Baidu, Inc. 'A'	52	0,52
91	USD	BeiGene Ltd. ADR	12	0,12
40.000	HKD	Bosideng International Holdings Ltd.	20	0,20
5.850	TWD	Chailease Holding Co. Ltd.	34	0,34
800	HKD	China Literature Ltd.	2	0,02
17.000	HKD	China Medical System Holdings Ltd.	20	0,20
2.000	HKD	China Meidong Auto Holdings Ltd.	3	0,03
11.000	HKD	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd.	6	0,06
2.200	HKD	ENN Energy Holdings Ltd.	29	0,29
14.000	HKD	Geely Automobile Holdings Ltd.	19	0,19
317	USD	H World Group Ltd. ADR	11	0,11
303	USD	HUTCHMED China Ltd. ADR	3	0,03
3.062	HKD	JD.com, Inc. 'A'	77	0,77
1.026	USD	KE Holdings, Inc., REIT ADR	18	0,18
11.000	HKD	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	14	0,14
1.034	USD	Li Auto, Inc. ADR	24	0,24
1.783	USD	Lufax Holding Ltd. ADR	5	0,05
5.000	HKD	Meituan 'B'	106	1,05
3.395	HKD	NetEase, Inc.	51	0,51
1.990	HKD	New Oriental Education & Technology Group, Inc.	5	0,05
2.113	USD	NIO, Inc. ADR 'A'	33	0,33
747	USD	Pinduoduo, Inc. ADR	47	0,47
890.500	HKD	Shimao Group Holdings Ltd. <sup>1</sup>	255	2,55
381.000	HKD	Sunac China Holdings Ltd. <sup>1</sup>	97	0,97
700	HKD	Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.	7	0,07
696	USD	TAL Education Group ADR	3	0,03
9.000	HKD	Tencent Holdings Ltd.	306	3,06
1.126	USD	Tencent Music Entertainment Group ADR	5	0,05
8.400	HKD	Tongcheng Travel Holdings Ltd.	17	0,17
24.000	HKD	Topsports International Holdings Ltd.	17	0,17
871	USD	Trip.com Group Ltd. ADR	24	0,24
5.000	HKD	Uni-President China Holdings Ltd.	4	0,04
1.618	USD	Vipshop Holdings Ltd. ADR	14	0,14
6.000	HKD	Wuxi Biologics Cayman, Inc.	36	0,36
6.000	HKD	Xinyi Solar Holdings Ltd.	6	0,06
803	USD	XPeng, Inc. ADR	10	0,10
22.000	HKD	Yadea Group Holdings Ltd.	35	0,35
98	USD	Zai Lab Ltd. ADR	3	0,03
3.500	HKD	Zhongsheng Group Holdings Ltd.	14	0,14
		<b>Isole Cayman - Totale</b>	<b>1.735</b>	<b>17,34</b>

# BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Azioni (continua)</b>				
<b>Cile (31 marzo 2022: 0,20%)</b>				
230	CLP	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, Preference 'B'	22	0,22
		<b>Cile - Totale</b>	<b>22</b>	<b>0,22</b>
<b>Cina (31 marzo 2022: 13,22%)</b>				
500	CNY	Anhui Gujing Distillery Co. Ltd. 'A'	19	0,19
3.000	CNY	Avary Holding Shenzhen Co. Ltd. 'A'	11	0,11
18.500	HKD	BAIC Motor Corp. Ltd. 'H'	4	0,04
40.000	HKD	Bank of China Ltd. 'H'	13	0,13
1.200	CNY	Beijing Easpring Material Technology Co. Ltd. 'A'	11	0,11
1.100	CNY	BYD Co. Ltd. 'A'	39	0,39
2.000	HKD	BYD Co. Ltd. 'H'	50	0,50
137.000	HKD	China Construction Bank Corp. 'H'	79	0,79
11.000	HKD	China Life Insurance Co. Ltd. 'H'	14	0,14
18.500	HKD	China Merchants Bank Co. Ltd. 'H'	86	0,86
3.800	HKD	China Vanke Co. Ltd., REIT 'H'	7	0,07
45.000	HKD	CMOC Group Ltd. 'H'	18	0,18
1.261	CNY	Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. 'A'	71	0,71
3.700	CNY	Eve Energy Co. Ltd. 'A'	44	0,44
1.377	CNY	Ganfeng Lithium Group Co. Ltd. 'A'	14	0,14
560	HKD	Ganfeng Lithium Group Co. Ltd. 'H'	4	0,04
12.000	HKD	Great Wall Motor Co. Ltd. 'H'	14	0,14
8.800	CNY	Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai 'A'	40	0,40
640	CNY	Hithink RoyalFlush Information Network Co. Ltd. 'A'	7	0,07
3.200	HKD	Huatai Securities Co. Ltd. 'H'	4	0,04
49.000	HKD	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 'H'	23	0,23
11.000	HKD	Jiangxi Copper Co. Ltd. 'H'	13	0,13
100	CNY	Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'	26	0,26
3.694	CNY	LONGi Green Energy Technology Co. Ltd. 'A'	25	0,25
5.100	CNY	Luxshare Precision Industry Co. Ltd. 'A'	21	0,21
500	CNY	Luzhou Laojiao Co. Ltd. 'A'	16	0,16
18.200	CNY	People's Insurance Co. Group of China Ltd. (The) 'A'	13	0,13
97.000	HKD	People's Insurance Co. Group of China Ltd. (The) 'H'	28	0,28
7.000	HKD	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H'	35	0,35
1.874	CNY	Qinghai Salt Lake Industry Co. Ltd. 'A'	6	0,06
4.817	CNY	SF Holding Co. Ltd. 'A'	32	0,32
12.400	HKD	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd. 'H'	17	0,17
2.900	CNY	Shanghai Putailai New Energy Technology Co. Ltd. 'A'	23	0,23
3.400	CNY	Shenzhen Inovance Technology Co. Ltd. 'A'	27	0,27
13.200	HKD	Sinopharm Group Co. Ltd. 'H'	26	0,26
4.900	CNY	Sunwoda Electronic Co. Ltd. 'A'	16	0,16
2.500	CNY	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co. Ltd. 'A'	8	0,08
1.600	CNY	Weichai Power Co. Ltd. 'A'	2	0,02
3.000	HKD	Weichai Power Co. Ltd. 'H'	3	0,03
1.420	HKD	WuXi AppTec Co. Ltd. 'H'	12	0,11
200	CNY	Xiamen Faratronic Co. Ltd. 'A'	5	0,05
600	CNY	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd. 'A'	1	0,01
6.400	HKD	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd. 'H'	7	0,07
9.700	CNY	YTO Express Group Co. Ltd. 'A'	28	0,28
20.000	HKD	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co. Ltd. 'H'	7	0,07
5.804	CNY	ZTE Corp. 'A'	17	0,17
		<b>Cina - Totale</b>	<b>986</b>	<b>9,85</b>
<b>Colombia (31 marzo 2022: 0,12%)</b>				
376	USD	Bancolombia SA, Preference ADR	9	0,09
		<b>Colombia - Totale</b>	<b>9</b>	<b>0,09</b>
<b>Grecia (31 marzo 2022: 0,54%)</b>				
189	EUR	Hellenic Telecommunications Organization SA	3	0,03
205	EUR	JUMBO SA <sup>2</sup>	3	0,03

# BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Azioni (continua)</b>				
<b>Grecia (31 marzo 2022: 0,54%) (continua)</b>				
5.530	EUR	OPAP SA	66	0,66
		<b>Grecia - Totale</b>	<b>72</b>	<b>0,72</b>
<b>Hong Kong (31 marzo 2022: 0,94%)</b>				
3.000	HKD	Beijing Enterprises Holdings Ltd.	8	0,08
59.000	HKD	Fosun International Ltd.	37	0,37
46.000	HKD	Lenovo Group Ltd.	32	0,32
1.000	HKD	Sinotruk Hong Kong Ltd.	1	0,01
		<b>Hong Kong - Totale</b>	<b>78</b>	<b>0,78</b>
<b>Ungheria (31 marzo 2022: 0,00%)</b>				
205	HUF	OTP Bank Nyrt.	4	0,04
		<b>Ungheria - Totale</b>	<b>4</b>	<b>0,04</b>
<b>India (31 marzo 2022: 0,78%)</b>				
			-	-
<b>Indonesia (31 marzo 2022: 1,55%)</b>				
205.900	IDR	Bank Central Asia Tbk. PT	116	1,16
27.400	IDR	Bank Mandiri Persero Tbk. PT	17	0,17
48.800	IDR	Bank Negara Indonesia Persero Tbk. PT	29	0,29
162.000	IDR	Kalbe Farma Tbk. PT	20	0,19
134.100	IDR	Perusahaan Gas Negara Tbk. PT	15	0,15
65.100	IDR	Sumber Alfaria Trijaya Tbk. PT	10	0,10
66.200	IDR	Unilever Indonesia Tbk. PT	21	0,21
		<b>Indonesia - Totale</b>	<b>228</b>	<b>2,27</b>
<b>Lussemburgo (31 marzo 2022: 0,14%)</b>				
			-	-
<b>Malesia (31 marzo 2022: 1,42%)</b>				
15.700	MYR	Axiata Group Bhd.	9	0,09
29.900	MYR	CIMB Group Holdings Bhd.	33	0,33
500	MYR	Nestle Malaysia Bhd.	14	0,14
3.200	MYR	PPB Group Bhd.	11	0,11
47.900	MYR	Public Bank Bhd.	43	0,43
16.500	MYR	RHB Bank Bhd.	20	0,20
14.300	MYR	Telekom Malaysia Bhd.	17	0,17
		<b>Malesia - Totale</b>	<b>147</b>	<b>1,47</b>
<b>Messico (31 marzo 2022: 2,43%)</b>				
10.975	MXN	Coca-Cola Femsa SAB de CV	64	0,64
83	USD	Coca-Cola Femsa SAB de CV ADR	5	0,05
2.383	MXN	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	15	0,15
172	USD	Fomento Economico Mexicano SAB de CV ADR	11	0,11
2.262	MXN	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV 'B'	29	0,29
312	MXN	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	6	0,06
2.363	MXN	Grupo Bimbo SAB de CV 'A'	8	0,08
4.442	MXN	Grupo Financiero Banorte SAB de CV 'O'	28	0,28
20.690	MXN	Orbia Advance Corp. SAB de CV	35	0,35
		<b>Messico - Totale</b>	<b>201</b>	<b>2,01</b>
<b>Paesi Bassi (31 marzo 2022: 0,00%)</b>				
2.378	ZAR	NEPI Rockcastle NV, REIT	11	0,11
		<b>Paesi Bassi - Totale</b>	<b>11</b>	<b>0,11</b>



# BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Azioni (continua)</b>				
<b>Filippine (31 marzo 2022: 0,11%)</b>				
9.670	PHP	Bank of the Philippine Islands	15	0,15
3.230	PHP	GT Capital Holdings, Inc.	23	0,23
570	PHP	Jollibee Foods Corp.	2	0,02
		<b>Filippine - Totale</b>	<b>40</b>	<b>0,40</b>
<b>Qatar (31 marzo 2022: 1,01%)</b>				
2.670	QAR	Barwa Real Estate Co., REIT	2	0,02
3.317	QAR	Commercial Bank PSQC (The)	6	0,06
8.487	QAR	Masraf Al Rayan QSC	10	0,10
7.295	QAR	Mesaieed Petrochemical Holding Co.	5	0,05
2.153	QAR	Ooredoo QPSC	5	0,05
1.586	QAR	Qatar Electricity & Water Co. QSC	8	0,08
1.973	QAR	Qatar Islamic Bank SAQ	13	0,13
10.347	QAR	Qatar National Bank QPSC	56	0,56
		<b>Qatar - Totale</b>	<b>105</b>	<b>1,05</b>
<b>Russia (31 marzo 2022: 0,00%)<sup>3</sup></b>				
814.343	RUB	Alrosa PJSC <sup>1/4</sup>	-	-
382.920	RUB	Mobile TeleSystems PJSC <sup>1/4</sup>	-	-
		<b>Russia - Totale</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Arabia Saudita (31 marzo 2022: 3,80%)</b>				
2.131	SAR	Al Rajhi Bank	46	0,46
4.941	SAR	Alinma Bank	48	0,48
232	SAR	Arab National Bank	2	0,02
1.014	SAR	Bank AlBilad	13	0,13
473	SAR	Banque Saudi Fransi	5	0,05
57	SAR	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co.	3	0,03
309	SAR	Riyad Bank	3	0,03
595	SAR	Saudi Arabian Mining Co.	11	0,11
1.903	SAR	Saudi Basic Industries Corp.	45	0,45
4.422	SAR	Saudi National Bank (The)	74	0,74
3.091	SAR	Savola Group (The)	23	0,23
3.219	SAR	Seera Group Holding	16	0,16
		<b>Totale Arabia Saudita</b>	<b>289</b>	<b>2,89</b>
<b>Sudafrica (31 marzo 2022: 4,76%)</b>				
338	ZAR	AngloGold Ashanti Ltd.	5	0,05
1.455	ZAR	Aspen Pharmacare Holdings Ltd.	11	0,11
2.446	ZAR	Bidvest Group Ltd. (The) <sup>2</sup>	27	0,27
7.156	ZAR	FirstRand Ltd.	24	0,24
3.855	ZAR	Foschini Group Ltd. (The)	25	0,25
751	ZAR	Gold Fields Ltd. <sup>2</sup>	6	0,06
872	USD	Gold Fields Ltd. ADR <sup>2</sup>	7	0,07
1.674	ZAR	Impala Platinum Holdings Ltd.	16	0,16
2.828	ZAR	Mr Price Group Ltd.	27	0,27
322	ZAR	Naspers Ltd. 'N'	40	0,40
2.234	ZAR	Nedbank Group Ltd.	25	0,25
30.918	ZAR	Old Mutual Ltd. <sup>2</sup>	17	0,17
1.589	ZAR	Royal Bafokeng Platinum Ltd. <sup>2</sup>	13	0,13
5.992	ZAR	Sanlam Ltd.	17	0,17
3.348	ZAR	Sibanye Stillwater Ltd.	8	0,08
1.856	ZAR	Standard Bank Group Ltd.	15	0,15
7.346	ZAR	Vodacom Group Ltd.	50	0,50
		<b>Sudafrica - Totale</b>	<b>333</b>	<b>3,33</b>

# BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Azioni (continua)</b>				
<b>Corea del Sud (31 marzo 2022: 12,84%)</b>				
545	KRW	AMOREPACIFIC Group	10	0,10
19	KRW	Celltrion, Inc.	2	0,02
198	KRW	CJ Logistics Corp.	13	0,13
537	KRW	Hanwha Solutions Corp.	18	0,18
481	KRW	HL Mando Co. Ltd.	15	0,15
75	KRW	Hugel, Inc.	5	0,05
124	KRW	Hyundai Glovis Co. Ltd.	14	0,14
302	KRW	Hyundai Mobis Co. Ltd.	40	0,40
1.372	KRW	KB Financial Group, Inc.	42	0,42
712	USD	KB Financial Group, Inc. ADR	21	0,21
123	KRW	Kia Corp. <sup>2</sup>	6	0,06
100	KRW	LG Chem Ltd.	38	0,38
57	KRW	LG H&H Co. Ltd. <sup>2</sup>	25	0,25
300	KRW	NAVER Corp.	41	0,41
59	KRW	NCSOFT Corp.	14	0,14
307	KRW	Netmarble Corp.	11	0,11
221	KRW	POSCO Holdings, Inc.	33	0,33
622	KRW	S-1 Corp.	25	0,25
350	KRW	Samsung C&T Corp.	25	0,25
8.386	KRW	Samsung Electronics Co. Ltd.	311	3,11
16	USD	Samsung Electronics Co. Ltd. GDR <sup>2</sup>	15	0,15
53	KRW	Samsung SDI Co. Ltd.	20	0,20
158	KRW	Samsung SDS Co. Ltd.	13	0,13
968	KRW	Shinhan Financial Group Co. Ltd.	23	0,23
<b>Corea del Sud - Totale</b>			<b>780</b>	<b>7,80</b>
<b>Taiwan (31 marzo 2022: 17,62%)</b>				
4.000	TWD	Accton Technology Corp.	34	0,34
21.000	TWD	ASE Technology Holding Co. Ltd.	53	0,53
50.000	TWD	Cathay Financial Holding Co. Ltd.	63	0,63
1.000	TWD	Chroma ATE, Inc.	6	0,06
75.000	TWD	CTBC Financial Holding Co. Ltd.	47	0,47
10.000	TWD	Delta Electronics, Inc.	80	0,80
1.000	TWD	E Ink Holdings, Inc.	7	0,07
90.700	TWD	First Financial Holding Co. Ltd.	74	0,74
6.600	TWD	Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	21	0,21
2.000	TWD	Makalot Industrial Co. Ltd.	12	0,11
4.000	TWD	MediaTek, Inc.	69	0,69
9.000	TWD	Pegatron Corp.	17	0,17
9.000	TWD	Primax Electronics Ltd.	18	0,18
6.000	TWD	Realtek Semiconductor Corp.	51	0,51
6.000	TWD	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd. (The)	9	0,09
45.000	TWD	Taiwan Cooperative Financial Holding Co. Ltd.	37	0,37
37.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	492	4,92
829	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ADR	57	0,57
1.000	TWD	Uni-President Enterprises Corp.	2	0,02
18.000	TWD	United Microelectronics Corp.	20	0,20
992	USD	United Microelectronics Corp. ADR	6	0,06
1.000	TWD	Voltronic Power Technology Corp.	44	0,44
<b>Taiwan - Totale</b>			<b>1.219</b>	<b>12,18</b>
<b>Tailandia (31 marzo 2022: 2,60%)</b>				
91.300	THB	Bangkok Dusit Medical Services PCL NVDR	71	0,71
1.200	THB	Bumrungrad Hospital PCL NVDR	7	0,07
1.400	THB	Delta Electronics Thailand PCL NVDR	24	0,24
9.600	THB	Energy Absolute PCL NVDR	23	0,23
189.500	THB	Home Product Center PCL NVDR	68	0,68
<b>Tailandia - Totale</b>			<b>193</b>	<b>1,93</b>

# BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto	
<b>Azioni (continua)</b>					
<b>Turchia (31 marzo 2022: 0,26%)</b>					
4.075	TRY	Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii A/S	9	0,09	
1.334	TRY	BIM Birlesik Magazalar A/S	8	0,08	
2.167	TRY	Turk Hava Yollari AO	8	0,08	
		<b>Turchia - Totale</b>	<b>25</b>	<b>0,25</b>	
<b>Emirati Arabi Uniti (31 marzo 2022: 1,59%)</b>					
7.723	AED	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	19	0,19	
3.352	AED	Abu Dhabi Islamic Bank PJSC	8	0,08	
10.713	AED	Aldar Properties PJSC, REIT	12	0,12	
6.719	AED	Dubai Investments PJSC	4	0,04	
8.627	AED	Dubai Islamic Bank PJSC	14	0,14	
3.799	AED	Emaar Development PJSC, REIT	5	0,05	
3.685	AED	Emirates NBD Bank PJSC	13	0,13	
8.155	AED	Emirates Telecommunications Group Co. PJSC	52	0,52	
1.661	AED	First Abu Dhabi Bank PJSC	8	0,08	
		<b>Emirati Arabi Uniti - Totale</b>	<b>135</b>	<b>1,35</b>	
<b>Regno Unito (31 marzo 2022: 0,19%)</b>					
14.727	GBP	Hochschild Mining plc	10	0,10	
		<b>Regno Unito - Totale</b>	<b>10</b>	<b>0,10</b>	
<b>Stati Uniti (31 marzo 2022: 0,34%)</b>					
490	USD	Southern Copper Corp.	22	0,22	
685	USD	Yum China Holdings, Inc.	32	0,32	
		<b>Stati Uniti - Totale</b>	<b>54</b>	<b>0,54</b>	
<b>Totale investimenti in azioni</b>			<b>6.746</b>	<b>67,42</b>	
Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto	
<b>OBBLIGAZIONI</b>					
<b>Titoli di Stato (31 marzo 2022: 0,00%)</b>					
<b>Stati Uniti (31 marzo 2022: 0,00%)</b>					
1.200.000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 25/10/2022	1.198	11,97	
		<b>Stati Uniti - Totale</b>	<b>1.198</b>	<b>11,97</b>	
<b>Totale investimenti in titoli di Stato</b>			<b>1.198</b>	<b>11,97</b>	
<b>Totale investimenti in obbligazioni</b>			<b>1.198</b>	<b>11,97</b>	
Partecipazione	Valuta	Controparte	Descrizione	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti per differenze</b>					
<b>Brasile (31 marzo 2022: 0,68%)</b>					
4.092	USD	Merrill Lynch	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao <sup>4</sup>	-	-
6.376	USD	HSBC	Cielo SA <sup>4</sup>	-	-
724	USD	HSBC	Gerdau SA <sup>4</sup>	-	-
6.276	USD	Merrill Lynch	Itau Unibanco Holding SA	1	0,01
1.518	USD	HSBC	Itau Unibanco Holding SA <sup>4</sup>	-	-

# BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Controparte	Descrizione	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto	
<b>Contratti per differenze (continua)</b>						
<b>Brasile (continua)</b>						
1.056	USD	HSBC	M Dias Branco SA <sup>4</sup>	–	–	
1.108	USD	Merrill Lynch	WEG SA <sup>4</sup>	–	–	
<b>Brasile - Totale</b>				<b>1</b>	<b>0,01</b>	
<b>Totale utili non realizzati su contratti per differenze (31 marzo 2022: 0,68%)</b>				<b>1</b>	<b>0,01</b>	
<b>Brasile (31 marzo 2022: 0,00%)<sup>3</sup></b>						
13.269	USD	HSBC	Ambev SA	(1)	(0,01)	
9.127	USD	HSBC	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	(1)	(0,01)	
1.517	USD	Merrill Lynch	Banco Bradesco SA <sup>4</sup>	–	–	
7.193	USD	HSBC	Banco Bradesco SA	(1)	(0,01)	
1.763	USD	HSBC	Banco do Brasil SA	(2)	(0,02)	
1.212	USD	HSBC	Centrais Eletricas Brasileiras SA	(1)	(0,01)	
4.488	USD	HSBC	Cia Energetica de Minas Gerais	(1)	(0,01)	
18.197	USD	Merrill Lynch	Cia Energetica de Minas Gerais	(4)	(0,04)	
3.114	USD	Merrill Lynch	Cia Paranaense de Energia <sup>4</sup>	–	–	
10.057	USD	HSBC	Cia Paranaense de Energia	(1)	(0,01)	
3.546	USD	Merrill Lynch	Cielo SA <sup>4</sup>	–	–	
1.249	USD	Merrill Lynch	CPFL Energia SA <sup>4</sup>	–	–	
6.540	USD	HSBC	CPFL Energia SA	(4)	(0,04)	
4.160	USD	Merrill Lynch	Dexco SA	(1)	(0,01)	
3.177	USD	HSBC	Energisa SA	(2)	(0,02)	
160	USD	HSBC	Klabin SA <sup>4</sup>	–	–	
1.825	USD	Merrill Lynch	Klabin SA <sup>4</sup>	–	–	
1.803	USD	Merrill Lynch	Lojas Renner SA	(1)	(0,01)	
1.876	USD	HSBC	Natura & Co. Holding SA <sup>4</sup>	–	–	
1.255	USD	Merrill Lynch	Natura & Co. Holding SA	(1)	(0,01)	
2.658	USD	Merrill Lynch	Raia Drogasil SA <sup>4</sup>	–	–	
3.440	USD	HSBC	Raia Drogasil SA <sup>4</sup>	–	–	
<b>Brasile - Totale</b>				<b>(21)</b>	<b>(0,21)</b>	
<b>Totale perdite non realizzate su contratti per differenze (31 marzo 2022: 0,00%)<sup>3</sup></b>				<b>(21)</b>	<b>(0,21)</b>	
Numero di contratti	Valuta	Importo	Descrizione	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti future</b>						
<b>Regno Unito (31 marzo 2022: 0,40%)</b>						
–						
<b>Stati Uniti (31 marzo 2022: 0,07%)</b>						
–						
<b>Totale utili non realizzati su contratti future (31 marzo 2022: 0,47%)</b>				<b>–</b>	<b>–</b>	
<b>Regno Unito (31 marzo 2022: 0,00%)</b>						
11	USD	1.100	MSCI India Index	16/12/2022	(91)	(0,91)
<b>Regno Unito - Totale</b>				<b>(91)</b>	<b>(0,91)</b>	
<b>Stati Uniti (31 marzo 2022: 0,00%)</b>						
4	USD	200	MSCI Emerging Markets Index	16/12/2022	(5)	(0,05)
<b>Stati Uniti - Totale</b>				<b>(5)</b>	<b>(0,05)</b>	
<b>Totale perdite non realizzate su contratti future (31 marzo 2022: 0,00%)</b>				<b>(96)</b>	<b>(0,96)</b>	

# BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

	Valore equo Migliaia di USD	% del valore patrimoniale netto
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico	7.945	79,40
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico	(117)	(1,17)
Liquidità, liquidità a margine e garanzia liquida	1.620	16,19
Altre attività e passività	558	5,58
<b>Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>	<b>10.006</b>	<b>100,00</b>

	% del totale attività
<b>Analisi del totale attività</b>	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	27,46
Valori mobiliari negoziati su un altro mercato regolamentato	6,66
Strumenti finanziari derivati OTC*	–
Altre attività	65,88
<b>Totale attività</b>	<b>100,00</b>

<sup>1</sup>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.

<sup>2</sup>Titolo parzialmente o completamente in prestito.

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

<sup>4</sup>Gli investimenti inferiori a USD 500 sono stati arrotondati a zero.

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

	Sui guadagni Migliaia di USD	Sulle perdite Migliaia di USD
<b>Valore dell'esposizione</b>		
Contratti per differenze	75	310
Contratti future	–	1.185

# FR MULTI-ASSET FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO</b>				
<b>Organismi di investimento collettivo</b>				
<b>Irlanda</b>				
24.230	EUR	BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating <sup>1</sup>	2.289	4,18
19.462	USD	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating <sup>1</sup>	2.294	4,19
38.649	USD	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating <sup>1</sup>	5.467	9,98
41.122	EUR	BlackRock Sustainable Equity Factor Plus Fund - Classe X EUR Accumulating <sup>1</sup>	3.926	7,17
142.483	EUR	iShares Green Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni Flexible EUR Hedged Accumulating <sup>1</sup>	1.284	2,34
<b>Irlanda - Totale</b>			<b>15.260</b>	<b>27,86</b>
<b>Lussemburgo</b>				
207.955	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	2.855	5,21
8.191	EUR	BlackRock Global Funds - European Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	1.395	2,54
117.365	EUR	BlackRock Global Funds - Global Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged <sup>1</sup>	1.502	2,74
137.303	EUR	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe di Azioni X2 EUR Hedged <sup>1</sup>	1.024	1,87
100.898	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund Classe X2 USD <sup>1</sup>	876	1,60
106.641	EUR	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	1.034	1,89
10.949	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Class X2 EUR <sup>1</sup>	1.186	2,16
5.133	USD	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Class X2 USD <sup>1</sup>	791	1,44
25.143	USD	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Real Asset Securities Fund - Classe X2 USD <sup>1</sup>	2.779	5,07
8.643	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	765	1,40
8.877	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR <sup>1</sup>	1.181	2,16
<b>Lussemburgo - Totale</b>			<b>15.388</b>	<b>28,08</b>
<b>Totale investimenti in organismi di investimento collettivo</b>			<b>30.648</b>	<b>55,94</b>
<b>Totale investimenti in organismi di investimento collettivo</b>			<b>30.648</b>	<b>55,94</b>

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>ETF</b>				
<b>Irlanda</b>				
186.044	EUR	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) <sup>1</sup>	761	1,39
200.206	EUR	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) <sup>1</sup>	1.007	1,84
678.185	EUR	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) <sup>1</sup>	2.506	4,57
210.644	EUR	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist) <sup>1</sup>	914	1,67
5.484	EUR	iShares € Govt Bond 15-30yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) <sup>1</sup>	1.010	1,84
58.280	EUR	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist) <sup>1</sup>	237	0,43
1.779	EUR	iShares € Inflation Linked Govt Bond UCITS ETF - EUR (Acc) Share Class <sup>1</sup>	379	0,69
237.738	EUR	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) <sup>1</sup>	1.225	2,24



# FR MULTI-ASSET FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Partecipazione	Valuta	Investimenti	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>ETF (continua)</b>				
<b>Irlanda (continua)</b>				
3.446	EUR	iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist) <sup>1</sup>	502	0,92
195.632	EUR	iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	1.417	2,59
720.699	EUR	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) <sup>1</sup>	3.079	5,62
259.923	EUR	iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc) <sup>1</sup>	1.415	2,58
202.903	EUR	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	1.003	1,83
816.859	EUR	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	5.497	10,03
306.376	EUR	iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc) <sup>1</sup>	1.271	2,32
301.760	EUR	iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc) <sup>1</sup>	1.287	2,35
<b>Irlanda - Totale</b>			<b>23.510</b>	<b>42,91</b>
<b>Totale investimenti in ETF</b>			<b>23.510</b>	<b>42,91</b>

Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti di cambio a termine<sup>2</sup></b>				
Buy EUR 318,093; Sell AUD 476,032	HSBC	05/10/2022	6	0,01
Buy EUR 318,297; Sell AUD 476,032	Westpac Banking	12/01/2023	8	0,01
Buy EUR 671,159; Sell GBP 570,371	HSBC	05/10/2022	21	0,04
Buy EUR 885,257; Sell JPY 122,761,958	HSBC	05/10/2022	19	0,04
Buy EUR 69,082; Sell JPY 9,409,806	Barclays	05/10/2022	3	0,01
Buy EUR 201,723; Sell JPY 28,300,000	J.P. Morgan	05/10/2022	2	—
Buy EUR 1,157,569; Sell JPY 160,471,764	BNP Paribas	12/01/2023	21	0,04
Buy EUR 2,260,932; Sell USD 2,200,000	Toronto-Dominion Bank	12/01/2023	34	0,06
Buy EUR 2,258,692; Sell USD 2,200,000	Morgan Stanley	12/01/2023	31	0,06
Buy EUR 2,258,103; Sell USD 2,200,000	NatWest Markets	12/01/2023	31	0,06
Buy EUR 2,257,119; Sell USD 2,200,000	BNP Paribas	12/01/2023	30	0,06
Buy EUR 2,250,242; Sell USD 2,194,200	HSBC	12/01/2023	29	0,05
Buy GBP 570,371; Sell EUR 640,336	HSBC	05/10/2022	10	0,02
Buy USD 207,827; Sell EUR 200,161	BNP Paribas	05/10/2022	12	0,02
<b>Totale utili non realizzati</b>			<b>257</b>	<b>0,48</b>

### Istituzionale ad accumulazione coperta in SEK

Buy EUR 111; Sell SEK 1,198 <sup>3</sup>	J.P. Morgan	14/10/2022	—	—
<b>Totale utili non realizzati</b>			<b>—</b>	<b>—</b>

### Istituzionale ad accumulazione coperta in USD

Buy EUR 282,765,887; Sell USD 269,565,527	J.P. Morgan	03/10/2022	7.601	13,87
Buy EUR 1,126,257; Sell USD 1,086,911	J.P. Morgan	14/10/2022	17	0,03

# FR MULTI-ASSET FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Descrizione	Controparte	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto		
<b>Contratti di cambio a termine<sup>2</sup>(continua)</b>						
<b>Istituzionale ad accumulazione in USD (continua)</b>						
Buy USD 54,565,837; Sell EUR 53,732,879	J.P. Morgan	14/10/2022	1.928	3,52		
<b>Totale utili non realizzati</b>			<b>9.546</b>	<b>17,42</b>		
<b>Totale utili non realizzati su contratti di cambio a termine</b>			<b>9.803</b>	<b>17,90</b>		
<b>Contratti di cambio a termine<sup>2</sup></b>						
Buy AUD 476,032; Sell EUR 320,270	Westpac Banking	05/10/2022	(8)	(0,01)		
Buy EUR 635,421; Sell GBP 570,371	HSBC	12/01/2023	(10)	(0,02)		
Buy EUR 2,108,695; Sell USD 2,145,000	HSBC	05/10/2022	(81)	(0,15)		
Buy EUR 2,108,666; Sell USD 2,145,000	Morgan Stanley	05/10/2022	(81)	(0,15)		
Buy EUR 2,108,556; Sell USD 2,145,000	J.P. Morgan	05/10/2022	(81)	(0,15)		
Buy EUR 2,120,905; Sell USD 2,157,386	Bank of America	05/10/2022	(81)	(0,15)		
Buy EUR 2,561,709; Sell USD 2,609,640	Barclays	05/10/2022	(102)	(0,18)		
Buy JPY 160,471,764; Sell EUR 1,153,085	BNP Paribas	05/10/2022	(21)	(0,04)		
Buy USD 2,194,200; Sell EUR 2,269,080	HSBC	05/10/2022	(29)	(0,05)		
Buy USD 2,200,000; Sell EUR 2,275,915	BNP Paribas	05/10/2022	(30)	(0,06)		
Buy USD 2,200,000; Sell EUR 2,277,093	NatWest Markets	05/10/2022	(32)	(0,06)		
Buy USD 2,200,000; Sell EUR 2,277,574	Morgan Stanley	05/10/2022	(32)	(0,06)		
Buy USD 2,200,000; Sell EUR 2,279,793	Toronto-Dominion Bank	05/10/2022	(34)	(0,06)		
<b>Totale perdite non realizzate</b>			<b>(622)</b>	<b>(1,14)</b>		
<b>Istituzionale ad accumulazione coperta in SEK</b>						
Buy EUR 109; Sell SEK 1,195 <sup>3</sup>	J.P. Morgan	14/10/2022	-	-		
Buy SEK 53,377; Sell EUR 5,017 <sup>3</sup>	J.P. Morgan	14/10/2022	-	-		
<b>Totale perdite non realizzate</b>			<b>-</b>	<b>-</b>		
<b>Istituzionale ad accumulazione coperta in USD</b>						
Buy EUR 53,732,879; Sell USD 54,565,837	J.P. Morgan	14/10/2022	(1.928)	(3,52)		
Buy USD 269,565,527; Sell EUR 279,966,274	J.P. Morgan	03/10/2022	(4.801)	(8,76)		
Buy USD 52,104,034; Sell EUR 54,071,212	J.P. Morgan	14/10/2022	(922)	(1,68)		
<b>Totale perdite non realizzate</b>			<b>(7.651)</b>	<b>(13,96)</b>		
<b>Totale perdite non realizzate su contratti di cambio a termine</b>			<b>(8.273)</b>	<b>(15,10)</b>		
Numero di contratti	Valuta	Importo	Descrizione	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti future</b>						
<b>Germania</b>						
(29)	EUR	(2.900.000)	Euro-Bobl	08/12/2022	99	0,18
<b>Germania - Totale</b>					<b>99</b>	<b>0,18</b>
<b>Giappone</b>						
(1)	JPY	(100.000.000)	Japan 10 Year Bond	13/12/2022	2	0,01
<b>Giappone - Totale</b>					<b>2</b>	<b>0,01</b>

# FR MULTI-ASSET FUND

## PROSPETTO DEGLI INVESTIMENTI (continua)

Al 30 settembre 2022

Numero di contratti	Valuta	Importo	Descrizione	Data di scadenza	Valore equo Migliaia di EUR	% del valore patrimoniale netto
<b>Contratti future (continua)</b>						
<b>Stati Uniti</b>						
(3)	USD	(300.000)	US Ultra Bond	20/12/2022	33	0,06
<b>Stati Uniti - Totale</b>					<b>33</b>	<b>0,06</b>
<b>Totale utili non realizzati su contratti futures</b>					<b>134</b>	<b>0,25</b>
<b>Germania</b>						
37	EUR	3.700.000	Euro-Schatz	08/12/2022	(41)	(0,08)
<b>Germania - Totale</b>					<b>(41)</b>	<b>(0,08)</b>
<b>Giappone</b>						
8	JPY	80.000	TOPIX Index	08/12/2022	(44)	(0,08)
<b>Giappone - Totale</b>					<b>(44)</b>	<b>(0,08)</b>
<b>Totale perdite non realizzate su contratti futures</b>					<b>(85)</b>	<b>(0,16)</b>
					<b>Valore equo Migliaia di EUR</b>	<b>% del valore patrimoniale netto</b>
Attività finanziarie totali al valore equo in conto economico					64.095	117,00
Totale passività finanziarie totali al valore equo in conto economico					(8.358)	(15,26)
Liquidità e liquidità a margine					1.272	2,32
Altre attività e passività					(2.224)	(4,06)
<b>Valore patrimoniale netto attribuibile ai sottoscrittori di quote rimborsabili</b>					<b>54.785</b>	<b>100,00</b>

Analisi del totale attività	% del totale attività
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa valori ufficiale	34,17
Organismi di investimento collettivo	44,55
Strumenti finanziari derivati negoziati in un mercato regolamentato	0,20
Strumenti finanziari derivati OTC	14,25
Altre attività	6,83
<b>Totale attività</b>	<b>100,00</b>

<sup>1</sup>Una parte correlata al Fondo.

<sup>2</sup>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.

<sup>3</sup>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	347.597	408.807
Contratti future	4.920	4.994

# BLACKROCK CANGRANDE GLOBAL INDEX EQUITY FUND

## PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2022

<b>Acquisti</b>		<b>Costo</b>
<b>Quantità</b>	<b>Investimenti</b>	<b>(migliaia di EUR)</b>
248.684	iShares Developed World ESG Screened Index Fund (IE) - Classe di Azioni US Dollar Flexible Accumulating	4.403
591.310	iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	4.371
668.731	iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	4.353
10.573	iShares Core S&P 500 UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	4.161
173.363	iShares Emerging Markets Index Fund (IE) - Classe di Azioni Euro Flexible Accumulating	3.069
333.145	iShares MSCI Europe ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc)	2.062
172.941	iShares MSCI Japan ESG Screened UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	847
7.338	iShares Pacific Index Fund (IE) - Classe di Azioni US Dollar Flexible Accumulating	427
2.541	iShares MSCI Canada UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	403
<b>Vendite</b>		<b>Ricavi</b>
<b>Quantità</b>	<b>Investimenti</b>	<b>(migliaia di EUR)</b>
5.629	iShares Emerging Markets Index Fund (IE) - Classe di Azioni Euro Flexible Accumulating	100
5.096	iShares Developed World ESG Screened Index Fund (IE) - Classe di Azioni US Dollar Flexible Accumulating	90

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 2022

Acquisti		Costo (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
251.608	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Agency (Acc T0) Shares	24.713
500.000	HSBC Holdings plc, FRN, 3.02%, 15/06/2027	499
500.000	Diageo Capital BV, 1.88%, 08/06/2034	477
450.000	Morgan Stanley, FRN, 2.95%, 07/05/2032	442
425.000	Bank of America Corp., FRN, 2.82%, 27/04/2033	414
400.000	UBS Group AG, FRN, 3.12%, 15/06/2030	396
400.000	BNP Paribas SA, 3.63%, 01/09/2029	395
400.000	Citigroup, Inc., FRN, 4.11%, 22/09/2033	384
400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.00%, 23/05/2025	383
350.000	Nordea Bank Abp, 2.50%, 23/05/2029	344
340.000	Royal Bank of Canada, 2.13%, 26/04/2029	333
300.000	Assicurazioni Generali SpA, FRN, 4.60%, 21/11/2025	309
300.000	Coloplast Finance BV, 2.75%, 19/05/2030	303
300.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.25%, 10/03/2025	301
300.000	Allianz SE, FRN, 4.60%, 07/09/2038	300
300.000	Intesa Sanpaolo SpA, 4.75%, 06/09/2027	300
300.000	Credit Suisse AG, 2.13%, 31/05/2024	300
300.000	ING Groep NV, FRN, 2.13%, 23/05/2026	300
300.000	Bank of America Corp., FRN, 1.95%, 27/10/2026	300
300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 3.88%, 16/06/2032	300

  

Vendite		Ricavi (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
257.159	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Agency (Acc T0) Shares	25.257
445.000	Intesa Sanpaolo SpA, 2.13%, 30/08/2023	441
400.000	HSBC Continental Europe SA, 0.60%, 20/03/2023	400
400.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.38%, 06/09/2023	392
380.000	Credit Suisse Group AG, FRN, 3.25%, 02/04/2026	379
350.000	ABN AMRO Bank NV, 0.50%, 17/07/2023	347
350.000	Credit Suisse Group AG, FRN, 2.13%, 13/10/2026	334
300.000	Engie Alliance GIE, 5.75%, 24/06/2023	313
300.000	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.63%, 27/02/2023	302
300.000	Deutsche Telekom International Finance BV, 0.63%, 03/04/2023	301
300.000	Credit Suisse AG, 1.00%, 07/06/2023	300
300.000	Medtronic Global Holdings SCA, 0.00%, 15/03/2023	300
300.000	Fidelity National Information Services, Inc., 0.75%, 21/05/2023	300
300.000	Credit Suisse AG, 2.13%, 31/05/2024	299
300.000	Bank of America Corp., 0.75%, 26/07/2023	299
300.000	Nordea Bank Abp, 0.88%, 26/06/2023	298
300.000	Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN, 0.01%, 30/04/2024	298
300.000	Toronto-Dominion Bank (The), 0.63%, 20/07/2023	298
300.000	Cooperatieve Rabobank UA, 0.75%, 29/08/2023	294
300.000	BPCE SA, 0.63%, 26/09/2023	294

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 DIVERSIFIED STRATEGIES SELECTION FUND

## PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2022

Acquisti		Costo (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
1.897	BlackRock Strategic Funds - BlackRock UK Equity Absolute Return Fund - Classe X2 GBP	274
313	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund - Classe X2 USD	36
Vendite		Ricavi (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
8.083	BlackRock Strategic Funds - BlackRock UK Equity Absolute Return Fund - Classe X2 GBP	1.208
9.563	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Classe X2 EUR	1.016
8.058	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	863
5.949	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR	817
69.788	BlackRock Global Funds - Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe XX2 Hedged EUR	802
4.882	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Classe X2 USD	740
	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund - Classe X2 USD	629
5.118		
5.104	BlackRock Strategic Funds - Global Equity Absolute Return Fund - Classe X2 USD	523
21.047	BlackRock Global Funds - Global Multi-Asset Income Fund - Classe X2 USD	351
2.702	BlackRock Strategic Funds - Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund - Classe X2 USD	327

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 2022

Acquisti		Costo (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
15.990	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Agency (Acc T0) Shares	1.570
470.000	Bundesschatzanweisungen, 0.20%, 14/06/2024	458
440.000	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/02/2028	430
390.000	France Government Bond OAT, 2.25%, 25/05/2024	403
370.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.00%, 15/08/2025	368
390.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/05/2032	321
310.000	Spain Government Bond, 2.55%, 31/10/2032	317
290.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.70%, 15/08/2032	307
270.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.00%, 15/08/2024	262
260.000	Bundesobligation, 1.30%, 15/10/2027	252
230.000	France Government Bond OAT, 2.00%, 25/11/2032	235
250.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/02/2032	225
200.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.50%, 01/12/2032	184
130.000	France Government Bond OAT, 5.75%, 25/10/2032	181
170.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.35%, 01/03/2035	172
170.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.10%, 15/07/2026	169
180.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.45%, 15/02/2029	157
160.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2031	145
130.000	France Government Bond OAT, 2.75%, 25/10/2027	143
130.000	Lithuania Government Bond, 3.38%, 22/01/2024	137
130.000	Spain Government Bond, 3.80%, 30/04/2024	135
150.000	Belgium Government Bond, 0.35%, 22/06/2032	129
130.000	Spain Government Bond, 0.25%, 30/07/2024	128
130.000	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2028	123
120.000	Spain Government Bond, 1.40%, 30/07/2028	120
120.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/08/2028	118
110.000	Spain Government Bond, 1.95%, 30/04/2026	113
110.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.65%, 01/12/2027	111
110.000	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2025	110
110.000	Austria Government Bond, 0.00%, 15/07/2024	109
110.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.50%, 15/08/2027	109
110.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2025	106
Vendite		Ricavi (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
17.998	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Agency (Acc T0) Shares	1.768
1.140.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.75%, 01/08/2023	1.178
956.000	France Government Bond OAT, 1.75%, 25/05/2023	971
920.000	Bundesschatzanweisungen, 0.00%, 15/09/2023	909
600.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.00%, 15/08/2023	611
500.000	Bundesobligation, 0.00%, 14/04/2023	501
500.000	Spain Government Bond, 0.00%, 30/04/2023	500
470.000	Spain Government Bond, 0.35%, 30/07/2023	469
430.000	France Government Bond OAT, 4.25%, 25/10/2023	455
405.000	Netherlands Government Bond, 1.75%, 15/07/2023	410
360.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.50%, 01/05/2023	375
364.000	Belgium Government Bond, 2.25%, 22/06/2023	370
297.000	Austria Government Bond, 0.00%, 15/07/2023	296
210.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.65%, 15/10/2023	210
190.000	Spain Government Bond, 1.95%, 30/04/2026	193
190.000	France Government Bond OAT, 1.00%, 25/11/2025	188
180.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.00%, 15/08/2025	183
155.000	Finland Government Bond, 1.50%, 15/04/2023	157
140.000	France Government Bond OAT, 3.50%, 25/04/2026	154
150.000	Bundesobligation, 0.00%, 10/10/2025	143

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 2022

Acquisti		Costo (migliaia di GBP)
Quantità	Investimenti	
138.526	BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Agency (Dis) Shares	13.847
3.280.000	UK Treasury, 0.25%, 31/07/2031	2.533
750.000	Informa plc, FRN, 3.13%, 05/07/2026	725
650.000	Macquarie Group Ltd., 4.08%, 31/05/2029	650
600.000	CaixaBank SA, FRN, 3.50%, 06/04/2028	585
500.000	Telefonica Emisiones SA, 5.45%, 08/10/2029	556
500.000	Deutsche Bank AG, FRN, 4.00%, 24/06/2026	488
500.000	Credit Suisse Group AG, FRN, 7.00%, 30/09/2027	475
500.000	Credit Suisse Group AG, FRN, 7.38%, 07/09/2033	468
500.000	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.50%, 07/12/2027	445
400.000	Kraft Heinz Foods Co., 4.13%, 01/07/2027	414
400.000	Citigroup, Inc., 4.50%, 03/03/2031	409
400.000	Diageo Finance plc, 2.75%, 08/06/2038	398
400.000	Diageo Finance plc, 2.38%, 08/06/2028	398
400.000	GSK Consumer Healthcare Capital UK plc, 2.88%, 29/10/2028	396
350.000	APA Infrastructure Ltd., 3.13%, 18/07/2031	327
250.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co., FRN, 5.13%, 23/11/2052	248
225.000	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 4.62%, 23/08/2032	225
225.000	Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN, 3.63%, 29/10/2029	224
200.000	Annington Funding plc, REIT, 4.75%, 09/08/2033	200

  

Vendite		Ricavi (migliaia di GBP)
Quantità	Investimenti	
124.596	BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Agency (Dis) Shares	12.456
2.675.000	UK Treasury, 0.25%, 31/07/2031	2.009
1.400.000	Morgan Stanley, 2.63%, 09/03/2027	1.354
1.200.000	Societe Generale SA, 1.25%, 07/12/2027	1.063
1.089.000	BMW International Investment BV, 1.38%, 01/10/2024	1.052
833.000	GE Capital UK Funding Unlimited Co., 5.88%, 18/01/2033	991
1.000.000	Northumbrian Water Finance plc, 1.63%, 11/10/2026	956
950.000	Tesco Corporate Treasury Services plc, 1.88%, 02/11/2028	829
800.000	AP Moller - Maersk A/S, 0.00%, 04/04/2025	806
800.000	JPMorgan Chase & Co., FRN, 0.99%, 28/04/2026	747
700.000	Digital Stout Holding LLC, REIT, 4.25%, 17/01/2025	695
675.000	Investec Bank plc, FRN, 4.25%, 24/07/2028	670
650.000	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 3.13%, 25/07/2029	628
500.000	Heathrow Funding Ltd., 6.45%, 10/12/2033	605
725.000	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.63%, 12/05/2035	603
500.000	Electricite de France SA, 5.50%, 17/10/2041	602
625.000	Procter & Gamble Co. (The), 1.80%, 03/05/2029	594
450.000	Veolia Environnement SA, 6.13%, 29/10/2037	593
500.000	Walmart, Inc., 5.25%, 28/09/2035	578
550.000	Heathrow Funding Ltd., 5.23%, 15/02/2023	560

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 2022

Acquisti		Costo (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
160.990	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0)	15.812
600.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 3.75%, 09/05/2027	561
400.000	Aareal Bank AG, 4.50%, 25/07/2025	399
400.000	EC Finance plc, 3.00%, 15/10/2026	365
400.000	ZF Finance GmbH, 2.75%, 25/05/2027	352
350.000	Getlink SE, 3.50%, 30/10/2025	343
325.000	HSBC Holdings plc, FRN, 3.02%, 15/06/2027	325
300.000	Prologis LP, REIT, 3.00%, 02/06/2026	312
300.000	ORIX Corp., 1.92%, 20/04/2026	300
300.000	UBS Group AG, FRN, 2.75%, 15/06/2027	300
300.000	Volvo Car AB, 2.13%, 02/04/2024	296
300.000	RELX Finance BV, 1.50%, 13/05/2027	296
300.000	APA Infrastructure Ltd., 2.00%, 22/03/2027	294
300.000	Hornbach Baumarkt AG, 3.25%, 25/10/2026	285
250.000	BPER Banca, FRN, 3.38%, 30/06/2025	250
225.000	National Grid plc, 2.18%, 30/06/2026	225
225.000	Alcon Finance BV, 2.38%, 31/05/2028	224
200.000	Nokia OYJ, 2.38%, 15/05/2025	200
200.000	Unicaja Banco SA, FRN, 4.50%, 30/06/2025	200
200.000	ING Groep NV, FRN, 2.13%, 23/05/2026	200

  

Vendite		Ricavi (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
168.525	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0)	16.550
700.000	Glencore Finance Europe Ltd., 1.75%, 17/03/2025	658
500.000	iliad SA, 0.75%, 11/02/2024	470
500.000	Viterra Finance BV, 0.38%, 24/09/2025	454
300.000	Levi Strauss & Co., 3.38%, 15/03/2027	289
300.000	KION Group AG, 1.63%, 24/09/2025	284
225.000	Credit Suisse Group AG, FRN, 3.25%, 02/04/2026	225
225.000	Quatrim SASU, 5.88%, 15/01/2024	217
200.000	Suez SA, FRN, 2.87%, 19/01/2024	194
200.000	Belden, Inc., 3.38%, 15/07/2027	184
200.000	Castellum Helsinki Finance Holding Abp, REIT, 2.00%, 24/03/2025	180
200.000	Ball Corp., 1.50%, 15/03/2027	179
200.000	Faurecia SE, 2.75%, 15/02/2027	173
175.000	Almaviva-The Italian Innovation Co. SpA, 4.88%, 30/10/2026	166
175.000	Telecom Italia SpA, 2.75%, 15/04/2025	163
275.000	Castellum AB, REIT, 3.12%, 12/02/2026	150
150.000	Lincoln Financing SARL, 3.63%, 01/04/2024	148
175.000	Wizz Air Finance Co. BV, 1.00%, 19/01/2026	142
125.000	Avantor Funding, Inc., 3.88%, 15/07/2028	118
200.000	ADLER Group SA, REIT, 2.25%, 27/04/2027	113

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 2022

Acquisti		Costo (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
1.404.000	US Treasury, 0.13%, 31/07/2023	1.277
7.800.000	China Government Bond, 2.68%, 21/05/2030	1.116
7.100.000	China Government Bond, 2.69%, 12/08/2026	1.047
805.000	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2025	797
4.700.000	China Government Bond, 3.72%, 12/04/2051	741
4.600.000	China Government Bond, 2.18%, 25/06/2024	673
824.000	Canada Government Bond, 0.50%, 01/11/2023	597
590.000	France Government Bond OAT, 1.00%, 25/05/2027	585
827.000	Australia Government Bond, 2.75%, 21/04/2024	563
551.000	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2029	518
501.000	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2028	492
443.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2024	441
420.000	US Treasury, 3.00%, 15/07/2025	413
420.000	US Treasury, 3.00%, 30/06/2024	412
420.000	US Treasury, 2.88%, 15/06/2025	411
440.000	US Treasury, 1.88%, 28/02/2029	410
410.000	US Treasury, 2.88%, 15/05/2032	410
510.000	US Treasury, 1.88%, 15/02/2041	409
430.000	US Treasury, 0.25%, 30/09/2023	408
430.000	US Treasury, 0.88%, 31/01/2024	408
420.000	US Treasury, 2.50%, 31/03/2027	407
400.000	US Treasury, 3.25%, 30/06/2029	406
460.000	US Treasury, 1.38%, 15/11/2031	405
440.000	US Treasury, 1.88%, 15/02/2032	404
409.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2026	397
406.000	Belgium Government Bond, 0.80%, 22/06/2028	395
545.270.000	Korea Government Bond, 2.13%, 10/03/2024	393
626.000	New Zealand Government Bond, 0.50%, 15/05/2024	364
394.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/05/2032	334
430.000	Canada Government Bond, 2.25%, 01/06/2029	321
991.000	Israel Government Bond, 2.00%, 31/03/2027	278
Vendite		Ricavi (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
1.460.000	US Treasury, 1.75%, 31/12/2024	1.372
1.404.000	US Treasury, 0.13%, 31/07/2023	1.332
1.578.000	Australia Government Bond, 5.50%, 21/04/2023	1.098
735.000	France Government Bond OAT, 1.00%, 25/05/2027	742
905.000	Canada Government Bond, 2.25%, 01/03/2024	682
690.000	Canada Government Bond, 8.00%, 01/06/2027	653
670.000	US Treasury, 2.88%, 30/11/2023	645
856.980.000	Korea Treasury Bond, 2.38%, 10/03/2023	643
640.000	Canada Government Bond, 5.75%, 01/06/2033	629
730.000	Canada Government Bond, 1.50%, 01/09/2024	543
555.000	US Treasury, 2.00%, 30/04/2024	534
520.000	US Treasury, 2.75%, 15/02/2024	507
670.000	Canada Government Bond, 0.50%, 01/11/2023	495
370.000	US Treasury, 4.50%, 15/02/2036	434
541.000	Canada Government Bond, 8.00%, 01/06/2023	428
409.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2026	394
530.000	Canada Government Bond, 0.25%, 01/02/2023	391
380.000	US Treasury, 2.88%, 15/06/2025	372
2.144.400.000	Colombian TES, 5.75%, 03/11/2027	368
403.000	US Treasury, 1.50%, 15/02/2030	359
360.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2025	354
565.000	New Zealand Government Bond, 5.50%, 15/04/2023	353
352.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/03/2024	351
440.000	Canada Government Bond, 2.75%, 01/12/2064	337
334.000	Ireland Government Bond, 0.00%, 18/10/2022	334
359.000	US Treasury, 1.50%, 15/08/2026	333
365.000	US Treasury, 0.50%, 31/10/2027	316
310.000	US Treasury, 2.88%, 15/05/2032	301

# BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

## PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI (continua)

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2022

Vendite (continua)		Ricavi (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
2.000.000	China Government Bond, 3.19%, 11/04/2024	298

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 2022

<b>Acquisti</b>		<b>Costo</b>
<b>Quantità</b>	<b>Investimenti</b>	<b>(migliaia di EUR)</b>
28.451	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0)	2.795

  

<b>Vendite</b>		<b>Ricavi</b>
<b>Quantità</b>	<b>Investimenti</b>	<b>(migliaia di EUR)</b>
62.660	iShares J.P. Morgan \$ EM Corp Bond UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	5.366
37.258	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Azioni Agency (Acc T0)	3.661
234.661	iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni Flexible Euro Hedged Accumulating	1.951
14.916	BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe Z EUR Hedged Accumulating	1.400

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 2022

Acquisti		Costo (migliaia di USD)
Quantità	Investimenti	
166.700	Tencent Holdings Ltd.	7.254
19.800	Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'	5.458
68.200	Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. 'A'	4.457
1.072.000	Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	3.819
105.000	BYD Co. Ltd. 'H'	3.728
725.400	Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai 'A'	3.546
6.304.300	Bank Central Asia Tbk. PT	3.301
241.300	Eve Energy Co. Ltd. 'A'	3.295
63.871	Genpact Ltd.	2.879
66.500	BYD Co. Ltd. 'A'	2.820
116.400	Meituan 'B'	2.732
341.921	Hiwin Technologies Corp.	2.725
107.300	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co. Ltd. 'A'	2.631
29.756	Anglo American Platinum Ltd.	2.438
5.014.000	China Petroleum & Chemical Corp. 'H'	2.393
674.100	TBEA Co. Ltd. 'A'	2.377
330.500	SF Holding Co. Ltd. 'A'	2.329
374.000	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H'	2.223
23.161	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ADR	2.140
588.600	ZTE Corp. 'A'	2.061

  

Vendite		Ricavi (migliaia di USD)
Quantità	Investimenti	
19.800	Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'	5.263
75.263	HDFC Bank Ltd. ADR	4.432
84.200	BYD Co. Ltd. 'A'	3.845
8.465	LG Chem Ltd.	3.648
4.347.600	PetroChina Co. Ltd. 'A'	3.471
66.939	Genpact Ltd.	3.031
3.728.000	CTBC Financial Holding Co. Ltd.	2.967
32.432	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ADR	2.943
4.869.900	BOE Technology Group Co. Ltd. 'A'	2.814
151.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	2.730
107.300	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co. Ltd. 'A'	2.610
12.356	NAVER Corp.	2.515
382.014	Arca Continental SAB de CV	2.489
5.673	Samsung SDI Co. Ltd.	2.451
302.500	Wuxi Biologics Cayman, Inc.	2.346
341.500	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H'	2.318
73.000	Luzhou Laojiao Co. Ltd. 'A'	2.297
202.000	Advantech Co. Ltd.	2.284
2.407.800	PTT PCL NVDR	2.268
324.600	China Merchants Bank Co. Ltd. 'A'	2.233

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 CASH FUND

## PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2022

Vendite		Ricavi (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
49.241	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Azioni Agency (Acc)	4.920

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 FIXED INCOME SELECTION FUND

## PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2022

Acquisti		Costo (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
16.383	iShares Global Corp Bond EUR Hedged UCITS ETF (Dist)	1.499
13.421	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR	1.268
236.995	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	1.103
5.589	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	986
64.304	BlackRock Global Funds - ESG Multi-Asset Fund - Classe I2 EUR	878
94.599	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	425
90.294	iShares Global Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	417
80.243	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	369
19.288	BlackRock Global Funds - Global Inflation Linked Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged	319
870	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	93
621	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR	86
16.415	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	84
4.135	BlackRock Global Funds - Euro Short Duration Bond Fund - Classe X2 EUR	70
6.778	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR	68
309	BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	31
2.020	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund - Classe X2 USD	22
142	iShares Italy Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	21
87	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 EUR	8
Vendite		Ricavi (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
14.620	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	1.565
118.890	BlackRock Global Funds - US Dollar Bond Fund - Classe X2 USD	1.193
11.714	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR	1.150
7.007	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR	958
215.058	iShares Global Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	948
82.920	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD	936
67.937	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR	680
37.936	BlackRock Global Funds - Euro Short Duration Bond Fund - Classe X2 EUR	633
48.059	BlackRock Global Funds - Asian Tiger Bond Fund - Classe X2 Hedged EUR	455
41.443	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund - Classe X2 USD	443
60.164	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 EUR	368
27.290	BlackRock Global Funds - ESG Multi-Asset Fund - Classe I2 EUR	355
63.349	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	323
28.539	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD Hedged	278
2.754	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 EUR	275
2.666	BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	265
15.566	BlackRock Global Funds - Global Multi-Asset Income Fund - Classe X2 USD	257
44.280	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	188
947	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	172
1.793	iShares Global Corp Bond EUR Hedged UCITS ETF (Dist)	155

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 2022

Acquisti		Costo (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
27.054	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Classe X Accumulating EUR	3.451
400.129	iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF	2.664
106.239	BlackRock Global Funds - Global Long-Horizon Equity Fund - Classe X2 EUR	1.353
31.382	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR	575
2.164	BlackRock Global Funds - Systematic Global SmallCap Fund - Classe D2 EUR	278
1.325	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund - Classe X2 USD	250
1.774	BlackRock Global Funds - US Basic Value Fund - Classe X2 USD	215
3.749	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Classe X2 EUR	177
5.367	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD	122
11.819	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	74
3.991	BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund - Classe X2 USD	72
2.818	BlackRock Global Funds - Asian Growth Leaders Fund - Classe X2 USD	71
11.601	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF	62
3.653	BlackRock Global Funds - European Value Fund - Classe X2 EUR	45
170	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Classe X2 EUR	31
1.534	BlackRock Global Funds - European Special Situations Fund - Classe X2 EUR	28
3.072	BlackRock Global Funds - US Growth Fund - Classe X2 USD	27
538	iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	23
218	BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Classe X2 USD	16
759	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Classe X2 USD	14
Vendite		Ricavi (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
61.577	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Classe X2 EUR	3.092
104.908	BlackRock Global Funds - European Special Situations Fund - Classe X2 EUR	1.887
132.323	BlackRock Global Funds - European Value Fund - Classe X2 EUR	1.609
6.086	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Classe X2 EUR	1.146
139.721	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	916
69.289	BlackRock Global Funds - US Growth Fund - Classe X2 USD	626
18.666	BlackRock Global Funds - Asian Growth Leaders Fund - Classe X2 USD	474
13.950	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD	359
2.847	BlackRock Global Funds - US Basic Value Fund - Classe X2 USD	344
3.434	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Classe X2 USD	221
9.966	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Classe X2 USD	192
814	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund - Classe X2 USD	157
2.210	BlackRock Global Funds - Latin American Fund - Classe X2 USD	156
1.983	BlackRock Global Funds - Japan Small & MidCap Opportunities Fund Classe X2 JPY	155
8.264	BlackRock Global Funds - Emerging Europe Fund - Classe X2 EUR	131
9.091	BlackRock Global Funds - Global Long-Horizon Equity Fund - Classe X2 EUR	126
1.367	BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Classe X2 USD	108
2.765	iShares MSCI South Africa UCITS ETF	86
444	BlackRock Global Funds - Systematic Global SmallCap Fund - Classe D2 EUR	60
353	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Classe X Accumulating EUR	46

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 2022

Acquisti		Costo (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
12.851	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	2.276
22.726	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR	2.154
333.697	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	1.485
197.347	iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	1.149
6.809	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating	1.060
227.069	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	1.057
150.678	iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	749
147.613	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	679
43.158	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe X2 USD	448
26.516	BlackRock Global Funds - Global Inflation Linked Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged	439
20.945	BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund - Classe X2 USD	424
19.237	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR	302
27.297	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD Hedged	263
13.779	BlackRock Global Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 USD	212
41.501	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	211
18.655	iShares UK Index Fund (IE) - Classe di Azioni Euro (Hedged) Flexible Accumulating	209
37.912	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	195
25.401	iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	159
30.491	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	154
29.853	iShares Global Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	138
Vendite		Ricavi (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
255.999	BlackRock Global Funds - US Dollar Bond Fund - Classe X2 USD	2.576
164.023	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	1.178
6.094	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	1.130
95.466	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD	1.079
8.231	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 EUR	831
65.225	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund - Classe X2 USD	694
6.956	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR	690
65.732	BlackRock Global Funds - US Growth Fund - Classe X2 USD	623
3.948	BlackRock Global Funds - US Basic Value Fund - Classe X2 USD	546
12.194	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Classe X2 EUR	500
52.811	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD Hedged	498
112.662	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	489
3.335	BlackRock Global Funds - Systematic Global SmallCap Fund - Classe D2 EUR	469
83.240	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	424
67.805	iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	403
39.649	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe X2 USD	403
40.940	BlackRock Global Funds - Asian Tiger Bond Fund - Classe X2 Hedged EUR	395
26.156	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR	377
2.427	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Classe X2 USD	349
4.286	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Classe X2 USD	314
44.838	iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc)	291
2.623	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	282
2.091	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Classe X EUR Accumulating	272
52.206	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	266
43.170	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 EUR	262
57.366	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	257
51.090	iShares Global Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	223
12.273	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Classe X2 USD	220
8.862	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD	214
8.834	BlackRock Global Funds - China Fund - Classe X2 USD	174

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 2022

Acquisti		Costo (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
1.266.532	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	5.453
51.071	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR	4.841
958.663	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	4.446
19.641	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	3.485
657.145	iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	3.276
23.687	iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	3.013
165.512	BlackRock Global Funds - Global Inflation Linked Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged	2.613
384.216	iShares Edge MSCI USA Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	2.433
148.462	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR	1.523
268.286	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	1.379
12.042	BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	1.259
150.068	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	1.123
220.773	iShares Global Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	1.020
101.456	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD Hedged	982
8.960	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Classe X2 EUR	943
89.706	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe X2 USD	930
9.316	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 EUR	914
35.502	BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund - Classe X2 USD	720
134.835	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	682
4.854	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR	675
121.738	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	637
3.501	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Classe X2 USD	535
56.140	iShares Core FTSE 100 UCITS ETF - Classe di Azioni GBP (Acc)	498
Vendite		Ricavi (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
399.250	BlackRock Global Funds - US Dollar Bond Fund - Classe X2 USD	4.005
451.429	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	3.211
589.011	iShares Global Govt Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	2.594
21.247	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Classe X2 EUR	2.291
179.672	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD	2.031
18.911	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Classe X2 EUR	1.929
379.540	iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	1.890
11.028	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Classe X2 USD	1.680
31.738	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Classe X2 EUR	1.362
12.600	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	1.348
12.836	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR	1.273
8.154	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR	1.089
104.037	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR	1.009
5.024	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Dist)	929
172.135	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	877
146.473	iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	871
6.604	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating	867
90.043	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Classe X2 USD Hedged	849
86.258	BlackRock Global Funds - Asian Tiger Bond Fund - Classe X2 Hedged EUR	833
10.541	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Classe X2 USD	775
5.084	BlackRock Global Funds - Systematic Global SmallCap Fund - Classe D2 EUR	716
30.596	BlackRock Global Funds - China Fund - Classe X2 USD	601
97.785	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Classe X2 EUR	592
45.692	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund - Classe X2 USD	482
2.505	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund - Classe X2 USD	448
41.629	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe X2 USD	423



# BLACKROCK MULTI ASSET CONSERVATIVE SELECTION FUND

## PROSPETTI DEGLI ACQUISTI E DELLE VENDITE PRINCIPALI (continua)

Per il periodo finanziario chiuso il 30 settembre 2022

Vendite (continua)		Ricavi (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
16.308	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Classe X2 USD	390

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 2022

Acquisti		Costo (migliaia di USD)
Quantità	Investimenti	
54.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/06/2022	53.958
26.750.000	US Treasury Bill, 0.00%, 20/09/2022	26.707
24.750.000	US Treasury Bill, 0.00%, 30/08/2022	24.742
24.750.000	US Treasury Bill, 0.00%, 06/09/2022	24.732
24.750.000	US Treasury Bill, 0.00%, 08/09/2022	24.729
24.750.000	US Treasury Bill, 0.00%, 13/09/2022	24.722
24.750.000	US Treasury Bill, 0.00%, 15/09/2022	24.718
20.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 03/05/2022	19.998
8.300	Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'	2.272
40.000	Tencent Holdings Ltd.	1.774
571.462	Orbia Advance Corp. SAB de CV	1.372
1.200.000	US Treasury Bill, 0.00%, 25/10/2022	1.198
1.100.000	US Treasury Bill, 0.00%, 27/09/2022	1.098
23.700	BYD Co. Ltd. 'A'	1.083
4.277	NAVER Corp.	1.068
134.000	Chailease Holding Co. Ltd.	1.034
105.057	Savola Group (The)	1.016
1.632.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 'H'	952
1.238.000	Bangkok Dusit Medical Services PCL NVDR	931
1.022.000	First Financial Holding Co. Ltd.	905

  

Vendite		Ricavi (migliaia di USD)
Quantità	Investimenti	
54.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/06/2022	53.958
26.750.000	US Treasury Bill, 0.00%, 20/09/2022	26.709
24.750.000	US Treasury Bill, 0.00%, 30/08/2022	24.743
24.750.000	US Treasury Bill, 0.00%, 06/09/2022	24.733
24.750.000	US Treasury Bill, 0.00%, 08/09/2022	24.730
24.750.000	US Treasury Bill, 0.00%, 13/09/2022	24.722
24.750.000	US Treasury Bill, 0.00%, 15/09/2022	24.718
20.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 03/05/2022	19.998
941.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	16.489
251.100	Tencent Holdings Ltd.	10.458
209.212	Samsung Electronics Co. Ltd.	9.929
616.700	Alibaba Group Holding Ltd.	7.308
139.231	Al Rajhi Bank	3.928
156.100	Meituan 'B'	3.356
7.698.400	Home Product Center PCL NVDR	3.243
8.296.000	Bank of China Ltd. 'H'	3.102
65.100	BYD Co. Ltd. 'A'	3.002
5.459.300	Bank Central Asia Tbk. PT	2.929
31.651	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ADR	2.880
318.000	Delta Electronics, Inc.	2.807

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 2022

Acquisti		Costo (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
859.653	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	5.821
39.629	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating	5.648
42.695	BlackRock Sustainable Equity Factor Plus Fund - Classe X EUR Accumulating	4.131
720.699	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	3.208
26.264	BlackRock Strategic Funds - iackRock Global Real Asset Securities Fund - Classe X2 USD	3.172
207.955	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Classe X2 EUR	2.984
678.185	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	2.766
20.592	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating	2.465
	BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	2.461
279.169	iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc)	1.632
117.365	BlackRock Global Funds - Global Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR Hedged	1.584
8.698	BlackRock Global Funds - European Fund - Classe X2 EUR	1.555
332.738	iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	1.427
195.632	iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	1.389
142.483	iShares Green Bond Index Fund (IE) - Classe di Azioni Flexible EUR Hedged Accumulating	1.373
301.760	iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	1.357
263.068	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	1.344
	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Classe X2 EUR	1.211
8.877		
10.949	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Classe X2 EUR	1.171
5.484	iShares € Govt Bond 15-30yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Dist)	1.129
200.206	iShares \$ TIPS UCITS ETF - EUR Hedged (Acc) Share Class	1.062
	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Classe X2 EUR	1.059
106.641		
	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Classe di Azioni X2 EUR Hedged	1.059
137.303		
202.903	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	1.035
210.644	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	973
	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund Classe X2 USD	856
100.898		
186.044	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Dist)	802
	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Classe X2 EUR	802
8.643		
5.133	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Classe X2 USD	756

  

Vendite		Ricavi (migliaia di EUR)
Quantità	Investimenti	
42.794	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	314
1.573	BlackRock Sustainable Equity Factor Plus Fund - Classe X EUR Accumulating	164
1.130	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Classe X USD Accumulating	149
980	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Classe X USD Accumulating	149
1.120	BlackRock Strategic Funds - iackRock Global Real Asset Securities Fund - Classe X2 USD	139
25.330	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Classe di Azioni EUR Hedged (Acc)	130
26.362	iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF - Classe di Azioni USD (Acc)	121
	BlackRock Global High Yield ESG and Credit Screened Fund - Classe X EUR Hedged Accumulating	120
1.211		
19.246	iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF - Classe di Azioni EUR (Acc)	120
508	BlackRock Global Funds - European Fund - Classe X2 EUR	100

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	2021		2020		2019	
		Rendimento del Fondo %	Rendimento dell'indice di riferimento %	Rendimento del Fondo %	Rendimento dell'indice di riferimento %	Rendimento del Fondo %	Rendimento dell'indice di riferimento %
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund - Classe D ad accumulazione	25 maggio 2017	0,57	(0,55)	0,55	(0,39)	3,98	(0,34)

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 2022:

Nome del Fondo	Classe del Fondo	TER (%)
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Classe D ad accumulazione	0,24
	Classe D CHF coperta ad accumulazione	0,24
	Classe D a distribuzione	0,24
	Classe Z ad accumulazione	0,19
	Classe Z CHF coperta ad accumulazione	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 2022.

# 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 ad un contratto legale scritto 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 2022. 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 è considerato prestabile per via di limitazioni di mercato, normative, agli investimenti o di altro tipo.

		% delle attività prestabili	% del NAV
<b>BlackRock UK Credit Screened Fund</b>	GBP	4,88	4,47
<b>BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund</b>	EUR	5,72	5,31
<b>BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund</b>	EUR	9,04	7,14
<b>BlackRock Diversifying Fixed Income Fund</b>	EUR	43,42	14,65
<b>BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund</b>	USD	7,41	2,87
<b>BlackRock Global Equity Selection Fund</b>	EUR	2,10	0,51
<b>BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund</b>	EUR	1,61	0,45
<b>BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund</b>	USD	2,80	1,30

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 guadagnato 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.

Le tabelle seguenti illustrano il valore dei titoli in prestito (singolarmente identificati nei prospetti degli Investimenti del Fondo di appartenenza), analizzati dalla controparte al 30 settembre 2022.

Controparte	Paese di costituzione delle controparti	Importo in prestito	Garanzia ricevuta
		<b>Migliaia di GBP</b>	<b>Migliaia di GBP</b>
<b>BlackRock UK Credit Screened Fund</b>			
BNP Paribas	Francia	2.807	3.004
J.P. Morgan Securities plc	Regno Unito	2.401	2.680
Barclays Bank plc	Regno Unito	1.843	2.012
Goldman Sachs International	Regno Unito	556	583
HSBC Bank plc	Regno Unito	278	301
Citigroup Global Markets Ltd.	Regno Unito	75	78
<b>Totale</b>		<b>7.960</b>	<b>8.658</b>
		<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
<b>BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund</b>			
J.P. Morgan Securities plc	Regno Unito	1.281	1.391
Barclays Bank plc	Regno Unito	1.183	1.292
Goldman Sachs International	Regno Unito	1.087	1.140
HSBC Bank plc	Regno Unito	254	275
The Bank of Nova Scotia	Canada	191	217
Credit Suisse International	Regno Unito	177	186
UBS AG	Svizzera	175	186
BNP Paribas	Francia	82	89
<b>Totale</b>		<b>4.430</b>	<b>4.776</b>
		<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
<b>BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund</b>			
BNP Paribas	Francia	2.610	2.709
J.P. Morgan Securities plc	Regno Unito	1.345	1.445
Morgan Stanley & Co. International	Regno Unito	1.118	1.164
Societe Generale	Francia	650	705



# BLACKROCK UCITS FUNDS

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

### Prestito di titoli (continua)

Controparte	Paese di costituzione delle controparti	Importo in prestito	Garanzia ricevuta
<b>BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund (continua)</b>		<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
Credit Suisse International	Regno Unito	576	605
HSBC Bank plc	Regno Unito	498	563
<b>Totale</b>		<b>6.797</b>	<b>7.191</b>
<b>BlackRock Diversifying Fixed Income Fund</b>		<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
J.P. Morgan Securities plc	Regno Unito	10.489	11.801
<b>Totale</b>		<b>10.489</b>	<b>11.801</b>
<b>BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund</b>		<b>Migliaia di USD</b>	<b>Migliaia di USD</b>
J.P. Morgan Securities plc	Regno Unito	7.271	8.181
HSBC Bank plc	Regno Unito	578	662
Goldman Sachs International	Regno Unito	455	519
Citigroup Global Markets Ltd.	Regno Unito	325	365
<b>Totale</b>		<b>8.629</b>	<b>9.727</b>
<b>BlackRock Global Equity Selection Fund</b>		<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
BNP Paribas Arbitrage	Francia	136	151
Barclays Capital Securities Ltd.	Regno Unito	9	10
<b>Totale</b>		<b>145</b>	<b>161</b>
<b>BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund</b>		<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
BNP Paribas Arbitrage	Francia	409	455
<b>Totale</b>		<b>409</b>	<b>455</b>
<b>BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund</b>		<b>Migliaia di USD</b>	<b>Migliaia di USD</b>
J.P. Morgan Securities plc	Regno Unito	73	82
Goldman Sachs International	Regno Unito	32	36
UBS AG	Svizzera	21	24
Barclays Capital Securities Ltd.	Regno Unito	4	5
<b>Totale</b>		<b>130</b>	<b>147</b>

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 2022 e il reddito/rendimento ottenuto nel periodo chiuso il 30 settembre 2022. 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 Migliaia
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	6,91	(2.756)
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	USD	3,85	(742)

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 2022.

Controparte	Paese di costituzione delle controparti	Valore dell'esposizione
<b>BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund</b>		<b>Migliaia di USD</b>
Merrill Lynch International	Regno Unito	10.458
HSBC Bank plc	Regno Unito	10.276
<b>BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund</b>		<b>Migliaia di USD</b>
HSBC Bank plc	Regno Unito	242
Merrill Lynch International	Regno Unito	143

La tabella seguente fornisce un'analisi della scadenza dei total return swap (compresi i CFD) al 30 settembre 2022.

Fondo	Valuta	Scadenza	
		Aperto Migliaia	Totale Migliaia
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	20.734	20.734
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	USD	385	385

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/fornita 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 2022.

Valuta	Garanzia liquida ricevuta	Garanzia liquida depositata	Garanzia non liquida ricevuta
<b>BlackRock UK Credit Screened Fund</b>	-	-	<b>Migliaia di GBP</b>
<b>Operazioni di prestito titoli</b>			
AUD	-	-	46
CAD	-	-	114
CHF	-	-	42
DKK	-	-	153
EUR	-	-	3.858
GBP	-	-	1.039
JPY	-	-	302
NOK	-	-	82
SEK	-	-	388
USD	-	-	2.634
<b>Totale</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8.658</b>
<b>BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund</b>	-	-	<b>Migliaia di EUR</b>
<b>Operazioni di prestito titoli</b>			
AUD	-	-	8
CAD	-	-	180
CHF	-	-	8
DKK	-	-	90
EUR	-	-	2.213
GBP	-	-	598
JPY	-	-	55
NOK	-	-	15
SEK	-	-	250
USD	-	-	1.359
<b>Totale</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>4.776</b>
<b>BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund</b>	-	-	<b>Migliaia di EUR</b>
<b>Operazioni di prestito titoli</b>			
AUD	-	-	3
CAD	-	-	11
CHF	-	-	9
DKK	-	-	3
EUR	-	-	4.215
GBP	-	-	890
JPY	-	-	79
NOK	-	-	5
SEK	-	-	39

# 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
<b>BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund (continua)</b>			<b>Migliaia di EUR</b>
USD	-	-	1.937
<b>Totale</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>7.191</b>
<b>BlackRock Diversifying Fixed Income Fund</b>			<b>Migliaia di EUR</b>
<b>Operazioni di prestito titoli</b>			
AUD	-	-	728
CAD	-	-	42
CHF	-	-	42
DKK	-	-	68
EUR	-	-	915
GBP	-	-	2.194
JPY	-	-	1.605
NOK	-	-	188
SEK	-	-	14
USD	-	-	6.005
<b>Totale</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>11.801</b>
<b>BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund</b>		<b>Migliaia di USD</b>	<b>Migliaia di USD</b>
<b>Operazioni di prestito titoli</b>			
AUD	-	-	572
CAD	-	-	29
CHF	-	-	29
DKK	-	-	47
EUR	-	-	707
GBP	-	-	1.576
JPY	-	-	1.374
NOK	-	-	131
SEK	-	-	10
USD	-	-	5.252
<b>SFD OTC</b>			
USD	-	262	-
<b>Totale</b>	<b>-</b>	<b>262</b>	<b>9.727</b>
<b>BlackRock Global Equity Selection Fund</b>			<b>Migliaia di EUR</b>
<b>Operazioni di prestito titoli</b>			
EUR	-	-	20
GBP	-	-	41
JPY	-	-	4
SEK	-	-	2
USD	-	-	94
<b>Totale</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>161</b>
<b>BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund</b>			<b>Migliaia di EUR</b>
<b>Operazioni di prestito titoli</b>			
DKK	-	-	1
EUR	-	-	54
GBP	-	-	118
SEK	-	-	4
USD	-	-	278
<b>Totale</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>455</b>
<b>BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund</b>	<b>Migliaia di USD</b>		<b>Migliaia di USD</b>
<b>Operazioni di prestito titoli</b>			
AUD	-	-	5
CAD	-	-	1
CHF	-	-	2
EUR	-	-	9
GBP	-	-	25
JPY	-	-	27
NOK	-	-	1
USD	-	-	77
<b>SFD OTC</b>			
USD	58	-	-
<b>Totale</b>	<b>58</b>	<b>-</b>	<b>147</b>

# 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 2022.

Tipo e qualità della garanzia	Scadenza							Totale Migliaia di GBP
	1 giorno Migliaia di GBP	2 - 7 giorni Migliaia di GBP	8 - 30 giorni Migliaia di GBP	31 - 90 giorni Migliaia di GBP	91 - 365 giorni Migliaia di GBP	Più di 365 giorni Migliaia di GBP	Aperto Migliaia di GBP	
<b>BlackRock UK Credit Screened Fund</b>	<b>Migliaia di GBP</b>	<b>Migliaia di GBP</b>	<b>Migliaia di GBP</b>	<b>Migliaia di GBP</b>	<b>Migliaia di GBP</b>	<b>Migliaia di GBP</b>	<b>Migliaia di GBP</b>	<b>Migliaia di GBP</b>
<b>Garanzia ricevuta - prestito di titoli</b>								
<b>Reddito fisso</b>								
Investment grade	–	–	36	92	444	5.662	–	6.234
<b>Azioni</b>								
Indice azionario riconosciuto	–	–	–	–	–	–	2.207	2.207
<b>ETF</b>								
OICVM	–	–	–	–	–	–	3	3
Non OICVM	–	–	–	–	–	–	214	214
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>36</b>	<b>92</b>	<b>444</b>	<b>5.662</b>	<b>2.424</b>	<b>8.658</b>
<b>BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
<b>Garanzia ricevuta - prestito di titoli</b>								
<b>Reddito fisso</b>								
Investment grade	–	–	28	140	346	3.419	–	3.933
<b>Azioni</b>								
Indice azionario riconosciuto	–	–	–	–	–	–	642	642
<b>ETF</b>								
OICVM	–	–	–	–	–	–	6	6
Non OICVM	–	–	–	–	–	–	195	195
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>28</b>	<b>140</b>	<b>346</b>	<b>3.419</b>	<b>843</b>	<b>4.776</b>
<b>BlackRock Developed Markets Sovereign Screened</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
<b>Bond Fund</b>								
<b>Garanzia ricevuta - prestito di titoli</b>								
<b>Reddito fisso</b>								
Investment grade	–	–	–	180	18	5.853	–	6.051
<b>Azioni</b>								
Indice azionario riconosciuto	–	–	–	–	–	–	1.073	1.073
<b>ETF</b>								
OICVM	–	–	–	–	–	–	4	4
Non OICVM	–	–	–	–	–	–	63	63
<b>Totale</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>180</b>	<b>18</b>	<b>5.853</b>	<b>1.140</b>	<b>7.191</b>
<b>BlackRock Diversifying Fixed Income Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
<b>Garanzia ricevuta - prestito di titoli</b>								
<b>Azioni</b>								
Indice azionario riconosciuto	–	–	–	–	–	–	11.576	11.576
<b>ETF</b>								

# 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							Totale
	1 giorno	2 - 7 giorni	8 - 30 giorni	31 - 90 giorni	91 - 365 giorni	Più di 365 giorni	Aperto	
<b>BlackRock Diversifying Fixed Income Fund (continua)</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
Non OICVM	-	-	-	-	-	-	225	225
<b>Totale</b>	-	-	-	-	-	-	<b>11.801</b>	<b>11.801</b>
<b>BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund</b>	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD
<b>Garanzia ricevuta - prestito di titoli</b>								
<b>Reddito fisso</b>								
Investment grade	-	-	-	-	7	167	-	174
<b>Azioni</b>								
Indice azionario riconosciuto	-	-	-	-	-	-	8.734	8.734
<b>ETF</b>								
OICVM	-	-	-	-	-	-	9	9
Non OICVM	-	-	-	-	-	-	810	810
<b>Totale</b>	-	-	-	-	<b>7</b>	<b>167</b>	<b>9.553</b>	<b>9.727</b>
<b>BlackRock Global Equity Selection Fund</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
<b>Garanzia ricevuta - prestito di titoli</b>								
<b>Reddito fisso</b>								
Investment grade	-	-	-	1	2	30	-	33
<b>Azioni</b>								
Indice azionario riconosciuto	-	-	-	-	-	-	128	128
<b>Totale</b>	-	-	-	<b>1</b>	<b>2</b>	<b>30</b>	<b>128</b>	<b>161</b>
<b>BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund</b>	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR	Migliaia di EUR
<b>Garanzia ricevuta - prestito di titoli</b>								
<b>Reddito fisso</b>								
Investment grade	-	-	-	-	6	77	-	83
<b>Azioni</b>								
Indice azionario riconosciuto	-	-	-	-	-	-	372	372
<b>Totale</b>	-	-	-	-	<b>6</b>	<b>77</b>	<b>372</b>	<b>455</b>
<b>BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity</b>								
<b>Fund</b>	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD	Migliaia di USD
<b>Garanzia ricevuta - prestito di titoli</b>								
<b>Reddito fisso</b>								
Investment grade	-	-	-	1	-	2	-	3
<b>Azioni</b>								
Indice azionario riconosciuto	-	-	-	-	-	-	137	137
<b>ETF</b>								
OICVM	-	-	-	-	-	-	1	1
Non OICVM	-	-	-	-	-	-	6	6
<b>Totale</b>	-	-	-	<b>1</b>	-	<b>2</b>	<b>144</b>	<b>147</b>

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.

NM1222U-2615757-207/212

# 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)

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.

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 relazione a operazioni di prestito titoli 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 2022.

	<b>Garanzia non liquida ricevuta</b>
<b>Banca Depositaria</b>	<b>Prestito di titoli</b>
<b>BlackRock UK Credit Screened Fund</b>	<b>Migliaia di GBP</b>
Euroclear	5.600
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	3.058
<b>Totale</b>	<b>8.658</b>
<b>BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
Euroclear	2.750
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	2.026
<b>Totale</b>	<b>4.776</b>
<b>BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
Euroclear	4.630
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	2.561
<b>Totale</b>	<b>7.191</b>
<b>BlackRock Diversifying Fixed Income Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	11.801
<b>Totale</b>	<b>11.801</b>
<b>BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund</b>	<b>Migliaia di USD</b>
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	9.727
<b>Totale</b>	<b>9.727</b>
<b>BlackRock Global Equity Selection Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	161
<b>Totale</b>	<b>161</b>
<b>BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	455
<b>Totale</b>	<b>455</b>
<b>BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund</b>	<b>Migliaia di USD</b>
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	147
<b>Totale</b>	<b>147</b>

### 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 2022.

<b>Emittente</b>	<b>Valore</b>
<b>BlackRock UK Credit Screened Fund</b>	<b>Migliaia di GBP</b>
France Government	1.171
US Treasury	955
Netherlands Government	922
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	605
UK Treasury	541
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	446
Sweden Government	388
Deutsche Bundesrepublik	382
Kingdom Of Belgium Government	278



# BLACKROCK UCITS FUNDS

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

Concentrazione della garanzia ricevuta (continua)

<b>Emittente</b>	<b>Valore</b>
<b>BlackRock UK Credit Screened Fund (continua)</b>	<b>Migliaia di GBP</b>
NIKE Inc	216
Altri emittenti	2.754
<b>Totale</b>	<b>8.658</b>
<b>BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
France Government	703
US Treasury	563
UK Treasury	414
Netherlands Government	350
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	300
Kingdom Of Belgium Government	266
Sweden Government	250
Deutsche Bundesrepublik	248
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	215
International Bank for Reconstruction & Development	134
Altri emittenti	1.333
<b>Totale</b>	<b>4.776</b>
<b>BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
France Government	1.095
US Treasury	937
Netherlands Government	873
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	815
UK Treasury	689
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	558
Bundesschatzanweisungen	248
Kingdom Of Belgium Government	241
International Bank for Reconstruction & Development	163
Republic of Austria	137
Altri emittenti	1.435
<b>Totale</b>	<b>7.191</b>
<b>BlackRock Diversifying Fixed Income Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
Keyence Corp	1.158
Duke Realty Corp	765
NIKE Inc	545
WillScot Mobile Mini Holdings Corp	456
Glencore PLC	396
O'Reilly Automotive Inc	386
Rio Tinto PLC	334
Bank of America Corp	311
Exelon Corp	273
Datadog Inc	261
Altri emittenti	6.916
<b>Totale</b>	<b>11.801</b>
<b>BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund</b>	<b>Migliaia di USD</b>
Keyence Corp	803
Duke Realty Corp	530
NIKE Inc	378
WillScot Mobile Mini Holdings Corp	316
Glencore PLC	274
O'Reilly Automotive Inc	268
Rio Tinto PLC	231
Bank of America Corp	215
Exelon Corp	192
Datadog Inc	192
Altri emittenti	6.328
<b>Totale</b>	<b>9.727</b>
<b>BlackRock Global Equity Selection Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
US Treasury	29
Anheuser-Busch InBev SA/NV	16
Pinduoduo Inc	15
ZTO Express Cayman Inc	15
Shell PLC	15
Cheniere Energy Inc	15
KE Holdings Inc	13
easyJet PLC	8
Carnival PLC	5
Euromoney Institutional Investor PLC	4

## BLACKROCK UCITS FUNDS

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

#### Concentrazione della garanzia ricevuta (continua)

Emittente	Valore
<b>BlackRock Global Equity Selection Fund (continua)</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
Altri emittenti	26
<b>Totale</b>	<b>161</b>
<b>BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund</b>	<b>Migliaia di EUR</b>
US Treasury	83
ZTO Express Cayman Inc	46
Pinduoduo Inc	46
Anheuser-Busch InBev SA/NV	46
Shell PLC	46
Cheniere Energy Inc	46
KE Holdings Inc	39
easyJet PLC	23
Carnival PLC	15
Euromoney Institutional Investor PLC	12
Altri emittenti	53
<b>Totale</b>	<b>455</b>
<b>BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund</b>	<b>Migliaia di USD</b>
Keyence Corp	8
Duke Realty Corp	5
Pinduoduo Inc	4
NIKE Inc	4
Monster Beverage Corp	3
Hoya Corp	3
WillScot Mobile Mini Holdings Corp	3
FirstEnergy Corp	3
Financial Select Sector SPDR Fund	3
Glencore PLC	3
Altri emittenti	108
<b>Totale</b>	<b>147</b>

# 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 benchmark 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 né delle circostanze finanziarie personali né degli obiettivi di qualsiasi 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 né 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 o 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 relative, 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

© 2022 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**<sup>®</sup>

Elimina la carta. . .  
È facile, economico ed ecologico!  
Visita [www.blackrock.com/edelivery](http://www.blackrock.com/edelivery)

