

BlackRock[®]

Jahresbericht und geprüfter Jahresabschluss

Institutional Cash Series plc

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

INHALT	Seite
Überblick	
Allgemeine Informationen	1
Hintergrund	3
Performance	
Bericht des Investmentmanagers	5
Governance (Unternehmensführung)	
Bericht des Verwaltungsrats	14
Bericht der Verwahrstelle an die Anteilinhaber	16
Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer	17
Jahresabschluss	
Gewinn- und Verlustrechnung	20
Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	24
Bilanz	28
Anmerkungen zum Jahresabschluss	32
Aufstellungen der Vermögenswerte	75
Zusätzliche Informationen und aufsichtsrechtliche Angaben (ungeprüft)	
Aufstellungen wesentlicher Käufe und Verkäufe (ungeprüft)	144
Informationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)	157
Transaktionen mit verbundenen Personen (ungeprüft)	160
Transaktionskosten (ungeprüft)	161
Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions) (ungeprüft)	161
Wechselseitige Anlagen (ungeprüft)	161
Gesamtrisikoeexposition (ungeprüft)	161
Hebelwirkung (ungeprüft)	161
Vergütungsbericht (ungeprüft)	162
Effizientes Portfoliomanagement und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)	166
Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen (ungeprüft)	173

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Verwaltungsrat¹

Barry O'Dwyer (Vorsitzender) (Ire)

Francis Drought (Ire)²

Nicola Grenham (Irin)³

Tom McGrath (Ire)²

¹Nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied

²Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe

³Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

Verwaltungsgesellschaft

BlackRock Asset Management Ireland Limited

1st Floor

2 Ballsbridge Park

Ballsbridge

Dublin 4, D04 YW83

Irland

Fondsverwalter, Register- und Transferstelle

J.P. Morgan Administration Services (Ireland) Limited

200 Capital Dock

79 Sir John Rogerson's Quay

Dublin 2, D02 RK57

Irland

Verwahrstelle

J.P. Morgan SE – Zweigniederlassung Dublin

200 Capital Dock

79 Sir John Rogerson's Quay

Dublin 2, D02 RK57

Irland

Secretary

Apex Group Corporate Administration Services Ireland Limited

Fourth Floor

76 Baggot Street Lower

Dublin 2, D02 EK81

Irland

Eingetragener Geschäftssitz des Unternehmens

200 Capital Dock

79 Sir John Rogerson's Quay

Dublin 2, D02 RK57

Irland

Investmentmanager, Hauptvertriebsgesellschaft und

Unter- Investmentmanager⁴

BlackRock Investment Management (UK) Limited

12 Throgmorton Avenue

London, EC2N 2DL

Vereinigtes Königreich

US-Investmentmanager⁴

BlackRock Capital Management, Inc.

100 Bellevue Parkway

Wilmington

Delaware 19809

USA

Unabhängige Abschlussprüfer

Ernst & Young

Block 1 Harcourt Centre

Harcourt Street

Dublin 2, D02 YA40

Irland

Rechtsberater für irisches Recht

Matheson

70 Sir John Rogerson's Quay

Dublin 2, D02 R296

Irland

Zahlstelle in Frankreich

CACEIS Bank Frankreich

1-3 Place Valhubert

75013 Paris

Frankreich

Zahlstelle auf der Insel Man

IQ EQ (Isle of Man) Limited

(vormals Cains Fiduciaries Limited & First Names)

First Names House

Victoria Road

Douglas

Insel Man

IM2 4DF

Zahlstelle in der Schweiz

State Street Bank International GmbH

München, Zweigniederlassung Zürich

Beethovenstrasse 19

CH-8027 Zürich

Schweiz

Vertreter in Dänemark

BlackRock (Niederlande) B.V., Zweigniederlassung Kopenhagen

Harbour House, Sundkrogsgade 21

Kopenhagen

DK- 2100

Dänemark

Vertreter in Südafrika

BlackRock Investment Management (UK) Limited

(Zweigniederlassung Südafrika)

First Floor

Regus Convention Towers

Crn. Of Heerngracht and Coen Steyter Street

Cape Town 8001

Vertreter in der Schweiz

BlackRock Asset Management Schweiz AG

Bahnhofstrasse 39

8001 Zürich

Schweiz

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

Registernummer des Unternehmens: 298213

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

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

Bitte beachten Sie, dass für den Vertrieb der Anteile des folgenden Fonds keine Anzeige gemäß §310 des Kapitalanlagegesetzbuches für OGAW erfolgt ist: BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund. Daher dürfen Anteile dieses Fonds in der Bundesrepublik Deutschland nicht öffentlich vertrieben werden.

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

HINTERGRUND

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

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

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

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

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

Details der Fonds

Zum 30. September 2023 waren 13 Fonds des Unternehmens geschäftstätig.

Veränderungen im Unternehmen im Laufe des Geschäftsjahres

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

- Aktualisierungen zu den Risikofaktoren, den Informationen über den Verwaltungsrat, den Angaben zur Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten („SFDR“), zur Bonitätsbewertung und den Informationen über Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“).
- Aufnahme der Anteilklassen Heritage (Dis), Select (Dis), Agency (Dis), Core (Dis) und Premier (Dis).

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

Am 16. Januar 2023 änderte der Secretary der Verwaltungsgesellschaft seinen Namen von Sanne Corporate Administration Services (Ireland) Limited in Apex Group Corporate Administration Services Ireland Limited.

Am 29. März 2023 schied Karen Prooth als nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied aus.

Am 28. April 2023 wurde für das Unternehmen ein aktualisierter Prospekt herausgegeben, um Aktualisierungen zur Abrechnung von Zahlungen für die Anteilklasse Variable NAV (Acc T3) zu ermöglichen.

Am 11. Mai 2023 wurde ein Nachtrag zum Prospekt für das Unternehmen veröffentlicht, um die neue Anteilklasse Premier (Dis T1) aufzunehmen.

Am 21. Juli 2023 schied Jacqueline Flynn als nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied aus.

Die folgenden Anteilklassen wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt/zurückgenommen.

Name des Fonds	Anteilklasse	Auflegung/ Rücknahme	Termin
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Anteilklasse Agency (Dis)	Auflegung	20. März 2023
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Anteilklasse Core (Acc T0)	Auflegung	5. April 2023
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Anteilklasse Core (Dis)	Auflegung	20. März 2023
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Anteilklasse Heritage (Acc)	Auflegung	5. April 2023
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Anteilklasse Heritage (Dis)	Auflegung	20. März 2023
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Anteilklasse Premier (Dis)	Auflegung	16. Februar 2023
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Anteilklasse Select (Dis)	Auflegung	20. März 2023

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

HINTERGRUND (Fortsetzung)

Veränderungen im Unternehmen im Laufe des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Name des Fonds	Anteilklasse	Auflegung/ Rücknahme	Termin
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	Anteilklasse Premier (Dis)	Auflegung	5. September 2023
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Anteilklasse Agency (Dis)	Auflegung	7. November 2022
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Anteilklasse Core (Dis)	Auflegung	7. November 2022
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Anteilklasse Heritage (Dis)	Auflegung	1. November 2022
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Anteilklasse Premier (Dis)	Auflegung	1. November 2022
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Anteilklasse Select (Dis)	Auflegung	7. November 2022
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Agency (Dis) GBP	Auflegung	20. März 2023
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Anteilklasse Core (Dis)	Auflegung	7. November 2022
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Heritage (Dis) GBP	Auflegung	20. März 2023
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Anteilklasse Premier (Dis)	Auflegung	7. November 2022
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Select (Dis) GBP	Auflegung	20. März 2023
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	Anteilklasse Agency (Acc)	Auflegung	28. April 2023
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	Anteilklasse J (Dis T3)	Rücknahme	28. April 2023
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	Anteilklasse Premier (Dis T1)	Auflegung	16. Mai 2023
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	Anteilklasse Heritage (Acc)	Auflegung	12. Oktober 2022
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	Anteilklasse Agency (Acc T0)	Auflegung	6. Juli 2023
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	Anteilklasse G Distributing II	Rücknahme	2. März 2023
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	Klasse FA	Rücknahme	25. April 2023
BlackRock ICS US Treasury Fund	Klasse FA	Rücknahme	25. April 2023

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS

Anlageziel

BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund

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

BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund

BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund

BlackRock ICS US Treasury Fund

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

BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund

BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund

BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund

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

BlackRock ICS Euro Liquidity Fund

BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund

BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund

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

BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund

BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund

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

BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund

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

Ansatz zum Investmentmanagement und ESG-Politik

In der folgenden Tabelle wird der für die einzelnen Fonds gewählte Ansatz zum Investmentmanagement dargelegt. Darüber hinaus zeigt sie, welche Fonds gemäß der EU-Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) ökologische oder soziale Merkmale („Artikel-8-Fonds“) bewerben oder eine nachhaltige Investition anstreben („Artikel-9-Fonds“). Weitere Einzelheiten darüber, wie die Artikel 8- und Artikel 9-Fonds diese Merkmale und Ziele erreicht haben, finden Sie im ergänzenden Abschnitt zu den SFDR-Angaben im Jahresbericht.

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Name des Fonds	Performanceindikator	Ansatz zum Investmentmanagement	SFDR-Kriterien
BlackRock ICS US Treasury Fund ¹	SOFR Overnight	Aktiv	Sonstige

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

Zusammenfassung der Wertentwicklung

Die nachstehende Tabelle vergleicht die realisierte Performance des Fonds mit dem entsprechenden Performanceindikator im Geschäftsjahr zum 30. September 2023.

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

- Bei den aufgeführten Renditen handelt es sich um die Performance-Renditen für die primäre Anteilklasse des Fonds nach Abzug von Gebühren, die als repräsentative Anteilklasse ausgewählt wurde. Die primäre Anteilklasse stellt die Anteilklasse dar, in die die Mehrheit der Anleger des Fonds investiert. Sie berücksichtigt außerdem andere relevante Faktoren wie die Basiswährung des Fonds. Sofern nichts anderes angegeben ist, lauten die zu Vergleichszwecken angegebenen Erträge auf dieselbe Währung wie die primäre Anteilklasse. Die Performance-Renditen für andere Anteilklassen können auf Anfrage zur Verfügung gestellt werden.
- Für Fonds, die ihren Handel im Geschäftsjahr aufgenommen haben und/oder deren Anteile im Geschäftsjahr vollständig zurückgenommen wurden, werden die Renditen ab dem Datum angegeben, an dem der jeweilige Fonds den Handel aufnahm und/oder ab dem Datum, an dem die Fondsanteile vollständig zurückgenommen wurden. Die Total Expense Ratio (Gesamtkostenquote, „TER“) ist die effektive TER ab dem Datum, an dem der Fonds den Handel aufgenommen hat und/oder bis zum Datum der vollständigen Rücknahme des Fonds.
- Die Fondserträge stützen sich auf die Summe der täglichen Dividendensätze nach Abzug von Gebühren. Gemäß den Anforderungen des Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), die für die Abschlüsse gelten, kann es zu Abweichungen zwischen dem NIW je Anteil, wie im Abschluss ausgewiesen, und dem NIW je Anteil, der gemäß der im Prospekt ausgewiesenen Bewertungsmethode berechnet wird, kommen.
- Die Gesamtkostenquote stellt die Summe aller Gebühren, Betriebskosten und Aufwendungen (mit Ausnahme direkter Handelskosten) dar, die dem Vermögen der einzelnen Fonds als Prozentsatz des durchschnittlichen Vermögens auf Basis des Zwölfmonatszeitraums zum 30. September 2023 belastet wird.

Name des Fonds	Fondsrendite %	Performanceindikator %	TER %
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund - Anteilklasse Accumulating	2,56	2,61	0,05
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	2,19	2,60	0,20
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Acc)	2,60	2,60	0,20
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	2,40	2,60	0,20
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Core	2,26	2,61	0,20
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	3,80	4,06	0,20
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Dis)	3,90	4,06	0,20
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	3,91	4,06	0,20
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Core	4,11	4,06	0,20
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Dis)	4,66	4,55	0,20
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	4,69	4,55	0,20
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Select	4,87	4,76	0,15
BlackRock ICS US Treasury Fund - Anteilklasse Core (Acc)	4,39	4,55	0,20

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Globaler Wirtschaftsüberblick

Die globalen Aktien, die durch den MSCI All Country World Index („ACWI“) repräsentiert werden, verzeichneten in den zwölf Monaten bis zum 30. September 2023 (in US-Dollar) eine Rendite von 20,80 %. Trotz einer hohen Inflation (die Teuerungsrate von Waren und Dienstleistungen) und steigenden Zinsraten begann durch den Anlegeroptimismus, dass sich die geldpolitische Straffung seitens der weltweit größten Zentralbanken verlangsamt, eine Erholung bei Aktien. Obwohl die Inflationsrate historisch betrachtet immer noch hoch war, ging sie im Laufe des Berichtszeitraums deutlich zurück, da sich die Unterbrechungen der Lieferkette abschwächten und höhere Zinssätze der Nachfrage einen Dämpfer gaben.

Die US-Wirtschaft zeigte infolge der weiter steigenden Ausgaben der Verbraucher und des Staates ein robustes Wachstum. Zwar fielen im Frühjahr 2023 mehrere namhafte Regionalbanken aus, doch wurden die Auswirkungen auf die Gesamtwirtschaft durch das rasche Eingreifen der Regierung begrenzt. Der US-amerikanische Arbeitsmarkt blieb angespannt, und die Arbeitslosigkeit lag während des gesamten zwölfmonatigen Zeitraums auf einem niedrigen Niveau. Das Wirtschaftswachstum in Japan beschleunigte sich, und die Regierung hob die strengen Grenzkontrollen auf. Die Wirtschaft des Vereinigten Königreichs stagnierte nahezu, da die Exporte im Fahrwasser eines abkühlenden Welthandels schwach waren. In der Eurozone setzte sich das moderate Wachstum im ersten Quartal 2023 fort, doch belasteten die hohen Zinssätze die Wirtschaft der Region weiterhin. Die Übernahme der gescheiterten Credit Suisse durch die UBS auf Veranlassung der Aufsichtsbehörden stabilisierte die Märkte.

Die meisten Schwellenländer setzten ihr Wachstum fort, obwohl die schwankenden Rohstoffpreise und das höhere Zinsumfeld erhebliche wirtschaftliche Herausforderungen darstellten. Die chinesische Wirtschaft wuchs im Vergleich zu den historischen Wachstumsraten des Landes nur langsam, während die gegen Ende des Berichtszeitraums sinkenden Verbraucherpreise Anlass zu Deflations Sorgen (sinkende Preise für Waren und Dienstleistungen) gaben. Die indische Wirtschaft setzte ihr Wachstum fort und beschleunigte sich in Q2 2023 aufgrund des starken Wachstums im Dienstleistungssektor und der robusten Nachfrage seitens der Verbraucher.

Die größten Zentralbanken der Welt ergriffen weiterhin verschiedene Maßnahmen zur Straffung der Geldpolitik. Die US-Notenbank (die „Fed“) erhöhte die Zinssätze während des zwölfmonatigen Berichtszeitraums sechs Mal und verlangsamte dann das Tempo ihrer Erhöhungen, indem sie die Zinssätze auf zwei ihrer Sitzungen unverändert ließ. Die Bank of England (die „BoE“) hob die Zinssätze während des zwölfmonatigen Berichtszeitraums sieben Mal an, doch beließ sie die Zinssätze auf ihrer letzten Sitzung des Berichtszeitraums unverändert. In der Eurozone war die Inflation erhöht, verlangsamte sich aber, und die Europäische Zentralbank (die „EZB“) erhöhte acht Mal die Zinsen.

Die Performance der globalen Aktienmärkte war im zwölfmonatigen Berichtszeitraum insgesamt deutlich positiv, da die Anleger mit der Einschätzung der Auswirkungen der sich rasch verändernden Wirtschafts- und Kreditbedingungen beschäftigt waren. Die rückläufige Inflation und das langsamere Zinserhöhungstempo der Fed schürte Hoffnungen, dass sich der aktuelle geldpolitische Straffungszyklus einem Ende nähert. Weltweit sahen sich Anleihen und Aktien, die die Merkmale von Unternehmen in Bezug auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) berücksichtigen, mit regulatorischen Bedenken und einer veränderten Anlegerstimmung konfrontiert, und in ihrer Gesamtheit verzeichneten ESG-Aktienfonds in der ersten Jahreshälfte 2023 Abflüsse. Die Neuemissionen von Anleihen für ESG-bezogene Projekte gingen 2022 im Vergleich zum Vorjahr zurück. In der ersten Jahreshälfte 2023 kam es aber zu einer Erholung.

Die (sich gegenläufig zu den Kursen entwickelnden) Renditen der 10-jährigen US-Staatsanleihe, ein Referenzzins für den globalen Anleihenmarkt, erhöhten sich im zwölfmonatigen Berichtszeitraum, da die Zentralbanken die Geldpolitik anzogen. Die Renditekurve, die die Differenz zwischen den Renditen verschiedener Laufzeiten misst, kehrte sich stärker um, so dass die Renditen kürzerer Laufzeiten gegenüber denen mit längeren Laufzeiten weiter anzogen, was ein Zeichen dafür ist, dass die Märkte über eine Verlangsamung des Wirtschaftswachstums besorgt waren. Ferner machte die Herabstufung der US-Staatsanleihen durch eine große Ratingagentur die steigenden Schuldendienstkosten deutlich. Aufgrund des politischen Führungswechsels und der Unsicherheit über die Pläne der Regierung für die Finanzpolitik waren die Renditen britischer Staatsanleihen zu Beginn des Berichtszeitraums volatil. Allerdings stabilisierten sich die Märkte, als die neue Regierung ihre Pläne für Steueränderungen, die eine erhebliche zusätzliche Kreditaufnahme erfordern würden, zurücknahm. Sowohl die Kurse der Staatsanleihen in der Eurozone als auch die japanischer Papiere gingen im zwölfmonatigen Berichtszeitraum insgesamt leicht zurück. Die japanische Regierung adjustierte ihre Renditeobergrenze für 10-jährige Staatsanleihen, was zu einem erheblichen Anstieg der Renditen für diese Papiere führte, während umfangreiche Käufe durch die Bank of Japan in der Folge für schwankende Kurse sorgten.

Unternehmensanleihen schnitten weltweit positiv ab, da die Anleger Unternehmensanleihen angesichts der sich ändernden Wirtschaftsbedingungen neu bewerteten. Die höheren Anleihenrenditen zogen Anleger an, und die anhaltende Widerstandsfähigkeit der globalen Wirtschaft milderte die Sorgen hinsichtlich der Kreditwürdigkeit. Hochzinsanleihen verzeichneten besonders starke Renditen, da die soliden Bilanzen der Unternehmen die Anleger beruhigten.

Die Aktien der Schwellenländer verbuchten solide Kursanstiege und profitierten von dem relativ stabilen globalen Wirtschaftsumfeld und der Verschonung der strafferen Geldpolitik. Als die Sorgen über eine mögliche Rezession abnahmen, investierten einige Anleger erneut in Schwellenländeraktien, was zu einem Anstieg der Kurse führte. Die Kurse von Schwellenländeranleihen verzeichneten insgesamt positive Renditen, da die Anleger von einer weniger restriktiven Geldpolitik in den Industrieländern ausgingen, die das globale Wachstum antreiben.

Die Rohstoffmärkte waren volatil und stellten sich weiterhin auf die Folgen der russischen Invasion in der Ukraine ein. Die Preise für Rohöl der Sorte Brent gingen leicht zurück, da sich die Energiemärkte stabilisierten und die weltweite Ölproduktion zunahm. Die Erdgaspreise in der Eurozone beendeten den Berichtszeitraum deutlich niedriger, da ein warmer Winter und der Erfolg bei der Sicherstellung alternativer Gaslieferanten die Preise drückten. Die Goldpreise zogen angesichts der erhöhten Inflation, des starken US-Dollar und des sich verlangsamenden Zinserhöhungstempos der Fed kräftig an.

An den Devisenmärkten war die Performance des US-Dollar gegenüber den meisten anderen globalen Währungen gemischt. Der US-Dollar festigte sich gegenüber dem japanischen Yen, dem chinesischen Yuan, gab aber gegenüber dem Euro und dem britischen Pfund Sterling nach. Anhaltende Zinserhöhungen der EZB und der BoE, selbst als die Fed bei den Zinserhöhungen einen Gang nach unten schaltete, waren die Antriebskräfte hinter dem Anstieg des relativen Wertes des Euro und Pfund Sterling.

Überblick über die Fonds-Performance und die Veränderungen im Portfolio

BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund

Die Strategie des Fonds zeichnete sich über das gesamte Jahr hinweg durch einen vorsichtigen Ansatz aus, insbesondere während des Zinserhöhungszyklus. Im vierten Quartal 2022 hielt der Fonds die Duration kurz, konzentrierte sich auf Wertpapiere mit einer kurzen Laufzeit und sondierte Anlagegelegenheiten bei kanadischen und US-Dollar-Emitenten. Diese defensive Haltung wurde auch im ersten Quartal 2023 beibehalten, wobei der Schwerpunkt auf sehr kurzen Laufzeiten lag. Im zweiten Quartal kam es zu einer leichten Umschichtung, als der Fonds damit begann, sein Engagement in Wertpapieren mit 3-monatiger Laufzeit zu erhöhen. Gleichzeitig wurde bei mittelfristigen Krediten weiterhin ein zurückhaltender Ansatz verfolgt. Im dritten Quartal diversifizierte der Fonds sein Portfolio über verschiedene Laufzeiten und Bonitätsratings, um so die Erträge zu optimieren und gleichzeitig das Risiko zu steuern.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2023 und 30. September 2022 angegeben:

30. September 2023		30. September 2022	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Sonstige Papiere	44,25 %	Sonstige Commercial Paper	41,75 %
Einlagenzertifikat	22,64 %	Sonstige Papiere	34,16 %
Sonstige Commercial Paper	17,71 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	15,76 %
Commercial Paper von Finanzunternehmen	10,88 %	Einlagenzertifikat	7,09 %
Finanzierungsvereinbarung von Versicherungsgesellschaften	3,02 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	1,25 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	1,50 %		

BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund

In den Jahren 2022 und 2023 sah sich die Eurozone mit einer Reihe von wirtschaftlichen Herausforderungen und Unsicherheiten konfrontiert. Die Energiepreise sind in die Höhe geschossen, was einen erheblichen Einfluss auf die Produktionskosten hatte. Dies zeigte sich, als der Erzeugerpreisindex („PPI“) trotz eines Rückgangs der Gaspreise von September bis November 2022 nachgab. Die EZB reagierte auf diesen Inflationsdruck mit einer Reihe von Zinserhöhungen, u. a. eine bemerkenswerte Anhebung um 50 Basispunkte im Dezember 2022 und um weitere 100 Basispunkte im ersten Quartal 2023. Bis September 2023 hatte die EZB ihre Leitzinsen dann um weitere 25 Basispunkte angehoben.

Durch den Zusammenbruch der Silicon Valley Bank („SVB“) und den anschließenden Problemen der Credit Suisse erlebte der Bankensektor Turbulenzen, die zu einer Marktvolatilität führten, die an die globale Finanzkrise von 2008 erinnerte. Diese Volatilität in Verbindung mit der aggressiven Haltung der EZB hatte zur Folge, dass sich die europäischen Renditen im Laufe des Jahres in unterschiedliche Richtungen bewegten.

Beim Wirtschaftswachstum in der Eurozone zeichneten sich Spannungen ab. Im zweiten Quartal 2023 deutete das Bruttoinlandsprodukt („BIP“) der Eurozone auf eine technische Rezession hin. Umfrageindikatoren, wie der Eurozone Composite Purchasing Managers' Index (Einkaufsmanagerindex für das produzierende Gewerbe, „PMI“), wiesen zudem auf mögliche wirtschaftliche Schwächen hin. Die Inflation war für die EZB weiterhin ein Anlass zur Sorge. Die Kerninflation schwankte zwar, lag aber stets über dem Zielwert der Zentralbank. Bis September 2023 war die Kerninflation zwar zurückgegangen, doch war sie immer noch erhöht, was zu Diskussionen über eine mögliche Stagflation in Europa führte.

Bei den geldpolitischen Entscheidungen und in den Mitteilungen der EZB lag das ganze Jahr über der Schwerpunkt auf Inflationskontrolle und wirtschaftliche Stabilität. Bis zum dritten Quartal 2023 hatte die EZB in ihrer Geldpolitik eine deutlich zurückhaltende Haltung eingenommen. Der Markt reagierte auf diese Maßnahmen unterschiedlich, doch wurde gegen Ende des Berichtszeitraums allgemein mit anhaltend hohen Kreditkosten gerechnet.

Vor dem Hintergrund dieser geldpolitischen und wirtschaftlichen Herausforderungen rückte auch die Finanzpolitik in den Blickpunkt. Die Prognosen der EZB, insbesondere im September 2023, betonten die Notwendigkeit von finanzpolitischen Konsolidierungsmaßnahmen, um die Inflation zu bekämpfen. Als sich die Eurozone der Haushaltssaison 2024 näherte, wurde eine verstärkte staatliche Unterstützung für Haushalte und Unternehmen erwartet, vor allem angesichts der Unsicherheiten im Zusammenhang mit den Fiskalregeln der Europäischen Union („EU“).

Zusammenfassend kann gesagt werden, dass die wirtschaftliche Landschaft der Eurozone von 2022 bis 2023 von Inflationsdruck, Herausforderungen für den Bankensektor und Wachstumssorgen geprägt war, wobei der EZB bei der Navigation durch diese turbulenten Gewässer eine zentrale Rolle zufiel. Aufgrund besserer relativer Werteigenschaften bevorzugt der Fonds französische und deutsche Anleihen und Schatzwechsel sowie, um ein großzügiges Liquiditätsniveau zu halten, weiterhin Allokationen zu Overnight-Repogeschäften.

Während des gesamten Jahres bevorzugte der Fonds, insbesondere angesichts von Unsicherheiten und Zinserhöhungen, durchweg kurzfristige Anlagen. Im vierten Quartal 2022 lag der Schwerpunkt auf Titeln mit Fälligkeiten gegen Anfang Januar, wobei Staatspapiere für 2023 mit Aufschlag bewertet wurden. Dieser vorsichtige Ansatz setzte sich auch im ersten Quartal 2023 fort, wobei eine Präferenz auf Repogeschäften und kurzfristigen Schatzwechseln lag. Im zweiten Quartal verringerte sich die gewichtete durchschnittliche Laufzeit („WAM“) weiter, worin sich die anhaltend vorsichtige Haltung widerspiegelt. Im dritten Quartal kam es zu einer geringen Umschichtung, da der Fonds Anlagegelegenheiten mit Januar nutzte und die WAM von 3 auf 14 Tage erhöhte. Insgesamt behielt der Fonds aber eine defensive Position bei.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2023 und 30. September 2022 angegeben:

30. September 2023		30. September 2022	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Sonstige Repogeschäfte	60,53 %	Treasury Debt	55,18 %
Government Agency-Repogeschäft	29,29 %	Sonstige Repogeschäfte	29,41 %
Treasury Debt	10,18 %	Government Agency-Repogeschäft	15,41 %

BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund

Im Laufe des Jahres navigierte der Fonds durch Marktvolatilitäten und Zinsänderungen. Im vierten Quartal 2022 waren die Preise zum Jahresende billiger als in den Vorjahren, wobei eine Knappheit an Sicherheiten und eine hohe Überschussliquidität die vorherrschenden Themen waren. Im ersten Quartal 2023 reagierte der Fonds auf die zunehmende Marktvolatilität, indem er die Duration kürzte und Liquiditätspuffer aufbaute, was zu einem Rückgang der WAM von 30 auf 18 Tage führte. Im zweiten Quartal bereitete sich der Fonds auf erwartete Zinserhöhungen vor, indem er die WAMs kurz hielt und Liquiditätspuffer aufbaute. Gegen Ende des dritten Quartals passte der Fonds seine Strategie als Reaktion auf die Hinweise der EZB an: Er verlängerte die Duration und konzentrierte sich bis Januar auf Handelsaktivitäten.

NM0124U-3356337-10/233

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2023 und 30. September 2022 angegeben:

30. September 2023		30. September 2022	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	27,07 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	38,12 %
Einlagenzertifikat	26,23 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	21,57 %
Commercial Paper von Finanzunternehmen	21,79 %	Einlagenzertifikat	20,94 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	8,77 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	8,72 %
Sonstige Repogeschäfte	6,28 %	Sonstige Commercial Paper	5,47 %
Sonstige Papiere	5,15 %	Sonstige Papiere	3,11 %
Government Agency-Repogeschäft	4,71 %	Government Agency-Repogeschäft	2,07 %

BlackRock ICS Euro Liquidity Fund

Im Laufe des Jahres navigierte der Fonds durch Marktvolatilitäten und Zinsänderungen. Im vierten Quartal 2022 waren die Preise zum Jahresende billiger als in den Vorjahren, wobei eine Knappheit an Sicherheiten und eine hohe Überschussliquidität die vorherrschenden Themen waren. Im ersten Quartal 2023 reagierte der Fonds auf die zunehmende Marktvolatilität, indem er die Duration kürzte und Liquiditätspuffer aufbaute, was zu einem Rückgang der WAM von 30 auf 18 Tage führte. Im zweiten Quartal bereitete sich der Fonds auf erwartete Zinserhöhungen vor, indem er die WAMs kurz hielt und Liquiditätspuffer aufbaute. Gegen Ende des dritten Quartals passte der Fonds seine Strategie als Reaktion auf die Hinweise der EZB an: Er verlängerte die Duration und konzentrierte sich bis Januar auf Handelsaktivitäten.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2023 und 30. September 2022 angegeben:

30. September 2023		30. September 2022	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Einlagenzertifikat	26,49 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	29,12 %
Commercial Paper von Finanzunternehmen	25,50 %	Einlagenzertifikat	28,51 %
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	14,31 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	12,44 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	7,83 %	Government Agency-Repogeschäft	10,12 %
Treasury Debt	5,81 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	8,50 %
Sonstige Repogeschäfte	5,78 %	Sonstige Commercial Paper	5,65 %
Sonstige Papiere	5,50 %	Sonstige Papiere	2,94 %
Government Agency-Repogeschäft	5,38 %	Treasury Debt	2,73 %
Sonstige Commercial Paper	3,40 %		

BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund

Die Strategie des Fonds zeichnete sich über das gesamte Jahr hinweg durch einen vorsichtigen Ansatz aus, insbesondere während des Zinserhöhungszyklus. Im vierten Quartal 2022 hielt der Fonds die Duration kurz, konzentrierte sich auf Wertpapiere mit einer kurzen Laufzeit und sondierte Anlagegelegenheiten bei kanadischen und US-Dollar-Emittenten. Diese defensive Haltung wurde auch im ersten Quartal 2023 beibehalten, wobei der Schwerpunkt auf sehr kurzen Laufzeiten lag. Im zweiten Quartal kam es zu einer leichten Umschichtung, als der Fonds damit begann, sein Engagement in Wertpapieren mit 3-monatiger Laufzeit zu erhöhen. Gleichzeitig wurde bei mittelfristigen Krediten weiterhin ein zurückhaltender Ansatz verfolgt. Im dritten Quartal diversifizierte der Fonds sein Portfolio über verschiedene Laufzeiten und Bonitätsratings, um so die Erträge zu optimieren und gleichzeitig das Risiko zu steuern.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2023 und 30. September 2022 angegeben:

30. September 2023		30. September 2022	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Commercial Paper von Finanzunternehmen	39,36 %	Sonstige Commercial Paper	32,85 %
Sonstige Papiere	24,02 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	31,91 %
Einlagenzertifikat	8,92 %	Sonstige Papiere	18,43 %
Sonstige Commercial Paper	8,56 %	Einlagenzertifikat	8,23 %
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	8,49 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	4,32 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	7,55 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	4,22 %
Investmentgesellschaft	3,10 %	Investmentgesellschaft	0,02 %
		Treasury Debt	0,05 %

BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund

Während des gesamten Zeitraums von 2022 bis 2023 war die wirtschaftliche Landschaft des Vereinigten Königreichs von einer Reihe von Herausforderungen und den geldpolitischen Reaktionen geprägt. Die BoE nahm in ihrem Kampf gegen den Inflationsdruck eine proaktive Haltung ein, indem sie eine Reihe von Zinserhöhungen vornahm. Sie kulminierte im August 2023 in einem Leitzins von 5,25 %. Mit dieser aggressiven Geldpolitik reagierte sie auf den starken Anstieg der Inflationszahlen des Verbraucherpreisindex („VPI“), die im Oktober 2022 mit 11,1 % ihren höchsten Stand erreichten, bevor sie dann bis August 2023 allmählich auf 6,7 % zurückgingen.

Die britische Wirtschaft erwies sich als widerstandsfähig und konnte 2022 eine technische Rezession vermeiden. Im dritten Quartal 2023 zeigten sich jedoch deutliche Anzeichen einer wirtschaftlichen Belastung. Der PMI für den Dienstleistungssektor sank unter die Marke von 50, was eine Schrumpfung andeutet. Auch die Indikatoren für den Immobilienmarkt schwächten sich ab, und die Arbeitslosigkeit begann zu steigen – möglicherweise eine Folge der kombinierten Auswirkungen einer höheren Inflation und der gestiegenen Zinssätze.

Trotz dieser Herausforderungen blieb der britische Arbeitsmarkt während eines großen Teils dieses Berichtszeitraums robust. Die Arbeitslosenquote verzeichnete zwar einige Schwankungen, blieb aber mit einem Höchststand von 4,3 % im Juli 2023 relativ niedrig. Der Rückgang verschiedener Wirtschaftstätigkeiten begann sich jedoch auf dem Arbeitsmarkt in einer steigenden Arbeitslosenquote und einem Rückgang der freien Stellen zu manifestieren.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund (Fortsetzung)

Die Inflation blieb für die geldpolitischen Entscheidungsträger ein zentrales Anliegen. Während die Rate der Gesamtinflation allmählich zurückging, blieben die Kerninflationen, die volatile Posten wie Energie und Lebensmittel ausschließen, erhöht. Dieser anhaltende Inflationsdruck führte in Verbindung mit anderen wirtschaftlichen Herausforderungen zu Diskussionen im geldpolitischen Ausschuss der BoE („MPC“) über die künftige Entwicklung der Zinssätze. Im September 2023 beschloss die BoE, die Zinssätze bei 5,25 % zu belassen, wobei einige Offizielle für eine längere Phase mit stabilen Zinssätzen plädierten.

Der Geldmarkt, angezeigt durch den Sterling Overnight Index Average („SONIA“), unterlag im Jahresverlauf unterschiedlichen Bewegungen. Während es zwar periodische Aufwärtstrends gab, die die Erwartung des Marktes auf weitere Zinserhöhungen widerspiegeln, gab es auch rückläufige Phasen. Letztere deuten auf eine Marktmeinung hin, der zufolge die BoE die Geldpolitik möglicherweise nicht so aggressiv straffen muss wie zuvor angenommen.

Zusammenfassend lässt sich feststellen, dass die wirtschaftlichen Aussichten des Vereinigten Königreichs von 2022 bis 2023 von inflationsbedingten Herausforderungen, geldpolitischen Anpassungen und Anzeichen einer wirtschaftlichen Belastung geprägt waren. Die geldpolitischen Entscheidungen der BoE spielten eine zentrale Rolle bei der Bewältigung dieser Herausforderungen, wobei sich durch die breiteren Wirtschaftsindikatoren ein gemischtes Bild von Widerstandsfähigkeit und Anfälligkeit ergibt.

Während des gesamten Jahres bevorzugte der Fonds, insbesondere angesichts von Unsicherheiten und Zinserhöhungen, durchweg kurzfristige Anlagen. Im vierten Quartal 2022 zog es der Fonds aufgrund der teuren US-Staatsanleihen vor, Barmittel in kurzfristige Repos zu investieren. Dieser vorsichtige Ansatz wurde auch im ersten Quartal 2023 beibehalten. Dabei lag der Schwerpunkt auf 1-, 3- und 6-monatigen US-Staatsanleihen, solange sie angemessen vergütet wurden. Im zweiten Quartal nutzte der Fonds die von der BoE vorgenommenen Zinserhöhungen und hielt die WAM im Bereich von 15-25 Tagen. Im dritten Quartal beobachtete der Fonds beim Umfang der wöchentlichen Freitagsauktionen Schwankungen und verlängerte seine Duration durch den Erwerb von 4-monatigen Wechselschuldverschreibungen für Januar.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2023 und 30. September 2022 angegeben:

30. September 2023		30. September 2022	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Sonstige Repogeschäfte	60,53 %	Treasury-Repogeschäft	61,54 %
Government Agency-Repogeschäft	29,29 %	Government Agency-Repogeschäft	24,41 %
Treasury Debt	10,18 %	Treasury Debt	14,05 %

BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund

Die Strategie des Fonds zeichnete sich angesichts der volatilen Marktsituation und der Zinsänderungen das ganze Jahr über durch einen vorsichtigen Ansatz aus. Im vierten Quartal 2022 behielt der Fonds ein hohes Maß an wöchentlicher Liquidität bei und konzentrierte sich auf festverzinsliche Anlagen mit kurzen Laufzeiten. Im ersten Quartal 2023 blieb der Fonds bei seinem vorsichtigen Ansatz, indem er die Duration kürzer werden ließ und die Laufzeiten bis Anfang April kurz hielt. Im zweiten Quartal fügte der Fonds 1-jährige Floaters zu SONIA +50 Basispunkten hinzu, um den Anstieg der Niveaus für Tagesgeldanlagen zu nutzen. Gegen Ende des dritten Quartals begann der Fonds damit, die Duration zu erhöhen und strebte eine WAM von etwa 45 Tagen an.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2023 und 30. September 2022 angegeben:

30. September 2023		30. September 2022	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Einlagenzertifikat	24,57 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	30,57 %
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	21,95 %	Einlagenzertifikat	29,07 %
Treasury-Repogeschäft	20,00 %	Sonstige Papiere	10,47 %
Commercial Paper von Finanzunternehmen	16,52 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	8,78 %
Sonstige Papiere	7,04 %	Treasury-Repogeschäft	8,14 %
Government Agency-Repogeschäft	5,64 %	Government Agency-Repogeschäft	4,80 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	3,33 %	Sonstige Commercial Paper	4,58 %
Sonstige Commercial Paper	0,96 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	3,59 %

BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund

Die Strategie des Fonds zeichnete sich angesichts der volatilen Marktsituation und der Zinsänderungen das ganze Jahr über durch einen vorsichtigen Ansatz aus. Im vierten Quartal 2022 behielt der Fonds ein hohes Maß an wöchentlicher Liquidität bei und konzentrierte sich auf festverzinsliche Anlagen mit kurzen Laufzeiten. Im ersten Quartal 2023 blieb der Fonds bei seinem vorsichtigen Ansatz, indem er die Duration kürzer werden ließ und die Laufzeiten bis Anfang April kurz hielt. Im zweiten Quartal fügte der Fonds 1-jährige Floaters zu SONIA +50 Basispunkten hinzu, um den Anstieg der Niveaus für Tagesgeldanlagen zu nutzen. Gegen Ende des dritten Quartals begann der Fonds damit, die Duration zu erhöhen und strebte eine WAM von etwa 45 Tagen an.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2023 und 30. September 2022 angegeben:

30. September 2023		30. September 2022	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Einlagenzertifikat	39,52 %	Einlagenzertifikat	38,55 %
Commercial Paper von Finanzunternehmen	18,00 %	Sonstige Papiere	14,74 %
Treasury-Repogeschäft	13,30 %	Treasury-Repogeschäft	14,73 %
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	11,80 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	14,24 %
Sonstige Papiere	10,36 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	8,52 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	2,62 %	Government Agency-Repogeschäft	3,43 %
Government Agency-Repogeschäft	2,04 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	3,02 %
Finanzierungsvereinbarung von Versicherungsgesellschaften	1,47 %	Sonstige Commercial Paper	2,32 %
Treasury Debt	0,51 %	Treasury Debt	0,45 %
Sonstige Commercial Paper	0,38 %		

BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund

Die Strategie des Fonds zeichnete sich über das gesamte Jahr hinweg durch einen vorsichtigen Ansatz aus, insbesondere während des Zinserhöhungszyklus. Im vierten Quartal des Jahres 2022 behielt der Fonds eine hohe tägliche Liquidität bei und konzentrierte sich auf Wertpapiere mit kurzen Laufzeiten, wobei er Gelegenheiten in Euro, dem US-Dollar und dem kanadischen Dollar auslotete. Diese defensive Haltung wurde auch im ersten Quartal 2023 beibehalten, wobei der Schwerpunkt auf sehr kurzen Laufzeiten lag. Im zweiten Quartal nutzte der Fonds die Preisanpassungen am Markt und investierte in Emittenten mit einer hohen Bonität. Im dritten Quartal diversifizierte der Fonds sein Portfolio über verschiedene Laufzeiten und Bonitätsratings, um so die Erträge zu optimieren und gleichzeitig das Risiko zu steuern.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2023 und 30. September 2022 angegeben:

30. September 2023		30. September 2022	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Einlagenzertifikat	32,83 %	Einlagenzertifikat	29,83 %
Commercial Paper von Finanzunternehmen	30,76 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	24,41 %
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	14,74 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	16,77 %
Sonstige Commercial Paper	11,04 %	Sonstige Commercial Paper	11,78 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	7,21 %	Sonstige Papiere	7,86 %
Investmentgesellschaft	3,42 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	5,32 %
		Investmentgesellschaft	4,02 %

BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund

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

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2023 und 30. September 2022 angegeben:

30. September 2023		30. September 2022	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Commercial Paper von Finanzunternehmen	33,98 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	28,45 %
Einlagenzertifikat	25,85 %	Einlagenzertifikat	27,65 %
Government Agency-Repogeschäft	22,26 %	Government Agency-Repogeschäft	22,30 %
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	7,78 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	12,47 %
Treasury-Repogeschäft	3,04 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	5,43 %
Sonstige Commercial Paper	2,93 %	Sonstige Commercial Paper	2,99 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	2,42 %	Treasury-Repogeschäft	0,49 %
Treasury Debt	1,11 %	Sonstige Papiere	0,21 %
Sonstige Papiere	0,64 %		

BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund

Das wirtschaftliche Umfeld in den Vereinigten Staaten war in den Jahren 2022 bis 2023 von einer Reihe geldpolitischer Anpassungen, Inflationsorgen und fiskalpolitischen Herausforderungen geprägt. Der Offenmarktausschuss der US-Notenbank (Federal Open Market Committee, „FOMC“) reagierte auf die sich verändernden wirtschaftlichen Bedingungen mit Entschlossenheit und einer Reihe von Zinserhöhungen. Sie führten dazu, dass die Leitzinsen bis zum dritten Quartal 2023 eine Spanne von 5,25-5,50 % erreichten.

Die Inflation blieb während dieses Berichtszeitraums ein zentrales Anliegen. Die VPI-Daten wiesen Schwankungen auf. Sie kletterten 2022 auf einen Höchststand von 7,1 % im Jahresvergleich und gingen dann bis zum dritten Quartal 2023 allmählich auf etwa 3,67 % zurück. Das bevorzugte Inflationsbarometer der US-Notenbank – die Kernaussgaben für den persönlichen Verbrauch – deutete ebenfalls auf einen erhöhten Inflationsdruck hin und erreichte im Februar 2023 5 %. Die durchgängige Botschaft der Fed war ihre Absichtserklärung, die Inflation wieder auf ihr Ziel von 2 % zurückzuführen. Sie betonte, dass ein nachhaltiger Rückgang der Kerninflation erforderlich sei, bevor sie eine Beendigung der geldpolitischen Straffung in Betracht ziehe.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund (Fortsetzung)

US-Staatsanleihen sahen sich mit Herausforderungen im Zusammenhang mit der Schuldenobergrenze konfrontiert, was zu Unsicherheiten am Markt führte. Im Juni 2023 wurde die Schuldenobergrenze jedoch noch in letzter Minute bis Januar 2025 ausgesetzt, was mit Erleichterung aufgenommen wurde und den Fokus auf den Wiederaufbau der Staatsfinanzen verlagerte. Dies führte zu einem starken Anstieg des Angebots an US-Staatsanleihen, was Auswirkungen für die Geldmärkte und das Portfoliomanagement hatte.

Der Arbeitsmarkt zeigte sich widerstandsfähig, mit einem starken Beschäftigungswachstum in bestimmten Sektoren wie dem Bildungs- und Gesundheitswesen. Die Arbeitslosenquote stieg jedoch leicht an und erreichte im dritten Quartal 2023 mit 3,8 % den höchsten Stand seit Januar 2022.

Der Geldmarkt, angezeigt durch die Secured Overnight Financing Rate (besicherte Tagesgeldfinanzierungen, „SOFR“), unterlag im Jahresverlauf unterschiedlichen Bewegungen. Während es zwar Phasen mit Aufwärtstrend gab, die die Erwartung des Marktes auf weitere Zinserhöhungen widerspiegeln, gab es auch rückläufige Phasen. Letztere deuten auf eine Marktmeinung hin, der zufolge die US-Notenbank die Geldpolitik möglicherweise nicht so aggressiv straffen muss wie zuvor angenommen.

Fazit: Die US-Wirtschaftsaussichten für die Jahre 2022 bis 2023 war durch den proaktiven Ansatz der Fed zur Steuerung der Inflation, die Herausforderungen im Zusammenhang mit der Schuldenobergrenze und einen antagonistischen Arbeitsmarkt mit Stärken und Anzeichen von Spannungen gekennzeichnet sind. Die geldpolitischen Entscheidungen der Fed, geleitet von datenabhängigen Erwägungen, spielten eine zentrale Rolle bei der Bewältigung dieser Herausforderungen, wobei sich durch die breiteren Wirtschaftsindikatoren ein gemischtes Bild von Widerstandsfähigkeit und Anfälligkeit ergibt.

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

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2023 und 30. September 2022 angegeben.

30. September 2023		30. September 2022	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Commercial Paper von Finanzunternehmen	34,00 %	Einlagenzertifikat	31,31 %
Einlagenzertifikat	30,72 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	26,39 %
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	14,59 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	15,66 %
Government Agency-Repogeschäft	12,99 %	Government Agency-Repogeschäft	13,75 %
Sonstige Commercial Paper	3,25 %	Treasury-Repogeschäft	5,59 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	1,71 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	3,68 %
Treasury Debt	1,24 %	Sonstige Commercial Paper	3,32 %
Treasury-Repogeschäft	1,09 %	Sonstige Papiere	0,30 %
Sonstige Papiere	0,41 %		

BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund

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

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2023 und 30. September 2022 angegeben:

30. September 2023		30. September 2022	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Einlagenzertifikat	32,18 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	33,23 %
Commercial Paper von Finanzunternehmen	31,69 %	Sonstige Commercial Paper	28,51 %
Sonstige Commercial Paper	22,03 %	Einlagenzertifikat	24,31 %
Sonstige Papiere	5,53 %	Investmentgesellschaft	4,51 %
Investmentgesellschaft	4,54 %	Sonstige Papiere	3,58 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	1,79 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	2,88 %
Treasury Debt	1,63 %	Sonstige	2,64 %
Finanzierungsvereinbarung von Versicherungsgesellschaften	0,60 %	Finanzierungsvereinbarung von Versicherungsgesellschaften	0,32 %
		Sonstige Kommunalschuldverschreibungen	0,01 %

BlackRock ICS US Treasury Fund

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS US Treasury Fund (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2023 und 30. September 2022 angegeben:

30. September 2023		30. September 2022	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Treasury-Repogeschäft	56,63 %	Treasury-Repogeschäft	58,15 %
Treasury Debt	43,37 %	Treasury Debt	41,85 %

BlackRock Investment Management (UK) Limited
BlackRock Capital Management, Inc.
Oktober 2023

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES VERWALTUNGSRATS

Der Verwaltungsrat legt seinen Bericht zusammen mit dem geprüften Abschluss für das am 30. September 2023 beendete Geschäftsjahr vor.

Erklärung über die Obliegenheiten des Verwaltungsrats

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

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

Bei der Erstellung dieser Abschlüsse ist der Verwaltungsrat gehalten:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Ergebnisse und Dividenden

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

Die Verwaltungsgesellschaft hat erfolgreich den Status eines meldepflichtigen Fonds („Reporting Fund“) für bestimmte Anteilklassen gemäß der britischen Rechtsverordnung 2009/3001 (The Offshore Funds (Tax) Regulations 2009) beantragt. Eine Liste der Anteilklassen, die derzeit „Reporting Fund“-Status haben, ist abrufbar unter <https://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds>.

Rückblick und zukünftige Entwicklungen

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

Risikomanagementziele und -strategien

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES VERWALTUNGSRATS (Fortsetzung)

Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres

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

Beteiligungen und Geschäfte von Verwaltungsratsmitgliedern und Secretary

Die Verwaltungsratsmitglieder und der Secretary besaßen weder während noch am Ende des Geschäftsjahres Beteiligungen an den Anteilen des Unternehmens (2022: null).

Mit Wirkung vom 29. März 2023 schied Karen Prooth als nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied aus. Mit Wirkung vom 21. Juli 2023 schied Jacqueline Flynn als nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied aus. Mit Wirkung vom 5. Dezember 2023 schied Becky Tilston Hales als nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied aus. Mit Wirkung vom 5. Dezember 2023 wurde Francis Drought zum nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglied bestellt.

Francis Drough und Tom McGrath sind nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder und ebenfalls Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe.

Kein Verwaltungsratsmitglied hatte zu irgendeinem Zeitpunkt während des Geschäftsjahres eine wesentliche Beteiligung an einem Vertrag mit Signifikanz für die Geschäftstätigkeit des Unternehmens (2022: null).

Unternehmensfortführung

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

Unabhängige Abschlussprüfer

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

Erklärung zu prüfungsrelevanten Informationen

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

Corporate-Governance-Erklärung

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

Für die Verwaltungsratsmitglieder

Verwaltungsratsmitglied

24. Januar 2024

Verwaltungsratsmitglied

24. Januar 2024

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DER VERWAHRSTELLE AN DIE ANTEILINHABER

Wir, die J.P. Morgan SE – Zweigniederlassung Dublin, ernannte Verwahrstelle für die Institutional Cash Series plc (das „Unternehmen“), legen diesen Bericht ausschließlich für die Anleger des Unternehmens als Gesamtheit für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 (die „Rechnungsperiode“) vor. Dieser Bericht wird in Übereinstimmung mit den OGAW-Vorschriften – die Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 (Durchführungsverordnung Nr. 352 von 2011) in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Vorschriften“) erstellt. Durch Vorlage dieses Berichts übernehmen wir keine Verantwortung für einen anderen Zweck oder gegenüber anderen Personen, denen dieser Bericht gezeigt wird.

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

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

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

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

Für und im Namen von

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

24. Januar 2024

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

Bericht über die Prüfung des Jahresabschlusses

Prüfvermerk

Wir haben den Abschluss der Institutional Cash Series plc (die „Gesellschaft“) für das am 30. September 2023 beendete Geschäftsjahr geprüft, der sich zusammensetzt aus der Gewinn- und Verlustrechnung, der Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens, der Bilanz, der Aufstellung der Vermögenswerte und den Anmerkungen zum Jahresabschluss, einschließlich der in Anmerkung 2 enthaltenen Zusammenfassung wesentlicher Bilanzierungsgrundsätze. Der Jahresabschluss wurde gemäß geltender irischer Gesetze und FRS 102, dem vom Financial Reporting Council herausgegebenen für das Vereinigte Königreich und die Republik Irland geltenden Bilanzierungsstandard, erstellt.

Unserer Auffassung nach vermittelt der Jahresabschluss:

- ein wahrheitsgetreues und angemessenes Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und Finanzlage der Gesellschaft zum 30. September 2023 und ihrer Ergebnisse für das dann endende Geschäftsjahr;
- wurde er gemäß den Bestimmungen von FRS 102, dem im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendende Bilanzierungsstandard, ordnungsgemäß aufgestellt; und
- wurde er gemäß den Bestimmungen des Companies Act von 2014, der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 und des Central Bank (Supervision and Enforcement Act) 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2015 ordnungsgemäß aufgestellt.

Grundlage des Prüfvermerks

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

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

Schlussfolgerungen im Zusammenhang mit der fortgeführten Geschäftstätigkeit

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

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

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

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

Sonstige Angaben

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

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

Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

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

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

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

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

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

Sachverhalte, zu denen wir ausnahmsweise Bericht erstatten müssen

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

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

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

Jeweilige Aufgaben

Aufgaben des Verwaltungsrats im Zusammenhang mit dem Jahresabschluss

Wie in der Erklärung über Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats auf Seite 15 näher erläutert, ist der Verwaltungsrat für die Aufstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit den geltenden Rechnungslegungsvorschriften zuständig und muss sich vergewissern, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt. Er ist außerdem für die nach seiner Auffassung erforderlichen internen Kontrollen verantwortlich, um eine Aufstellung von Abschlüssen zu ermöglichen, die keine wesentlichen Falschangaben enthalten, ob aufgrund von Betrug oder Irrtum.

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

Aufgaben der Abschlussprüfer im Zusammenhang mit der Abschlussprüfung

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

Eine ausführlichere Beschreibung unserer Aufgaben im Zusammenhang mit der Abschlussprüfung ist der Website der IAASA zu entnehmen unter: http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf.

Diese Beschreibung ist Bestandteil unseres Berichts der Abschlussprüfer.

Der Zweck unserer Prüfungshandlungen und wem gegenüber wir verantwortlich sind

Dieser Bericht richtet sich ausschließlich an die Anteilhaber der Gesellschaft in ihrer Gesamtheit, in Übereinstimmung mit Section 391 des Companies Act von 2014. Unsere Prüfungsarbeit wurde so durchgeführt, dass wir den Anteilhabern der Gesellschaft diejenigen Fakten mitteilen konnten, die ihnen in einem Bericht der Abschlussprüfer mitgeteilt werden müssen, nicht aber zu einem anderen Zweck. Soweit es das Gesetz zulässt, akzeptieren bzw. übernehmen wir die Verantwortung für unsere Prüfung, diesen Bericht bzw. die Meinungen, die wir uns gebildet haben, lediglich gegenüber der Gesellschaft und den Anteilhabern der Gesellschaft als Gesamtheit.

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

Firmensitz: Dublin

Datum: 24. Januar 2024

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

		Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	Anm.	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR
Betriebliche Erträge	5	6.782.550	1.007.854	17.501	1.036	21.197	4	167.434	2.132
Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten	7	3.760	(29.808)	502	(1.617)	–	–	840	(2.253)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)		6.786.310	978.046	18.003	(581)	21.197	4	168.274	(121)
Betriebliche Aufwendungen	6	(181.583)	(146.661)	(387)	(431)	(892)	(19)	(4.450)	(2.851)
Negative Rendite auf finanzielle Vermögenswerte		–	(199.373)	–	(2.465)	–	(307)	–	(26.467)
Betriebliche Nettoerträge/(-aufwendungen)		6.604.727	632.012	17.616	(3.477)	20.305	(322)	163.824	(29.439)
Finanzierungskosten:									
Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen	8	(714)	(6)	–	–	–	–	(818)	–
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	9	(4.206.939)	(710.986)	–	–	(4.325)	–	–	–
Finanzierungskosten insgesamt		(4.207.653)	(710.992)	–	–	(4.325)	–	(818)	–
Nettogewinn/(-verlust)		2.397.074	(78.980)	17.616	(3.477)	15.980	(322)	163.006	(29.439)
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens		2.397.074	(78.980)	17.616	(3.477)	15.980	(322)	163.006	(29.439)

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

		BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
	Anm.	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
		Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Betriebliche Erträge	5	1.145.285	14.836	150.477	5.483	150.999	18.974	358.196	57.803
Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten	7	(381)	413	(16.696)	(8.147)	–	–	7.377	(7.812)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)		1.144.904	15.249	133.781	(2.664)	150.999	18.974	365.573	49.991
Betriebliche Aufwendungen	6	(47.527)	(27.630)	(3.762)	(4.132)	(4.283)	(2.057)	(5.805)	(3.869)
Negative Rendite auf finanzielle Vermögenswerte		–	(185.022)	–	(19.339)	–	(163)	–	(123)
Betriebliche Nettoerträge/(-aufwendungen)		1.097.377	(197.403)	130.019	(26.135)	146.716	16.754	359.768	45.999
Finanzierungskosten:									
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	9	(99.195)	–	(652)	–	(14.929)	–	(167.885)	(33.490)
Finanzierungskosten insgesamt		(99.195)	–	(652)	–	(14.929)	–	(167.885)	(33.490)
Nettogewinn/(-verlust)		998.182	(197.403)	129.367	(26.135)	131.787	16.754	191.883	12.509
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens		998.182	(197.403)	129.367	(26.135)	131.787	16.754	191.883	12.509

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

		BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
	Anm.	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
		Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Betriebliche Erträge	5	1.612.795	272.309	83.981	12.883	182.133	37.561	2.735.344	557.000
Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten	7	–	5	6.300	(4.137)	1.323	(2.284)	34	(336)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)		1.612.795	272.314	90.281	8.746	183.456	35.277	2.735.378	556.664
Betriebliche Aufwendungen	6	(39.183)	(34.158)	(1.433)	(1.285)	(1.557)	(1.619)	(66.451)	(69.315)
Negative Rendite auf finanzielle Vermögenswerte		–	(842)	–	(360)	–	–	–	–
Betriebliche Nettoerträge/(-aufwendungen)		1.573.612	237.314	88.848	7.101	181.899	33.658	2.668.927	487.349
Finanzierungskosten:									
Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen	8	–	–	–	–	–	–	(2)	–
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	9	(1.394.416)	(215.271)	(20.545)	(1.297)	(161.604)	(34.381)	(2.135.272)	(413.647)
Finanzierungskosten insgesamt		(1.394.416)	(215.271)	(20.545)	(1.297)	(161.604)	(34.381)	(2.135.274)	(413.647)
Nettogewinn/(-verlust)		179.196	22.043	68.303	5.804	20.295	(723)	533.653	73.702
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens		179.196	22.043	68.303	5.804	20.295	(723)	533.653	73.702

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

		BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	BlackRock ICS US Treasury Fund
	Anm.	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD
Betriebliche Erträge	5	229.542	38.295
Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten	7	7.958	(7.675)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)		237.500	30.620
Betriebliche Aufwendungen	6	(4.504)	(2.701)
Betriebliche Nettoerträge/ (-aufwendungen)		232.996	27.919
Finanzierungskosten:			
Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen	8	–	(8)
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	9	(4.174)	(544)
Finanzierungskosten insgesamt		(4.174)	(552)
Nettogewinn/(-verlust)		228.822	27.367
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens		228.822	27.367

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	170.932.376	148.655.790	801.008	766.794	39.412	63.116	4.911.186	5.217.976
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	2.397.074	(78.980)	17.616	(3.477)	15.980	(322)	163.006	(29.439)
Geschäfte mit Anteilen:								
Ausgabe von rückkaufbaren Anteilen	1.013.129.699	980.677.642	39.621	51.043	3.875.298	27.035	48.338.025	53.056.973
Rücknahme von rückkaufbaren Anteilen	(998.313.618)	(973.440.446)	(174.343)	(13.352)	(2.430.025)	(50.417)	(47.054.746)	(53.334.324)
Wiederangelegte Dividende	1.951.655	259.027	–	–	662	–	–	–
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen	16.767.736	7.496.223	(134.722)	37.691	1.445.935	(23.382)	1.283.279	(277.351)
Nominelle Wechselkursbereinigung*	(7.687.757)	14.859.343	–	–	–	–	–	–
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	182.409.429	170.932.376	683.902	801.008	1.501.327	39.412	6.357.471	4.911.186

* Die nominelle Wechselkursbereinigung ergibt sich sowohl aus der Rückkonvertierung des Nettovermögens zu Beginn des Geschäftsjahres mit dem Wechselkurs vom 30. September 2022 als auch aus der Rückumrechnung der Positionen der Gewinn- und Verlustrechnung und der Geschäfte mit Anteilen mit dem durchschnittlichen Wechselkurs vom 30. September 2023. Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	35.552.647	35.441.389	5.175.821	6.407.229	2.776.444	2.415.663	8.096.237	4.959.189
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	998.182	(197.403)	129.367	(26.135)	131.787	16.754	191.883	12.509
Geschäfte mit Anteilen:								
Ausgabe von rückkaufbaren Anteilen	230.511.462	220.895.535	4.577.394	3.289.532	18.142.100	10.101.372	40.106.462	41.384.560
Rücknahme von rückkaufbaren Anteilen	(220.966.532)	(220.586.874)	(4.786.585)	(4.494.805)	(16.397.073)	(9.757.345)	(39.003.644)	(38.273.827)
Wiederangelegte Dividende	49.262	–	–	–	4.726	–	95.478	13.806
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen	9.594.192	308.661	(209.191)	(1.205.273)	1.749.753	344.027	1.198.296	3.124.539
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	46.145.021	35.552.647	5.095.997	5.175.821	4.657.984	2.776.444	9.486.416	8.096.237

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	33.509.587	36.632.983	1.621.682	2.157.619	4.065.874	3.975.172	63.988.614	57.889.062
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	179.196	22.043	68.303	5.804	20.295	(723)	533.653	73.702
Geschäfte mit Anteilen:								
Ausgabe von rückkaufbaren Anteilen	220.101.505	210.164.734	1.623.342	731.877	38.805.571	47.726.410	376.939.782	401.890.051
Rücknahme von rückkaufbaren Anteilen	(219.145.727)	(213.402.305)	(918.456)	(1.273.618)	(39.058.538)	(47.641.800)	(377.317.681)	(396.012.765)
Wiederangelegte Dividende	687.617	92.132	–	–	49.977	6.815	1.001.664	148.564
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen	1.643.395	(3.145.439)	704.886	(541.741)	(202.990)	91.425	623.765	6.025.850
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	35.332.178	33.509.587	2.394.871	1.621.682	3.883.179	4.065.874	65.146.032	63.988.614

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	BlackRock ICS US Treasury Fund		
	2023	2022	2023	2022
	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	4.347.234	3.059.456	21.521.671	17.759.497
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	228.822	27.367	43.444	3.907
Geschäfte mit Anteilen:				
Ausgabe von rückkaufbaren Anteilen	10.009.777	4.231.528	166.882.824	165.072.917
Rücknahme von rückkaufbaren Anteilen	(10.092.758)	(2.971.117)	(166.260.950)	(161.355.288)
Wiederangelegte Dividende	–	–	322.844	40.638
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen	(82.981)	1.260.411	944.718	3.758.267
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	4.493.075	4.347.234	22.509.833	21.521.671

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BILANZ

Zum 30. September 2023

	Anm.	Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
		2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR
UMLAUFVERMÖGEN									
Zahlungsmittel		6.423.742	5.098.175	18.178	2.480	23.559	3.670	241.746	125.046
Zahlungsmitteläquivalente		248.052	243.894	–	–	–	–	–	–
Bareinschüsse		–	427	–	486	–	–	–	–
Barsicherheiten		108	110	–	–	50	50	–	–
Forderungen	11	688.505	367.505	1.825	1.077	464	–	13.318	5.232
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	182.506.141	169.263.429	663.963	798.983	1.485.200	35.699	6.359.086	4.796.970
Umlaufvermögen insgesamt		189.866.548	174.973.540	683.966	803.026	1.509.273	39.419	6.614.150	4.927.248
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN									
Zahlbare Bareinschüsse		–	517	–	589	–	–	–	–
Verbindlichkeiten	12	7.453.288	4.026.243	64	38	7.946	7	256.679	16.062
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	3.831	14.404	–	1.391	–	–	–	–
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		7.457.119	4.041.164	64	2.018	7.946	7	256.679	16.062
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	14	182.409.429	170.932.376	683.902	801.008	1.501.327	39.412	6.357.471	4.911.186

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Für die Verwaltungsratsmitglieder

Verwaltungsratsmitglied

24. Januar 2024

Verwaltungsratsmitglied

24. Januar 2024

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BILANZ (Fortsetzung)
Zum 30. September 2023

		BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
	Anm.	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
		Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
UMLAUFVERMÖGEN									
Zahlungsmittel		1.732.154	979.670	235.019	189.144	135.549	80.623	325.617	165.027
Zahlungsmitteläquivalente		–	–	–	1.184	–	–	–	–
Barsicherheiten		50	50	25	25	–	–	–	–
Forderungen	11	151.720	27.087	12.394	11.968	6.196	403	30.157	23.429
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	45.812.890	34.832.535	4.850.440	5.633.976	5.745.150	3.101.185	9.732.644	8.174.233
Umlaufvermögen insgesamt		47.696.814	35.839.342	5.097.878	5.836.297	5.886.895	3.182.211	10.088.418	8.362.689
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN									
Verbindlichkeiten	12	1.551.793	286.695	1.881	652.305	1.228.911	405.767	602.002	266.452
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	–	–	–	8.171	–	–	–	–
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		1.551.793	286.695	1.881	660.476	1.228.911	405.767	602.002	266.452
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	14	46.145.021	35.552.647	5.095.997	5.175.821	4.657.984	2.776.444	9.486.416	8.096.237

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BILANZ (Fortsetzung)
Zum 30. September 2023

		BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
	Anm.	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD
UMLAUFVERMÖGEN									
Zahlungsmittel		1.700.184	991.797	101.130	60.204	140.902	140.109	1.948.269	1.926.760
Zahlungsmitteläquivalente		–	–	85.000	70.000	–	–	–	–
Forderungen	11	285.061	175.591	4.280	10.019	8.358	4.619	162.985	92.179
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	33.983.478	33.472.882	2.401.068	1.541.599	3.939.198	4.045.079	66.497.896	63.212.638
Umlaufvermögen insgesamt		35.968.723	34.640.270	2.591.478	1.681.822	4.088.458	4.189.807	68.609.150	65.231.577
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN									
Verbindlichkeiten	12	636.545	1.130.683	195.749	54.734	205.279	123.933	3.463.118	1.242.963
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	–	–	858	5.406	–	–	–	–
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		636.545	1.130.683	196.607	60.140	205.279	123.933	3.463.118	1.242.963
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	14	35.332.178	33.509.587	2.394.871	1.621.682	3.883.179	4.065.874	65.146.032	63.988.614

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BILANZ (Fortsetzung)
Zum 30. September 2023

		BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Treasury Fund	
	Anm.	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD
UMLAUFVERMÖGEN					
Zahlungsmittel		23.288	42.721	583.687	859.380
Zahlungsmitteläquivalente		199.013	192.958	–	–
Forderungen	11	44.660	30.222	36.546	4.985
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	4.269.391	4.101.646	22.102.897	20.755.918
Umlaufvermögen insgesamt		4.536.352	4.367.547	22.723.130	21.620.283
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN					
Verbindlichkeiten	12	39.648	19.636	213.297	98.612
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	3.629	677	–	–
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		43.277	20.313	213.297	98.612
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen					
	14	4.493.075	4.347.234	22.509.833	21.521.671

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS

1. Allgemeine Informationen

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

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

2.1 Grundlage für die Aufstellung des Abschlusses

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

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

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

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

Die wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze und Anmerkungen, die alle für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 gelten, sind nachstehend aufgeführt. Alle Beträge wurden auf Tausend gerundet, sofern nicht anders angegeben.

2.2 Finanzinstrumente

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

2.2.1 Klassifizierung

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

2.2.2 Erfassung und Ausbuchung

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

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

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

2.2.3 Bemessungsgrundlage

Alle Finanzinstrumente werden erstmalig zum beizulegenden Zeitwert erfasst.

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

2.2 Finanzinstrumente (Fortsetzung)

2.2.4 Bestimmung des beizulegenden Zeitwertes

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

- Anlagen in Schuldinstrumenten und börsengehandelten Derivaten, die an einem Markt oder einer Börse notiert oder gehandelt werden, werden auf der Grundlage der notierten Preise bewertet, die zu Abschlusszwecken der im Prospekt des Unternehmens beschriebenen Bewertungsmethode entsprechen. Je nach Art der zugrunde liegenden Anlage kann der Wert entweder zum Schlusskurs, zum Mittelkurs bei Handelsschluss oder zum Geldkurs am jeweiligen Markt ermittelt werden.
- Die Bewertung von Anlagen in börsengehandelte Fonds („ETF“), die an einem Markt oder einer Börse notiert, gelistet oder gehandelt werden, erfolgt auf der Grundlage der notierten Marktpreise bewertet, es sei denn, der Fonds handelt die von ihm gehaltenen Anteile in der Regel zum letzten NIW für diesen ETF. In solchen Fällen wird die Anlage in den ETF auf der Grundlage des letzten NIW des jeweiligen ETF bewertet.
- Anlagen in zentral geclearten Derivaten werden mittels Bewertungstechniken bewertet.
- Anlagen in Liquiditätspapieren wie beispielsweise Termineinlagen und umgekehrten Repogeschäften werden zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet. Angesichts der kurzfristigen Natur solcher Anlagen wird diese Methode als äquivalent zum beizulegenden Zeitwert betrachtet.

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

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

2.2.5 Finanzderivate und andere spezifische Instrumente

2.2.5.1 Terminkontrakte (Futures)

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

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

2.2.5.2 Devisenterminkontrakte

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

2.2.5.3 Umgekehrte Repogeschäfte

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

2.2.6 Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

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

2.2.7 Sachsicherheiten und Barsicherheiten

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

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

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

2.2.8 Rückkaufbare Anteile

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

2.2 Finanzinstrumente (Fortsetzung)

2.2.8 Rückkaufbare Anteile (Fortsetzung)

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

2.3 Fremdwährungen

2.3.1 Funktionale Währung und Darstellungswährung

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

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

Die Darstellungswährung der Abschlüsse des Unternehmens ist GBP.

2.3.2 Transaktionen und Salden

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

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

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

2.4 Kritische Bilanzschätzungen und -beurteilungen

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

2.4.1 Annahmen und Schätzungsunsicherheiten

2.4.1.1 Zeitwert der OTC-DFI

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

2.4.1.2 Zeitwert von nicht an einem aktiven Markt notierten Finanzinstrumenten

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

2.4.2 Beurteilungen

2.4.2.1 Bewertung als Anlageunternehmen

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

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

2.5 Zinserträge und Zinsaufwendungen

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

2.6 Gebühren und Aufwendungen

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

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

2.7 Negative Rendite auf finanzielle Vermögenswerte

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

2.8 Ausschüttungen

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

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

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

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

3. Finanzielle Risiken

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

3.1 Risikomanagementrahmen

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

3.2 Marktrisiko

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

Der Fonds ist durch seine Anlagen in Schuldtiteln, Aktieninstrumenten und Derivaten einem Marktrisiko ausgesetzt.

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

Die VaR-Berechnungen basieren auf einem angepassten, historischen Simulationsmodell mit einem Konfidenzniveau von 99 %, einer Haltedauer von einem Tag und einem historischen Beobachtungszeitraum von mindestens 1 Jahr (250 Tage). Ein VaR-Wert wird anhand einer gegebenen Wahrscheinlichkeit und eines gegebenen Zeithorizonts ermittelt. Ein VaR mit einem Konfidenzniveau von 99 % und einer Haltedauer von einem Tag bedeutet, dass der mögliche Verlust des Fonds von einem Tag zum nächsten mit einer Wahrscheinlichkeit von 99 % diesen Wert in Prozent nicht überschreiten wird. Höhere VaR-Werte deuten deshalb auf ein höheres Risiko hin.

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

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

Name des Fonds	2023 %	2022 %
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund	0,03	0,04
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	0,01	0,00
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	0,02	0,01
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	0,02	0,02
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	0,02	0,02
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	0,00	0,01
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	0,02	0,03
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	0,02	0,03

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzrisiko (Fortsetzung)

3.2 Marktrisiko (Fortsetzung)

Name des Fonds	2023 %	2022 %
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	0,04	0,07
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	0,01	0,02
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	0,01	0,02
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	0,02	0,03
BlackRock ICS US Treasury Fund	0,00	0,01

3.2.1 Aus dem Fremdwährungsrisiko entstehendes Marktrisiko

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

Bestehendes Fremdwährungsrisiko

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

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

Alle oder im Wesentlichen alle Anlagen der einzelnen Fonds lauten auf die funktionale Währung des jeweiligen Fonds und waren daher zum 30. September 2023 und zum 30. September 2022 keinem direkten Fremdwährungsrisiko ausgesetzt.

3.2.2 Aus dem Zinsrisiko entstehendes Marktrisiko

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

Bestehendes Zinsrisiko

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

Steuerung des Zinsrisikos

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

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

3.2.3 Aus dem Preisrisiko entstehendes Marktrisiko

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

Bestehendes Preisrisiko

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

Steuerung des Preisrisikos

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

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

3.3 Liquiditätsrisiko

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

Bestehendes Liquiditätsrisiko

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzrisiko (Fortsetzung)

3.3 Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Bestehende Liquiditätsrisiken (Fortsetzung)

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

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

Steuerung des Liquiditätsrisikos

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

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

Keiner der Vermögenswerte der Fonds unterliegt speziellen Liquiditätsvereinbarungen.

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

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

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

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

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

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

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

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

3.4 Kontrahentenausfallrisiko

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

Bestehendes Kontrahentenausfallrisiko

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzrisiko (Fortsetzung)

3.4 Kontrahentenausfallrisiko (Fortsetzung)

Steuerung des Kontrahentenausfallrisikos

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

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

Zum 30. September 2023 und 30. September 2022 bestanden keine überfälligen oder wertgeminderten Salden im Zusammenhang mit Transaktionen mit Kontrahenten.

3.4.1 DFI

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

3.4.1.1 Börsengehandelte DFI

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

3.4.1.2 OTC-DFI

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

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

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

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

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

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

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzrisiko (Fortsetzung)

3.4 Kontrahentenausfallrisiko (Fortsetzung)

3.4.1 DFI (Fortsetzung)

3.4.1.2 OTC-DFI (Fortsetzung)

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

3.4.2 Verwahrstelle

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

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

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

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

Das langfristige Rating der Muttergesellschaft der Verwahrstelle zum 30. September 2023 beträgt A+ (30. September 2022: A+) (Standard & Poor's Rating).

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

3.4.3 Emittentenausfallrisiko in Bezug auf Schuldinstrumente

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

Das Kreditrating für alle gehaltenen Schuldverschreibungen war Investment-Grade.

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

3.4.4 Emittentenausfallrisiko in Bezug auf umgekehrte Repogeschäfte

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

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

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

Name des Fonds	Währung	Wert der umgekehrten Repogeschäften	Wert der erhaltenen Sicherheiten	Wert der umgekehrten Repogeschäften	Wert der erhaltenen Sicherheiten
		30. September 2023 Tsd.	Tsd.	30. September 2022 Tsd.	Tsd.
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	EUR	1.334.000	1.373.737	16.000	16.447

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzrisiko (Fortsetzung)

3.4 Kontrahentenausfallrisiko (Fortsetzung)

3.4.4. Emittentenausfallrisiko in Bezug auf umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung)

Name des Fonds	Währung	Wert der umgekehrten Repogeschäften	Wert der erhaltenen Sicherheiten	Wert der umgekehrten Repogeschäften	Wert der erhaltenen Sicherheiten
		30. September 2023 Tsd.	Tsd.	30. September 2022 Tsd.	Tsd.
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	EUR	700.000	720.357	100.000	102.062
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	EUR	5.121.000	5.233.515	3.544.500	3.606.019
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	GBP	4.908.597	4.947.101	2.665.178	2.714.171
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	GBP	2.500.460	2.518.539	1.059.324	1.088.038
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	GBP	5.230.562	5.253.513	6.081.504	6.195.892
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	USD	998.120	1.020.627	923.000	938.782
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	USD	9.380.100	9.570.557	12.230.000	12.414.819
BlackRock ICS US Treasury Fund	USD	12.531.000	12.728.208	12.060.001	12.153.051

Am 30. September 2023 und 30. September 2022 setzen sich die Sicherheiten überwiegend aus Schuldsinstrumenten zusammen.

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie

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

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

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

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

Zu den spezifischen Bewertungstechniken, die zur Bewertung von Finanzinstrumenten der Ebene 2 und/oder Ebene 3 verwendet wurden, gehören:

- (i) für Schuld- und Aktieninstrumente die Verwendung von notierten Marktpreisen oder Händlernoteierungen für ähnliche Instrumente;
- (ii) für Anlagen, bei denen es sich um einen Beteiligungsanteil an einem Investmentfonds („CIS“) und Investitionen in börsengehandelte Indexfonds („ETFs“) handelt, wenn der Fonds die von ihm gehaltenen Anteile in der Regel zum letzten NIW für diesen ETF handelt, die Bewertung zum ungeprüften NIW bzw., wenn verfügbar, zum unabhängig geprüften NIW, am Bewertungstag dieses Beteiligungsanteils anhand der Berechnung durch den Verwalter des Beteiligungsanteils des CIS und gemäß den Anforderungen des Organismus, an dem die betreffende Anlage einen Anteil oder eine Beteiligung darstellt. Der ungeprüfte NIW des zugrunde liegenden Beteiligungsanteils an einem CIS und ETF wird vor Abzug von Rücknahmekosten ausgewiesen, die gegebenenfalls bei einer Rückgabe an diesen zugrunde liegenden CIS und ETF anfallen können. Der ungeprüfte NIW des zugrunde liegenden CIS und ETF, in den investiert wird, kann bei Ausgabe seines jeweiligen unabhängig geprüften Jahresabschlusses Berichtigungen unterliegen, und solche Berichtigungen können für den Abschluss des Fonds wesentlich sein;
- (iii) für ausländische Aktien die Verwendung unabhängiger Zeitwert-Anpassungsfaktoren, um die Differenz zwischen dem letzten Marktschluss und dem Bewertungszeitpunkt jedes Fonds widerzuspiegeln;
- (iv) für notleidende Schuldtitel die Verwendung jüngster Transaktionen und notleidender Aktieninstrumente, für die keine Marktdaten verfügbar sind;
- (v) für Zinsswaps der Barwert der geschätzten künftigen Cashflows auf der Grundlage beobachtbarer Renditekurven;
- (vi) bei Total Return Swaps der Wert der geschätzten Cashflows auf der Grundlage des Marktwertes der zugrunde liegenden Referenzanlage bzw. des zugrunde liegenden Benchmarkindex am Bilanzstichtag;
- (vii) für Inflationsswaps der Barwert der geschätzten künftigen Cashflows auf der Grundlage beobachtbarer Renditekurven. Für den Fall, dass das Modell und die Parameter nicht am Markt beobachtbar sind, können bestimmte Nullkupon-Inflationsswaps anhand eines einzigen Kurses des Swap-Kontrahenten bewertet werden.
- (viii) bei Devisentermingeschäften der Barwert zukünftiger Cashflows auf der Grundlage der Devisenterminkurse am Bilanzstichtag;
- (ix) für Zusagen im Zusammenhang mit SPAC/PIPE (Special Purpose Acquisition Company, Private Investment in Public Equity) die Verwendung der zugrunde liegenden notierten Marktpreise und die Anwendung von Abschlägen für mangelnde Marktfähigkeit, Volatilität und Handelsabschlusswahrscheinlichkeit;
- (x) für Fremdwahrungsoptionen, Optionspreismodelle; und
- (xi) für andere Finanzinstrumente: Discounted-Cashflow-Analysen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

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

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

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

Die folgenden Tabellen zeigen eine Analyse der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten der einzelnen Fonds zum 30. September 2023 und 30. September 2022:

30. September 2023	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Gesamt
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	200.271	–	200.271
Einlagenzertifikate	–	150.704	–	150.704
Anleihen	–	312.988	–	312.988
Gesamt	–	663.963	–	663.963
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	151.200	–	151.200
Umgekehrte Repogeschäfte	–	1.334.000	–	1.334.000
Gesamt	–	1.485.200	–	1.485.200
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	1.914.682	–	1.914.682
Einlagenzertifikate	–	1.693.656	–	1.693.656
Termineinlagen	–	1.724.877	–	1.724.877
Anleihen	–	325.871	–	325.871
Umgekehrte Repogeschäfte	–	700.000	–	700.000
Gesamt	–	6.359.086	–	6.359.086
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	17.274.580	–	17.274.580
Einlagenzertifikate	–	11.675.889	–	11.675.889
Termineinlagen	–	6.569.025	–	6.569.025
Anleihen	–	5.172.396	–	5.172.396
Umgekehrte Repogeschäfte	–	5.121.000	–	5.121.000
Gesamt	–	45.812.890	–	45.812.890
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	1.264.613	–	1.264.613
Einlagenzertifikate	–	1.119.957	–	1.119.957
Termineinlagen	–	412.517	–	412.517
Anleihen	–	2.053.353	–	2.053.353
Gesamt	–	4.850.440	–	4.850.440
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	836.553	–	836.553
Umgekehrte Repogeschäfte	–	4.908.597	–	4.908.597
Gesamt	–	5.745.150	–	5.745.150
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Termineinlagen	–	2.140.639	–	2.140.639
Einlagenzertifikate	–	2.379.514	–	2.379.514
Commercial Papers	–	2.029.737	–	2.029.737
Anleihen	–	682.294	–	682.294
Umgekehrte Repogeschäfte	–	2.500.460	–	2.500.460
Gesamt	–	9.732.644	–	9.732.644

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

30. September 2023 (Fortsetzung)	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Gesamt
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Einlagenzertifikate	–	13.381.994	–	13.381.994
Commercial Papers	–	7.161.486	–	7.161.486
Termineinlagen	–	4.025.627	–	4.025.627
Anleihen	–	4.183.809	–	4.183.809
Umgekehrte Repogeschäfte	–	5.230.562	–	5.230.562
Gesamt	–	33.983.478	–	33.983.478
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Einlagenzertifikate	–	1.128.504	–	1.128.504
Commercial Papers	–	905.982	–	905.982
Termineinlagen	–	366.570	–	366.570
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	12	–	12
Gesamt	–	2.401.068	–	2.401.068
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(858)	–	(858)
Gesamt	–	(858)	–	(858)
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	1.560.688	–	1.560.688
Einlagenzertifikate	–	985.280	–	985.280
Termineinlagen	–	307.000	–	307.000
Anleihen	–	88.110	–	88.110
Umgekehrte Repogeschäfte	–	998.120	–	998.120
Gesamt	–	3.939.198	–	3.939.198
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Einlagenzertifikate	–	19.913.401	–	19.913.401
Commercial Papers	–	26.133.271	–	26.133.271
Termineinlagen	–	9.720.000	–	9.720.000
Anleihen	–	1.351.124	–	1.351.124
Umgekehrte Repogeschäfte	–	9.380.100	–	9.380.100
Gesamt	–	66.497.896	–	66.497.896
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	2.372.734	–	2.372.734
Einlagenzertifikate	–	1.341.924	–	1.341.924
Bankakzepte	–	124.102	–	124.102
Anleihen	–	429.663	–	429.663
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	968	–	968
Gesamt	–	4.269.391	–	4.269.391
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(3.629)	–	(3.629)
Gesamt	–	(3.629)	–	(3.629)
BlackRock ICS US Treasury Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	9.571.897	–	9.571.897
Umgekehrte Repogeschäfte	–	12.531.000	–	12.531.000
Gesamt	–	22.102.897	–	22.102.897
30. September 2022	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Gesamt
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	442.350	–	442.350
Einlagenzertifikate	–	83.612	–	83.612
Anleihen	–	272.086	–	272.086
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	472	–	472
Nicht realisierte Gewinne aus Terminkontrakten (Futures)	463	–	–	463
Gesamt	463	798.520	–	798.983
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(1.391)	–	(1.391)
Gesamt	–	(1.391)	–	(1.391)

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

30. September 2022 (Fortsetzung)	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Gesamt
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	19.699	–	19.699
Umgekehrte Repogeschäfte	–	16.000	–	16.000
Gesamt	–	35.699	–	35.699
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	1.639.984	–	1.639.984
Einlagenzertifikate	–	1.066.296	–	1.066.296
Termineinlagen	–	1.839.854	–	1.839.854
Anleihen	–	150.836	–	150.836
Umgekehrte Repogeschäfte	–	100.000	–	100.000
Gesamt	–	4.796.970	–	4.796.970
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	14.914.834	–	14.914.834
Einlagenzertifikate	–	10.027.403	–	10.027.403
Termineinlagen	–	4.356.186	–	4.356.186
Anleihen	–	1.989.612	–	1.989.612
Umgekehrte Repogeschäfte	–	3.544.500	–	3.544.500
Gesamt	–	34.832.535	–	34.832.535
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	3.675.215	–	3.675.215
Einlagenzertifikate	–	675.464	–	675.464
Termineinlagen	–	242.954	–	242.954
Anleihen	–	1.037.201	–	1.037.201
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	3.142	–	3.142
Gesamt	–	5.633.976	–	5.633.976
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(8.171)	–	(8.171)
Gesamt	–	(8.171)	–	(8.171)
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	436.007	–	436.007
Umgekehrte Repogeschäfte	–	2.665.178	–	2.665.178
Gesamt	–	3.101.185	–	3.101.185
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Einlagenzertifikate	–	2.372.131	–	2.372.131
Commercial Papers	–	1.386.999	–	1.386.999
Termineinlagen	–	2.501.801	–	2.501.801
Anleihen	–	853.979	–	853.979
Umgekehrte Repogeschäfte	–	1.059.323	–	1.059.323
Gesamt	–	8.174.233	–	8.174.233
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Einlagenzertifikate	–	12.396.283	–	12.396.283
Commercial Papers	–	5.148.913	–	5.148.913
Termineinlagen	–	4.767.163	–	4.767.163
Anleihen	–	5.079.019	–	5.079.019
Umgekehrte Repogeschäfte	–	6.081.504	–	6.081.504
Gesamt	–	33.472.882	–	33.472.882
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Einlagenzertifikate	–	684.122	–	684.122
Commercial Papers	–	461.516	–	461.516
Termineinlagen	–	269.759	–	269.759
Anleihen	–	125.923	–	125.923
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	279	–	279
Gesamt	–	1.541.599	–	1.541.599
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(5.406)	–	(5.406)
Gesamt	–	(5.406)	–	(5.406)

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

30. September 2022 (Fortsetzung)	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Gesamt
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	1.492.172	–	1.492.172
Einlagezertifikate	–	1.101.537	–	1.101.537
Termineinlagen	–	504.709	–	504.709
Anleihen	–	23.661	–	23.661
Umgekehrte Repogeschäfte	–	923.000	–	923.000
Gesamt	–	4.045.079	–	4.045.079
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	21.108.220	–	21.108.220
Einlagezertifikate	–	19.678.292	–	19.678.292
Termineinlagen	–	9.904.360	–	9.904.360
Anleihen	–	291.766	–	291.766
Umgekehrte Repogeschäfte	–	12.230.000	–	12.230.000
Gesamt	–	63.212.638	–	63.212.638
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	2.728.313	–	2.728.313
Bankakzepte	–	113.078	–	113.078
Einlagezertifikate	–	971.250	–	971.250
Anleihen	–	267.349	–	267.349
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	21.656	–	21.656
Gesamt	–	4.101.646	–	4.101.646
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(677)	–	(677)
Gesamt	–	(677)	–	(677)
BlackRock ICS US Treasury Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	8.695.917	–	8.695.917
Umgekehrte Repogeschäfte	–	12.060.001	–	12.060.001
Gesamt	–	20.755.918	–	20.755.918

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

5. Betriebliche Erträge

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR
Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	228.712	29.129	274	–	560	–	5.948	–
Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten	5.195.709	789.879	17.227	1.036	3.287	2	155.284	2.118
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	1.358.129	188.846	–	–	17.350	2	6.202	14
Gesamt	6.782.550	1.007.854	17.501	1.036	21.197	4	167.434	2.132

	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP
Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	37.544	–	5.443	–	4.392	598	10.015	1.165
Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten	989.173	14.213	145.034	5.483	26.430	2.260	280.510	47.867
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	118.568	623	–	–	120.177	16.116	67.671	8.771
Gesamt	1.145.285	14.836	150.477	5.483	150.999	18.974	358.196	57.803

	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD
Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	55.987	7.798	6.473	818	6.403	1.016	87.992	14.798
Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten	1.302.028	224.894	77.508	12.065	136.086	31.473	2.355.421	502.801
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	254.780	39.617	–	–	39.644	5.072	291.931	39.401
Gesamt	1.612.795	272.309	83.981	12.883	182.133	37.561	2.735.344	557.000

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

5. Betriebliche Erträge (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Treasury Fund	
	2023	2022	2023	2022
	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	10.687	1.743	28.062	6.451
Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten	218.855	36.552	196.058	48.167
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	–	–	639.818	114.040
Gesamt	229.542	38.295	863.938	168.658

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

6. Betriebliche Aufwendungen

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR
Verzicht auf Managementgebühren	188	20.900	–	–	–	31	–	860
Managementgebühren	(181.771)	(167.561)	(387)	(431)	(892)	(50)	(4.450)	(3.711)
Gesamt	(181.583)	(146.661)	(387)	(431)	(892)	(19)	(4.450)	(2.851)

	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP
Verzicht auf Managementgebühren	213	11.535	–	–	–	461	–	73
Managementgebühren	(47.740)	(39.165)	(3.762)	(4.132)	(4.283)	(2.518)	(5.805)	(3.942)
Gesamt	(47.527)	(27.630)	(3.762)	(4.132)	(4.283)	(2.057)	(5.805)	(3.869)

	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD
Verzicht auf Managementgebühren	3	2.074	–	–	–	39	–	3.075
Managementgebühren	(39.186)	(36.232)	(1.433)	(1.285)	(1.557)	(1.658)	(66.451)	(72.390)
Gesamt	(39.183)	(34.158)	(1.433)	(1.285)	(1.557)	(1.619)	(66.451)	(69.315)

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

6. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Treasury Fund	
	2023	2022	2023	2022
	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Verzicht auf Managementgebühren	–	–	–	6.830
Managementgebühren	(4.504)	(2.701)	(27.171)	(29.984)
Gesamt	(4.504)	(2.701)	(27.171)	(23.154)

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

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

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

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

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

Anteilklasse	Managementgebühren (inkl. der Gebühren von Fondsverwalter, Verwahrstelle und Investmentmanager): %
Anteilklasse Accumulating	0,055
Admin I Shares	0,25
Anteilklasse Admin II	0,30
Anteilklasse Admin III	0,45
Anteilklasse Admin IV	0,70
Anteilklasse Agency	0,03
Anteilklasse Aon Captives	0,15
Anteilklasse Core	0,20
Klasse FA	0,00
Anteilklasse G Accumulating II	0,25
Anteilklasse G Accumulating	0,20
Anteilklasse G Distributing I	0,15
Anteilklasse G Distributing II	0,25
Anteilklasse G Distributing	0,20
Anteilklasse Heritage	0,125
Anteilklasse J (Acc)	0,06
Anteilklasse J (Dis)	0,06
Klasse N	0,20
Anteilklasse Premier	0,10
Anteilklasse S (Acc)	0,10
Anteilklasse Select	0,15

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

7. Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	(21.198)	(808)	(1.697)	(49)	–	–	7	16
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	40.283	(35.392)	3.201	(3.551)	–	–	–	–
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	19.938	(28.406)	2.434	(2.878)	–	–	833	(2.269)
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/ (Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	(10.204)	12.732	455	(237)	–	–	–	–
Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten	(25.059)	22.066	(3.891)	5.098	–	–	–	–
Gesamt	3.760	(29.808)	502	(1.617)	–	–	840	(2.253)

	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	(381)	413	(15.259)	(1.043)	–	–	18	1
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	–	–	11.382	(30.316)	–	–	–	–
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	–	–	984	(3.853)	–	–	7.359	(7.813)
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/ (Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	–	–	5.029	(1.824)	–	–	–	–
Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten	–	–	(18.832)	28.889	–	–	–	–
Gesamt	(381)	413	(16.696)	(8.147)	–	–	7.377	(7.812)

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	–	5	–	(4)	(139)	4	34	(336)
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	–	–	8.168	(13.520)	–	–	–	–
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	–	–	3.572	(5.627)	1.462	(2.288)	–	–
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/ (Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	–	–	4.281	(1.082)	–	–	–	–
Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten	–	–	(9.721)	16.096	–	–	–	–
Gesamt	–	5	6.300	(4.137)	1.323	(2.284)	34	(336)

	BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Treasury Fund	
	2023	2022	2023	2022
	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	(2.739)	7	(4.681)	7
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	23.828	8.728	–	–
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	5.049	(7.113)	–	–
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/ (Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	(23.626)	19.923	–	–
Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten	5.446	(29.220)	–	–
Gesamt	7.958	(7.675)	(4.681)	7

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

8. Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen

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

9. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile

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

Die im Geschäftsjahr beschlossenen Ausschüttungen waren wie folgt:

	Institutional Cash Series Plc		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	
	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR
Anteilklasse Admin I (Dis)	(62)	(23)	–	–	–	–	–	–
Anteilklasse Admin II (Dis)	(1.508)	(258)	–	–	–	–	–	–
Anteilklasse Admin III (Dis)	(5.450)	(358)	–	–	–	–	–	–
Anteilklasse Agency (Dis)	(840.991)	(137.291)	(1)	–	–	–	–	–
Anteilklasse Aon Captives	(1.359)	(1.373)	–	–	–	–	–	–
Anteilklasse Core (Dis)	(600.510)	(101.921)	(1.071)	–	(9.194)	–	–	–
Anteilklasse G Distributing I	(166)	(59)	–	–	–	–	–	–
Anteilklasse G Distributing II	(2)	–	–	–	–	–	–	–
Anteilklasse G Distributing	(6.166)	(619)	–	–	–	–	–	–
Anteilklasse G Heritage (Dis)	(390)	(14)	–	–	–	–	–	–
Anteilklasse Heritage (Dis)	(713.088)	(139.133)	(2.466)	–	(28.069)	–	–	–
Anteilklasse J (Dis)	(3.734)	(530)	–	–	–	–	(649)	–
Klasse N	(1.793)	(355)	–	–	–	–	–	–
Anteilklasse Premier (Dis T1)	(748)	–	–	–	–	–	–	–
Anteilklasse Premier (Dis)	(1.888.333)	(306.406)	(786)	–	(61.196)	–	(3)	–
Anteilklasse Select (Dis)	(142.639)	(22.646)	(1)	–	(736)	–	–	–
Gesamt	(4.206.939)	(710.986)	(4.325)	–	(99.195)	–	(652)	–

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

9. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile (Fortsetzung)

	BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	
	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP
Anteilklasse Admin I (Dis)	–	–	–	–	(60)	(23)	–	–
Anteilklasse Admin II (Dis)	–	–	–	–	(66)	(1)	–	–
Anteilklasse Admin III (Dis)	–	–	–	–	(821)	(74)	–	–
Anteilklasse Agency (Dis)	(1)	–	(128.935)	(29.306)	(333.748)	(46.638)	(18.127)	(890)
Anteilklasse Aon Captives	–	–	–	–	(466)	(628)	–	–
Anteilklasse Core (Dis)	(3.346)	–	(346)	(40)	(57.190)	(8.779)	–	–
Anteilklasse G Distributing I	–	–	–	–	(72)	(13)	–	–
Anteilklasse G Distributing II	–	–	–	–	(2)	–	–	–
Anteilklasse Heritage (Dis)	(2.020)	–	(5.856)	(977)	(295.607)	(54.545)	–	–
Anteilklasse J (Dis)	–	–	–	–	–	–	(733)	(259)
Anteilklasse Premier (Dis T1)	–	–	–	–	(748)	–	–	–
Anteilklasse Premier (Dis)	(9.312)	–	(32.748)	(3.167)	(650.217)	(95.659)	(1.685)	(148)
Anteilklasse Select (Dis)	(250)	–	–	–	(55.419)	(8.911)	–	–
Gesamt	(14.929)	–	(167.885)	(33.490)	(1.394.416)	(215.271)	(20.545)	(1.297)

	BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund		BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Treasury Fund	
	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD
Anteilklasse Admin I (Dis)	–	–	(2)	–	–	–	–	–
Anteilklasse Admin II (Dis)	–	–	(1.769)	(329)	–	–	–	–
Anteilklasse Admin III (Dis)	–	–	(5.341)	(318)	–	–	(338)	(46)
Anteilklasse Agency (Dis)	(151.708)	(32.648)	(265.723)	(40.774)	–	–	(24.435)	(3.988)
Anteilklasse Aon Captives	–	–	(1.095)	(954)	–	–	–	–
Anteilklasse Core (Dis)	(4.189)	(790)	(316.295)	(64.498)	–	–	(330.571)	(53.920)
Anteilklasse G Distributing I	–	–	(115)	(59)	–	–	–	–
Anteilklasse G Distributing	–	–	(7.474)	(791)	–	–	(91)	(2)
Anteilklasse G Heritage (Dis)	–	–	(368)	(15)	–	–	(111)	(2)
Anteilklasse Heritage (Dis)	(1.109)	(239)	(408.814)	(94.859)	–	(197)	(59.978)	(11.761)
Anteilklasse J (Dis)	–	–	–	–	(2.989)	(347)	–	–
Klasse N	–	–	(2.200)	(455)	–	–	–	–
Anteilklasse Premier (Dis)	(4.289)	(665)	(1.061.708)	(197.187)	(1.185)	–	(331.891)	(67.745)
Anteilklasse Select (Dis)	(309)	(39)	(64.368)	(13.408)	–	–	(41.227)	(4.140)
Gesamt	(161.604)	(34.381)	(2.135.272)	(413.647)	(4.174)	(544)	(788.642)	(141.604)

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

10. Besteuerung

Irische Steuern

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

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

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

Ausländische Steuern

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

11. Forderungen

Zum 30. September 2023

	Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR
Zinsforderungen aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	3.580	1.130	2	–	8	–	80	7
Zinsforderungen aus finanziellen Vermögenswerten	410.134	140.665	1.823	958	–	–	12.989	212
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	14.782	7.043	–	–	410	–	214	–
Noch nicht abgerechnete Verkäufe von Wertpapieren	2.918	4.389	–	–	–	–	–	4.999
Noch nicht abgerechnete Anteilszeichnungen	256.979	214.260	–	119	46	–	35	14
Sonstige Forderungen	112	18	–	–	–	–	–	–
Gesamt	688.505	367.505	1.825	1.077	464	–	13.318	5.232

	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP
Zinsforderungen aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	570	58	744	51	58	14	139	30
Zinsforderungen aus finanziellen Vermögenswerten	93.263	1.343	11.650	1.285	–	–	22.826	10.307
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	1.537	–	–	–	1.644	389	874	147
Noch nicht abgerechnete Anteilszeichnungen	56.350	25.686	–	10.632	4.494	–	6.318	12.945
Gesamt	151.720	27.087	12.394	11.968	6.196	403	30.157	23.429

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

11. Forderungen (Fortsetzung)

Zum 30. September 2023

	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Zinsforderungen aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	727	190	444	99	62	36	860	489
Zinsforderungen aus finanziellen Vermögenswerten	128.204	52.604	2.014	2.371	7.465	4.302	136.582	68.664
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	2.106	863	–	–	440	234	4.147	3.081
Noch nicht abgerechnete Anteilszeichnungen	154.024	121.934	1.710	7.549	391	26	21.396	19.945
Sonstige Forderungen	–	–	112	–	–	21	–	–
Gesamt	285.061	175.591	4.280	10.019	8.358	4.619	162.985	92.179

	BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Treasury Fund	
	2023	2022	2023	2022
	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Zinsforderungen aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	34	34	258	216
Zinsforderungen aus finanziellen Vermögenswerten	16.138	5.822	26.848	1.643
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	–	–	5.523	2.985
Noch nicht abgerechnete Verkäufe von Wertpapieren	–	–	3.561	–
Noch nicht abgerechnete Anteilszeichnungen	28.488	24.366	356	141
Gesamt	44.660	30.222	36.546	4.985

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

12. Verbindlichkeiten

Zum 30. September 2023

	Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR
Zahlbare Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	474.733	218.561	–	–	1.330	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten für Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1.076	220	–	–	–	–	233	1
Zinsaufwendungen für Liquiditätspapiere	–	106	–	–	–	–	–	3
Verzicht auf Managementgebühren	89	(442)	–	–	–	(1)	–	(61)
Zahlbare Managementgebühren	34.984	16.525	64	38	345	4	840	307
Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren	6.823.810	3.438.772	–	–	–	–	249.973	14.998
Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen	115.215	350.441	–	–	6.265	–	5.570	811
Zinsverbindlichkeiten aus umgekehrten Repogeschäften	–	78	–	–	–	–	–	3
Sonstige Verbindlichkeiten	3.381	1.982	–	–	6	4	63	–
Gesamt	7.453.288	4.026.243	64	38	7.946	7	256.679	16.062

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

12. Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Zum 30. September 2023

	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP
Zahlbare Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	25.361	–	847	–	2.668	–	17.231	7.759
Zinsverbindlichkeiten für Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	18	–	394	–	–	–	87	50
Zinsaufwendungen für Liquiditätspapiere	–	117	–	–	–	–	–	–
Verzicht auf Managementgebühren	–	(551)	–	–	3	3	–	–
Zahlbare Managementgebühren	8.899	3.603	640	330	924	263	1.019	437
Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren	1.509.848	276.964	–	433.823	1.225.284	405.470	574.876	203.802
Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen	4.931	5.303	–	218.152	–	–	8.789	54.404
Zinsverbindlichkeiten aus umgekehrten Repogeschäften	–	86	–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten	2.736	1.173	–	–	32	31	–	–
Gesamt	1.551.793	286.695	1.881	652.305	1.228.911	405.767	602.002	266.452

	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD	2023 Tsd. USD	2022 Tsd. USD
Zahlbare Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	134.324	47.973	17.974	748	15.073	8.906	230.871	128.330
Zinsverbindlichkeiten für Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	248	126	–	–	16	17	205	32
Zahlbare Managementgebühren	5.913	3.011	276	100	264	139	11.542	6.815
Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren	485.542	1.052.789	177.499	50.997	189.896	114.871	3.139.110	1.095.542
Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen	10.396	26.776	–	2.889	30	–	80.437	11.325
Sonstige Verbindlichkeiten	122	8	–	–	–	–	953	919
Gesamt	636.545	1.130.683	195.749	54.734	205.279	123.933	3.463.118	1.242.963

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

12. Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Zum 30. September 2023

	BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Treasury Fund	
	2023	2022	2023	2022
	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Zahlbare Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	2.447	309	91.713	43.386
Zinsverbindlichkeiten für Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	–	–	1	–
Verzicht auf Managementgebühren	–	–	104	104
Zahlbare Managementgebühren	791	267	8.755	2.777
Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren	31.836	4.986	98.289	–
Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen	4.573	14.074	14.420	52.250
Sonstige Verbindlichkeiten	1	–	15	95
Gesamt	39.648	19.636	213.297	98.612

13. Anteilkapital

Genehmigtes Anteilkapital

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

Zeichneranteile

Derzeit sind 3 Zeichneranteile ausgegeben, und sie werden zum 30. September 2023 und 30. September 2022 von der Verwaltungsgesellschaft und von Nominees der Verwaltungsgesellschaft gehalten. Sie gehören nicht zum NIW des Unternehmens. Sie werden im Abschluss somit nur in dieser Anmerkung erwähnt. Nach Auffassung des Verwaltungsrats spiegeln diese Angaben die Art der Anlagentätigkeit des Unternehmens wider.

Stimmrechte

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

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert

Zum 30. September 2023

		2023	2022	2021
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund				
Anteilklasse Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	683.902	801.008	766.794
Anteile im Umlauf		67.103.221	80.609.263	76.816.848
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	10,1918	9,9369	9,9821
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund				
Anteilklasse Agency (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	15.636	15.291	22.986
Anteile im Umlauf		156.790	156.986	234.498
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,7243	97,4032	98,0222
Anteilklasse Agency (Dis)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	40	–	–
Anteile im Umlauf		40.000	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	1,00	–	–
Anteilklasse Core (Acc T0)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	79.438	–	–
Anteile im Umlauf		782.574	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	101,5086	–	–
Anteilklasse Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	61.733	9.595	16.543
Anteile im Umlauf		626.248	99.488	170.433
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	98,5766	96,4456	97,0668
Anteilklasse Core (Dis)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	165.655	–	–
Anteile im Umlauf		165.654.656	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	1,00	–	–
Anteilklasse G Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	8.632	13	13
Anteile im Umlauf		8.854	14	14
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	974,9560	953,8279	959,9664

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2023	2022	2021
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse G Accumulating T0				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	152.703	10	4.973
Anteile im Umlauf		1.528.199	101	50.517
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,9238	97,7560	98,4394
Anteilklasse Heritage (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	135.400	373	80
Anteile im Umlauf		1.355.648	3.820	809
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,8784	97,6461	98,2703
Anteilklasse Heritage (Acc)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	34.467	–	–
Anteile im Umlauf		337.356	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	102,1688	–	–
Anteilklasse Heritage (Dis)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	181.345	–	–
Anteile im Umlauf		181.344.659	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	1,00	–	–
Anteilklasse Premier (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	438.890	13.938	18.190
Anteile im Umlauf		4.393.159	142.742	185.100
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,9030	97,6458	98,2699
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	129.831	187	326
Anteile im Umlauf		1.329.581	1.958	3.394
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,6479	95,4416	96,0516
Anteilklasse Premier (Dis)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	69.148	–	–
Anteile im Umlauf		69.148.388	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	1,00	–	–
Anteilklasse Select (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	28.369	5	5
Anteile im Umlauf		283.899	52	49
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,9254	97,7137	98,3178
Anteilklasse Select (Dis)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	40	–	–
Anteile im Umlauf		40.000	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	1,00	–	–
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund				
Anteilklasse Admin III (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	1.283	758	893
Anteile im Umlauf		13.282	8.024	9.363
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	96,5846	94,5054	95,3853
Anteilklasse Agency (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	2.740.933	2.614.184	2.996.547
Anteile im Umlauf		27.211.016	26.634.964	30.376.795
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,7288	98,1485	98,6459
Anteilklasse Core (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	34.526	58.411	29.065
Anteile im Umlauf		344.884	597.807	295.600
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,1077	97,7087	98,3247
Anteilklasse Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	83.479	39.592	16.049
Anteile im Umlauf		845.769	410.976	165.551
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	98,7022	96,3369	96,9444
Anteilklasse Heritage (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	114.120	19.711	19.823
Anteile im Umlauf		1.137.574	201.454	201.454
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,3189	97,8417	98,3986
Anteilklasse Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	176.780	121.286	146.650
Anteile im Umlauf		1.755.385	1.234.840	1.484.624
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,7070	98,2201	98,7792
Anteilklasse Premier (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	2.113.055	1.178.746	1.584.780

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2023	2022	2021
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Premier (Acc T0) (Fortsetzung)				
Anteile im Umlauf		21.023.474	12.027.663	16.082.841
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,5093	98,0030	98,5386
Anteilklasse Premier (Acc T2)²				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	8.184	11	–
Anteile im Umlauf		80.068	110	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	102,2184	99,6691	–
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	1.084.542	878.418	424.169
Anteile im Umlauf		10.773.579	8.949.161	4.297.861
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,6668	98,1565	98,6929
Anteilklasse Premier (Dis)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	40	–	–
Anteile im Umlauf		400	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,9812	–	–
Anteilklasse Premier (Acc T0)²				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	504	–	–
Anteile im Umlauf		4.928	2	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	102,1797	99,9733	–
Anteilklasse Select (Acc)²				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	26	69	–
Anteile im Umlauf		249	687	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	102,5400	99,8808	–
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund				
Anteilklasse Admin I (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	1.521	–	–
Anteile im Umlauf		15.147	1	1
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,4185	99,0185	99,0185
Anteilklasse Admin I (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	31.565	1.353	2.179
Anteile im Umlauf		323.141	14.178	22.676
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,6820	95,4332	96,1066
Anteilklasse Admin II (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	11.953	2.404	2.229
Anteile im Umlauf		118.580	24.394	22.455
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,8010	98,5295	99,2745
Anteilklasse Admin III (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	861	–	–
Anteile im Umlauf		8.476	3	3
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	101,6176	99,2627	99,2627
Anteilklasse Admin III (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	4.884	7.668	913
Anteile im Umlauf		47.725	76.538	9.036
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	102,3372	100,1808	101,0903
Anteilklasse Admin IV (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	6.818	280	310
Anteile im Umlauf		72.062	3.020	3.295
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	94,6177	92,8553	93,9334
Anteilklasse Agency (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	2.513.310	2.512.351	6.276.697
Anteile im Umlauf		24.952.195	25.586.495	63.615.999
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,7250	98,1905	98,6654
Anteilklasse Agency (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	138.911	161.039	128.241
Anteile im Umlauf		1.355.114	1.611.524	1.277.135
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	102,5089	99,9295	100,4128
Anteilklasse Agency (Dis)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	1	–	–
Anteile im Umlauf		1.000	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	1,00	–	–
Anteilklasse Aon Captives (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	7	7	8
Anteile im Umlauf		68	68	78

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2023	2022	2021
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Aon Captives (Acc T0) (Fortsetzung)				
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,3745	97,9804	98,5308
Anteilklasse Core (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	655.574	1.800.041	244.382
Anteile im Umlauf		6.547.545	18.410.717	2.484.437
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,1251	97,7713	98,3651
Anteilklasse Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	782.461	731.850	443.768
Anteile im Umlauf		5.705.008	5.464.460	3.293.451
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	137,1533	133,9291	134,7424
Anteilklasse Core (Dis)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	479.510	–	–
Anteile im Umlauf		479.510.071	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	1,00	–	–
Anteilklasse G Accumulating T0				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	4.464.122	2.046.538	2.706.595
Anteile im Umlauf		44.430.597	20.860.906	27.436.961
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,4741	98,1040	98,6478
Anteilklasse Heritage (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	1.902.277	3.405.848	2.655.896
Anteile im Umlauf		18.944.332	34.760.595	26.959.267
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,4140	97,9802	98,5151
Anteilklasse Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	282.547	222.214	233.270
Anteile im Umlauf		2.817.595	2.270.993	2.371.034
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,2796	97,8490	98,3832
Anteilklasse Heritage (Dis)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	1.673.255	–	–
Anteile im Umlauf		1.673.254.918	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	1,00	–	–
Anteilklasse Premier (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	23.588.425	22.869.920	22.293.938
Anteile im Umlauf		234.686.111	233.247.856	226.184.690
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,5105	98,0499	98,5652
Anteilklasse Premier (Acc T2)²				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	965	1	–
Anteile im Umlauf		9.439	10	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	102,2136	99,6860	–
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	2.718.222	1.074.812	329.686
Anteile im Umlauf		27.032.352	10.957.103	3.343.397
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,5544	98,0927	98,6082
Anteilklasse Premier (Dis)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	6.274.921	–	–
Anteile im Umlauf		6.274.921.384	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	1,00	–	–
Anteilklasse Select (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	289.338	84.096	61.382
Anteile im Umlauf		2.883.216	858.603	623.231
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,3527	97,9447	98,4901
Anteilklasse Select (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	251.942	632.225	61.895
Anteile im Umlauf		2.549.832	6.555.870	638.269
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	98,8073	96,4364	96,9734
Anteilklasse Select (Dis)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	71.628	–	–
Anteile im Umlauf		71.628.331	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	1,00	–	–
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund				
Anteilklasse Admin III				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	7.031	4.479	2.300
Anteile im Umlauf		72.326	47.003	23.938
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,2096	95,2943	96,0847

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2023	2022	2021
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Agency				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	1.913.720	2.135.626	2.763.372
Anteile im Umlauf		17.067.574	19.511.010	25.144.328
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	112,1260	109,4575	109,9004
Anteilklasse Core				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	17.028	1.041	13.317
Anteile im Umlauf		149.914	9.375	119.204
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	113,5873	111,0721	111,7135
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	–	–	–
Anteile im Umlauf		2	2	2
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,5750	99,8800	99,9800
Anteilklasse Heritage				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	17.995	21.183	248
Anteile im Umlauf		177.755	214.139	2.497
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	101,2367	98,9209	99,4158
Anteilklasse J (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	437.500	105.555	340.708
Anteile im Umlauf		4.309.849	1.064.859	3.422.256
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	101,5118	99,1255	99,5566
Anteilklasse J (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	53.227	4.821	5.169
Anteile im Umlauf		532.945	48.660	51.949
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,8726	99,0708	99,5017
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	202	–	–
Anteile im Umlauf		2.027	1	1
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,6967	100,0000	100,0000
Anteilklasse Premier				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	2.632.550	2.887.487	3.278.264
Anteile im Umlauf		26.295.458	29.524.467	33.361.572
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,1142	97,7998	98,2647
Anteilklasse Select				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	16.744	15.629	3.851
Anteile im Umlauf		167.359	159.837	39.173
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,0467	97,7826	98,2971
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund				
Anteilklasse Agency (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	311.142	789.106	825.917
Anteile im Umlauf		2.972.991	7.839.897	8.259.456
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	104,6561	100,6526	99,9965
Agency (Dis) GBP¹				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	40	–	–
Anteile im Umlauf		40.000	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	–	–
Anteilklasse Core (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	965.521	391.797	458.970
Anteile im Umlauf		9.252.653	3.897.347	4.590.014
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	104,3507	100,5292	99,9931
Anteilklasse Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	35.819	7.563	8.398
Anteile im Umlauf		334.919	73.404	81.945
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	106,9486	103,0319	102,4825
Anteilklasse Core (Dis)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	42.108	–	–
Anteile im Umlauf		42.107.978	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	–	–
Anteilklasse Heritage (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	461.685	694.759	376.951
Anteile im Umlauf		4.418.820	6.907.534	3.769.771
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	104,4815	100,5800	99,9931
Anteilklasse Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	146.944	184.397	137.391

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2023	2022	2021
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund (Fortsetzung)				
Heritage (Acc) Shares (Fortsetzung)				
Anteile im Umlauf		1.362.854	1.776.558	1.331.454
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	107,8209	103,7946	103,1890
Heritage (Dis) GBP¹				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	180.353	–	–
Anteile im Umlauf		180.352.615	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	–	–
Anteilklasse Premier (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	540.871	448.023	449.390
Anteile im Umlauf		5.174.488	4.453.588	4.494.207
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	104,5264	100,5981	99,9931
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.291.441	251.143	122.705
Anteile im Umlauf		12.058.506	2.436.558	1.197.673
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	107,0979	103,0730	102,4531
Anteilklasse Premier (Dis)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	345.526	–	–
Anteile im Umlauf		345.525.620	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	–	–
Anteilklasse Select (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	41.469	9.656	35.941
Anteile im Umlauf		397.071	96.019	359.435
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	104,4375	100,5600	99,9931
Select (Dis) GBP¹				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	295.066	–	–
Anteile im Umlauf		295.065.991	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	–	–
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund				
Anteilklasse Agency (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.161.757	229.997	219.722
Anteile im Umlauf		11.008.790	2.270.226	2.182.594
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	105,5299	101,3102	100,6700
Anteilklasse Agency (Acc)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	88.112	–	–
Anteile im Umlauf		857.349	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	102,7731	–	–
Anteilklasse Agency (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	3.398.445	4.084.207	2.890.825
Anteile im Umlauf		33.988.006	40.880.430	28.905.438
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	99,9895	99,9061	100,0097
Anteilklasse (AccT0)²				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	3.084	–	–
Anteile im Umlauf		30.021	1	–
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	102,7302	100,1500	–
Anteilklasse Core (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	25.473	40.012	2.100
Anteile im Umlauf		254.760	400.507	21.003
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	99,9863	99,9042	100,0055
Anteilklasse Heritage (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	16.909	4.032	10.202
Anteile im Umlauf		160.749	39.893	101.488
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	105,1876	101,0770	100,5257
Anteilklasse Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	24.793	16.807	442
Anteile im Umlauf		235.687	166.266	4.394
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	105,1954	101,0850	100,5336
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	105.659	165.177	22.341
Anteile im Umlauf		1.056.699	1.653.319	223.387
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	99,9895	99,9063	100,0099
Anteilklasse J (Acc T3)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	730.736	821.654	1
Anteile im Umlauf		6.975.715	8.167.870	10

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2023	2022	2021
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse J (Acc T3) (Fortsetzung)				
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	104,7543	100,5959	100,0000
Anteilklasse J (Dis T3)³				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	–	1	1
Anteile im Umlauf		–	10	10
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	–	99,9100	100,0000
Anteilklasse Premier (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.720.126	1.339.737	1.113.569
Anteile im Umlauf		16.340.252	13.247.587	11.073.779
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	105,2692	101,1370	100,5591
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.646.639	727.357	550.931
Anteile im Umlauf		15.641.794	7.192.060	5.478.540
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	105,2717	101,1333	100,5617
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	564.685	667.256	149.055
Anteile im Umlauf		5.652.261	6.684.523	1.491.677
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	99,9042	99,8210	99,9245
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund				
Anteilklasse Admin I (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	10.181	835	1.144
Anteile im Umlauf		95.576	8.145	11.219
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	106,5208	102,5561	101,9735
Anteilklasse Admin I (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	2.131	600	9.942
Anteile im Umlauf		2.130.637	600.002	9.942.402
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Admin II (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	9.753	11.570	11.216
Anteile im Umlauf		87.899	108.248	105.502
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	110,9597	106,8830	106,3111
Anteilklasse Admin II (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.668	1.288	15
Anteile im Umlauf		1.667.817	1.287.779	14.946
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Admin III (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.017	1.270	1.179
Anteile im Umlauf		9.001	11.655	10.866
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	112,9374	108,9509	108,4673
Anteilklasse Admin III (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	20.697	16.311	19.536
Anteile im Umlauf		20.696.851	16.310.923	19.535.578
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Admin IV (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	2.137	1.033	1.028
Anteile im Umlauf		19.159	9.585	9.585
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	111,5463	107,7457	107,2972
Anteilklasse Agency (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	101.279	109.634	121.849
Anteile im Umlauf		890.306	1.003.210	1.123.308
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	113,7572	109,2831	108,4731
Anteilklasse Agency (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	6.635.468	6.735.948	9.256.182
Anteile im Umlauf		6.635.468.260	6.735.948.318	9.256.182.014
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Aon Captives				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.350	7.305	2.361
Anteile im Umlauf		1.350.469	7.304.637	2.360.727
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	306.493	415.850	406.391
Anteile im Umlauf		1.728.747	2.437.460	2.396.412
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	177,2920	170,6100	169,5832

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2023	2022	2021
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Core (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.693.254	1.351.183	2.144.524
Anteile im Umlauf		1.693.253.984	1.351.182.688	2.144.523.880
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse G Distributing I				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.753	1.739	2.413
Anteile im Umlauf		1.753.154	1.739.476	2.413.072
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse G Distributing II				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	–	–	–
Anteile im Umlauf		381	381	381
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	360.160	273.015	371.076
Anteile im Umlauf		3.281.367	2.586.782	3.539.044
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	109,7592	105,5423	104,8520
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	6.021.717	6.085.533	7.988.711
Anteile im Umlauf		6.021.717.447	6.085.532.706	7.988.710.565
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	4.171.814	2.852.527	1.858.159
Anteile im Umlauf		37.899.363	26.956.252	17.678.651
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	110,0761	105,8206	105,1075
Anteilklasse Premier (Dis T1)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	74.403	–	–
Anteile im Umlauf		74.402.647	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	–	–
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	14.228.205	14.065.547	12.583.749
Anteile im Umlauf		14.228.205.372	14.065.547.055	12.583.749.199
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse S (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	206.052	208.817	245.891
Anteile im Umlauf		1.890.075	1.992.471	2.362.134
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	109,0178	104,8033	104,0970
Anteilklasse Select (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	20.372	30.976	43.513
Anteile im Umlauf		186.442	294.747	416.691
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	109,2648	105,0931	104,4254
Anteilklasse Select (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.462.274	1.338.606	1.564.104
Anteile im Umlauf		1.462.274.209	1.338.605.799	1.564.104.444
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund				
Anteilklasse Agency (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	694.812	87.011	294.991
Anteile im Umlauf		6.932.817	872.036	2.949.851
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	100,2207	99,7793	100,0019
Anteilklasse Agency				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	424.090	520.334	607.098
Anteile im Umlauf		3.002.975	3.842.575	4.504.189
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	141,2232	135,4128	134,7853
Anteilklasse Core				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	6.318	7.524	7.992
Anteile im Umlauf		46.127	57.193	60.927
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	136,9695	131,5565	131,1709
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	–	–	–
Anteile im Umlauf		1	1	1
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	100,0000	100,0000	100,0000
Anteilklasse Heritage				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	15.708	14.099	10.056

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2023	2022	2021
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Heritage (Fortsetzung)				
Anteile im Umlauf		149.267	139.586	99.929
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	105,2362	101,0023	100,6303
Anteilklasse J (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	224.717	85.013	56.859
Anteile im Umlauf		2.139.335	843.810	566.815
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	105,0407	100,7494	100,3128
Anteilklasse J (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	14.618	30.721	89.644
Anteile im Umlauf		146.000	307.982	896.721
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	100,1215	99,7504	99,9690
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	84.639	23.337	29.476
Anteile im Umlauf		845.334	233.944	294.849
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	100,1253	99,7543	99,9690
Anteilklasse Premier				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	865.580	834.568	1.046.609
Anteile im Umlauf		7.982.178	8.020.821	10.098.414
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	108,4391	104,0502	103,6409
Anteilklasse Select				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	64.389	19.075	14.894
Anteile im Umlauf		473.698	146.179	114.530
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	135,9274	130,4913	130,0433
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund				
Anteilklasse Agency (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	204.109	116.508	64.988
Anteile im Umlauf		1.896.999	1.135.634	638.585
Nettoinventarwert je Anteil	USD	107,5956	102,5925	101,7692
Anteilklasse Agency (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	3.183.574	3.592.897	3.466.923
Anteile im Umlauf		31.824.265	35.931.537	34.654.968
Nettoinventarwert je Anteil	USD	100,0361	99,9929	100,0412
Anteilklasse Core (Acc T0)²				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	–	–	–
Anteile im Umlauf		1	1	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	102,1010	102,4848	–
Anteilklasse Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	11.210	2.008	2.500
Anteile im Umlauf		104.858	19.668	24.647
Nettoinventarwert je Anteil	USD	106,9102	102,1117	101,4336
Anteilklasse Core (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	53.770	123.521	123.941
Anteile im Umlauf		537.551	1.235.385	1.238.905
Nettoinventarwert je Anteil	USD	100,0285	99,9857	100,0410
Anteilklasse Heritage (Acc)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	9.948	–	–
Anteile im Umlauf		93.582	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	106,2986	–	–
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	51.955	37.282	30.471
Anteile im Umlauf		519.401	372.874	304.584
Nettoinventarwert je Anteil	USD	100,0293	99,9857	100,0416
Anteilklasse Premier (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	217.030	12.206	51.326
Anteile im Umlauf		2.023.562	119.276	505.245
Nettoinventarwert je Anteil	USD	107,2517	102,3360	101,5862
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	87.751	95.196	89.031
Anteile im Umlauf		818.379	930.448	876.621
Nettoinventarwert je Anteil	USD	107,2259	102,3115	101,5612
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	51.502	76.206	103.956
Anteile im Umlauf		514.873	762.165	1.039.125

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2023	2022	2021
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Premier (Dis) (Fortsetzung)				
Nettoinventarwert je Anteil	USD	100,0294	99,9861	100,0415
Anteilklasse Select (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	12.329	10.050	42.036
Anteile im Umlauf		123.250	100.511	420.182
Nettoinventarwert je Anteil	USD	100,0290	99,9859	100,0414
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund				
Anteilklasse Admin I (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	107.453	23.213	60.255
Anteile im Umlauf		959.251	216.837	566.746
Nettoinventarwert je Anteil	USD	112,0175	107,0544	106,3174
Anteilklasse Admin I (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	1	1	1
Anteile im Umlauf		669	669	669
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Admin II (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	106.973	128.105	121.405
Anteile im Umlauf		944.457	1.182.875	1.128.469
Nettoinventarwert je Anteil	USD	113,2640	108,2997	107,5836
Anteilklasse Admin II (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	35.960	48.467	59.312
Anteile im Umlauf		35.959.678	48.467.159	59.311.739
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Admin III (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	26.643	27.894	32.455
Anteile im Umlauf		232.776	254.495	297.860
Nettoinventarwert je Anteil	USD	114,4583	109,6055	108,9616
Anteilklasse Admin III (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	248.140	127.033	23.830
Anteile im Umlauf		248.140.281	127.033.436	23.829.740
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Admin IV (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	49.756	33.992	44.284
Anteile im Umlauf		439.982	313.114	409.903
Nettoinventarwert je Anteil	USD	113,0864	108,5619	108,0359
Anteilklasse Agency (Acc T0)¹				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	44.059	–	–
Anteile im Umlauf		425.759	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	103,4843	–	–
Anteilklasse Agency (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	46.421	41.129	40.641
Anteile im Umlauf		405.431	376.691	375.459
Nettoinventarwert je Anteil	USD	114,4975	109,1848	108,2432
Anteilklasse Agency (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	5.637.119	4.453.050	2.443.689
Anteile im Umlauf		5.637.118.694	4.453.050.048	2.443.688.895
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Aon Captives				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	30.612	83.332	340.163
Anteile im Umlauf		30.611.549	83.332.227	340.163.491
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Core (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	243.324	30.025	2.262
Anteile im Umlauf		2.289.371	295.745	22.441
Nettoinventarwert je Anteil	USD	106,2844	101,5247	100,7963
Anteilklasse Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	1.028.866	664.070	627.335
Anteile im Umlauf		6.370.578	4.304.590	4.095.856
Nettoinventarwert je Anteil	USD	161,5028	154,2702	153,1632
Anteilklasse Core (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	7.071.428	9.204.469	9.529.649
Anteile im Umlauf		7.071.428.047	9.204.469.124	9.529.649.196
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2023	2022	2021
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund (Fortsetzung)				
Klasse FA³				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	–	–	–
Anteile im Umlauf		–	100	100
Nettoinventarwert je Anteil	USD	–	1,00	1,00
Anteilklasse G Accumulating II				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	2.888	2.065	2.543
Anteile im Umlauf		2.572	1.925	2.387
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1.122,7024	1.072,9596	1.065,5729
Anteilklasse G Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	227.762	148.987	181.682
Anteile im Umlauf		19.661	13.464	16.537
Nettoinventarwert je Anteil	USD	11.584,5625	11.065,7752	10.986,3693
Anteilklasse G Distributing I				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	596	7.052	26.064
Anteile im Umlauf		595.679	7.051.544	26.064.019
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse G Distributing II³				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	–	–	–
Anteile im Umlauf		–	209	210
Nettoinventarwert je Anteil	USD	–	1,0000	1,0000
Anteilklasse G Distributing				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	189.004	115.970	102.564
Anteile im Umlauf		189.004.098	115.970.183	102.564.431
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse G Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	7.054	11.046	1
Anteile im Umlauf		668	1.096	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	10.557,8534	10.077,5058	10.000,0000
Anteilklasse G Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	12.485	1.984	1
Anteile im Umlauf		12.484.745	1.984.000	1.000
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Heritage (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	23.887	21.404	5.783
Anteile im Umlauf		222.380	208.766	56.844
Nettoinventarwert je Anteil	USD	107,4137	102,5268	101,7400
Anteilklasse Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	2.337.951	622.550	803.118
Anteile im Umlauf		20.566.478	5.737.485	7.458.867
Nettoinventarwert je Anteil	USD	113,6778	108,5058	107,6729
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	9.015.693	12.753.662	9.111.067
Anteile im Umlauf		9.015.693.110	12.753.662.010	9.111.066.559
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Klasse N				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	57.428	75.645	98.613
Anteile im Umlauf		57.428.095	75.645.421	98.613.064
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Premier (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	4.856.497	3.518.665	4.847.701
Anteile im Umlauf		45.157.960	34.286.253	47.613.883
Nettoinventarwert je Anteil	USD	107,5446	102,6261	101,8128
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	3.197.967	3.423.343	2.301.246
Anteile im Umlauf		28.134.951	31.561.066	21.385.524
Nettoinventarwert je Anteil	USD	113,6653	108,4673	107,6076
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	28.179.753	26.256.604	25.808.294
Anteile im Umlauf		28.179.752.804	26.256.600.880	25.808.294.258
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Select (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	161.758	187.068	171.534
Anteile im Umlauf		1.428.207	1.729.965	1.598.230

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2023	2022	2021
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Select (Acc) (Fortsetzung)				
Nettoinventarwert je Anteil	USD	113,2597	108,1337	107,3272
Anteilklasse Select (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	2.198.556	1.977.789	1.103.570
Anteile im Umlauf		2.198.556.049	1.977.788.998	1.103.570.028
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund				
Anteilklasse Agency				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	164.243	2.100.952	465.134
Anteile im Umlauf		1.410.420	18.943.634	4.223.859
Nettoinventarwert je Anteil	USD	116,4499	110,9054	110,1207
Anteilklasse Core²				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	33.798	10.057	–
Anteile im Umlauf		319.955	99.793	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	105,6328	100,7742	–
Anteilklasse Heritage (CHF Hedged)²				
Nettoinventarwert	Tsd. CHF	67.342	8.451	–
Anteile im Umlauf		675.248	85.323	–
Nettoinventarwert je Anteil	CHF	99,7297	99,0456	–
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	–	–	–
Anteile im Umlauf		1	1	1
Nettoinventarwert je Anteil	USD	100,0000	100,0000	100,0000
Anteilklasse Heritage (SGD Hedged)				
Nettoinventarwert	Tsd. SGD	9.543	23.762	12.412
Anteile im Umlauf		91.280	235.911	124.056
Nettoinventarwert je Anteil	SGD	104,5486	100,7226	100,0477
Anteilklasse Heritage				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	560.426	761.644	2.486
Anteile im Umlauf		5.111.124	7.286.698	23.926
Nettoinventarwert je Anteil	USD	109,6484	104,5252	103,8851
Anteilklasse J (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	138.568	238.006	573.180
Anteile im Umlauf		1.306.166	2.354.965	5.710.051
Nettoinventarwert je Anteil	USD	106,0873	101,0658	100,3809
Anteilklasse J (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	56.602	22.544	87.126
Anteile im Umlauf		567.238	226.135	872.093
Nettoinventarwert je Anteil	USD	99,7848	99,6935	99,9047
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	35.081	17.571	44.584
Anteile im Umlauf		350.467	175.696	444.866
Nettoinventarwert je Anteil	USD	100,0981	100,0063	100,2184
Anteilklasse Premier				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	3.101.392	758.528	1.069.239
Anteile im Umlauf		26.980.865	6.923.778	9.822.560
Nettoinventarwert je Anteil	USD	114,9478	109,5541	108,8554
Anteilklasse Select				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	322.359	412.786	808.566
Anteile im Umlauf		2.750.826	3.694.157	7.278.895
Nettoinventarwert je Anteil	USD	117,1861	111,7403	111,0836
BlackRock ICS US Treasury Fund				
Anteilklasse Admin III (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	9.383	11.198	17.719
Anteile im Umlauf		9.383.144	11.197.933	17.718.594
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Agency (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	5.552	21.285	7.149
Anteile im Umlauf		49.668	199.130	67.372
Nettoinventarwert je Anteil	USD	111,7792	106,8922	106,1111
Anteilklasse Agency (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	655.919	627.069	494.377
Anteile im Umlauf		655.919.271	627.069.203	494.376.650

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2023	2022	2021
BlackRock ICS US Treasury Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse (Dis) (Fortsetzung)				
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	237.703	173.465	169.066
Anteile im Umlauf		2.150.664	1.638.433	1.606.815
Nettoinventarwert je Anteil	USD	110,5255	105,8727	105,2182
Anteilklasse Core (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	9.059.377	8.618.565	8.633.814
Anteile im Umlauf		9.059.377.437	8.618.565.001	8.633.814.455
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Klasse FA³				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	–	–	–
Anteile im Umlauf		–	100	100
Nettoinventarwert je Anteil	USD	–	1,00	1,00
Anteilklasse G Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	4.899	1.414	–
Anteile im Umlauf		458	138	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	10.695,7795	10.245,5133	10.197,0000
Anteilklasse G Distributing				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	1.996	581	–
Anteile im Umlauf		1.995.673	581.110	100
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse G Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	20.090	5.793	1
Anteile im Umlauf		1.909	575	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	10.523,1528	10.072,6184	10.000,0000
Anteilklasse G Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	948	708	1
Anteile im Umlauf		948.471	708.000	1.000
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	314.235	31.191	26.157
Anteile im Umlauf		2.839.324	294.435	248.562
Nettoinventarwert je Anteil	USD	110,6724	105,9341	105,2349
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	2.056.143	1.546.466	1.575.801
Anteile im Umlauf		2.056.143.313	1.546.465.776	1.575.800.701
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Klasse N				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	–	–	–
Anteile im Umlauf		100	100	100
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	1.088.949	304.282	84.320
Anteile im Umlauf		9.797.468	2.860.849	798.158
Nettoinventarwert je Anteil	USD	111,1460	106,3609	105,6429
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	8.011.130	9.683.767	6.359.609
Anteile im Umlauf		8.011.129.708	9.683.765.667	6.359.609.162
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Select (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	1.043.508	495.887	391.483
Anteile im Umlauf		1.043.507.887	495.887.056	391.482.901
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00

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

²Die Anteilklasse wurde während des vorherigen Geschäftsjahres aufgelegt. Daher liegen für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 keine Vergleichsdaten vor.

³Die Anteilklasse wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

15. Wechselkurse

Zum 30. September 2023 und zum 30. September 2022 galten folgende Wechselkurse:

	30. September 2023	30. September 2022
EUR = 1		
CAD	1,4314	1,3461
GBP	0,8674	0,8776
USD	1,0588	0,9796
GBP = 1		
CAD	1,6502	1,5339
EUR	1,1528	1,1395
USD	1,2206	1,1163
USD = 1		
CAD	1,3520	1,3741
CHF	0,9148	0,9843
EUR	0,9445	1,0208
GBP	0,8193	0,8958
SGD	1,3649	1,4349

Die durchschnittlichen Wechselkurse am Ende des Geschäftsjahres waren:

	30. September 2023	30. September 2022
GBP = 1		
EUR	1,1490	1,1805
USD	1,2268	1,2804

16. Transaktionen mit nahestehenden Parteien

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

Die folgenden Unternehmen waren im Geschäftsjahr zum 30. September 2023 dem Unternehmen nahestehende Parteien:

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

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

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

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

16. Transaktionen mit nahestehenden Parteien (Fortsetzung)

Die Verwaltungsratsmitglieder zum 30. September 2023 sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt:

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

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

Anteile an anderen Fonds, die von BlackRock verwaltet werden

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

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

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

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

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

Bedeutende Anleger

Die folgenden Anleger sind:

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

Zum 30. September 2023

Name des Fonds	Gesamtanteil der von BlackRock nahestehenden Anlegern gehaltenen Anteile in %	Gesamtanteil der von bedeutenden Anlegern, die keine BlackRock nahestehenden Anleger sind, gehaltenen Anteile in %	Anzahl der bedeutenden Anleger, die keine BlackRock nahestehenden Anleger sind
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund	null	98,57	1
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	0,05	38,77	1
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	3,21	null	null
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	0,01	20,97	1
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	– ¹	null	null
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	0,02	32,62	1
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	0,24	null	null
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	0,83	null	null
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	– ¹	51,41	2
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	8,91	null	null
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	0,02	null	null
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	– ¹	70,83	1
BlackRock ICS US Treasury Fund	– ¹	null	null

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

16. Transaktionen mit nahestehenden Parteien (Fortsetzung)

Bedeutende Anleger (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

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

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

Die Fonds haben zum Ende des Geschäftsjahres keine Rückstellungen für Forderungen gegenüber nahestehenden Parteien erfasst (30. September 2022: null).

Es wurden im Geschäftsjahr keine Abschreibungen für Forderungen oder Verbindlichkeiten gegenüber nahestehenden Parteien vorgenommen (30. September 2022: null).

Es wurden im Geschäftsjahr gegenüber nahestehenden Parteien keine besicherten oder unbesicherten Verpflichtungen oder Garantien eingegangen (30. September 2022: null).

17. Verpflichtungen und Eventualverbindlichkeiten

Zum 30. September 2023 und 30. September 2022 bestanden keine wesentlichen Verpflichtungen oder Eventualverbindlichkeiten.

18. Gesetzlich vorgeschriebene Angaben

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

	2023 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR
Honorar der Verwaltungsratsmitglieder	65	61
Prüfungsgebühren (einschließlich Kosten) im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses	117	109
Nicht prüfungsbezogene Gebühren	75	null

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

19. Ereignisse nach dem Stichtag

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

- Aktualisierungen der Angaben zu den Verwaltungsratsmitgliedern und der SFDR-Informationen.
- Streichung der Verweise auf Anlagen in Differenzkontrakten.
- Kleine Aktualisierungen der Abschnitte zur Anlagepolitik, um eine enge Angleichung an die Bestimmungen der Geldmarktfondsverordnung zu erreichen.

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

19. Ereignisse nach dem Stichtag (Fortsetzung)

Am 11. Januar 2024 wurden die Anteilklassen Admin III (Acc T0), Admin III (Dis) und Admin IV (Acc T0) für den BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund, den BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund und den BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund aufgelegt. Abgesehen von den oben aufgeführten gab es nach Ablauf des Geschäftsjahres keine Ereignisse, die sich nach Auffassung des Verwaltungsrats auf den Jahresabschluss für das am 30. September 2023 beendete Geschäftsjahr ausgewirkt haben könnten.

20. Genehmigungsdatum

Am 24. Januar 2024 wurde der Jahresabschluss vom Verwaltungsrat genehmigt.

BLACKROCK EURO ULTRA SHORT CORE BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (30. September 2022: 10,44 %)				
Belgien (30. September 2022: 0,00 %)				
20.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 3.79%, 17/11/2023 ¹	19.892	2,91
		Belgien - Gesamt	19.892	2,91
Kanada (30. September 2022: 1,85 %)				
30.000.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 4.19%, 18/09/2024 ¹	28.804	4,21
		Kanada - Gesamt	28.804	4,21
Frankreich (30. September 2022: 1,50 %)				
13.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.52%, 13/02/2024 ¹	12.802	1,87
10.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.69%, 21/02/2024 ¹	9.834	1,44
		Frankreich - Gesamt	22.636	3,31
Irland (30. September 2022: 0,62 %)				
			-	-
Japan (30. September 2022: 3,37 %)				
21.000.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 3.84%, 08/12/2023 ¹	20.837	3,05
		Japan - Gesamt	20.837	3,05
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 3,10 %)				
15.000.000	EUR	Goldman Sachs International Bank, 3.89%, 07/12/2023 ¹	14.885	2,18
29.000.000	EUR	National Westminster Bank plc, 3.90%, 08/12/2023 ¹	28.776	4,21
15.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 3.01%, 14/12/2023 ¹	14.874	2,17
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	58.535	8,56
Anlagen in Einlagenzertifikaten - Gesamt			150.704	22,04
Commercial Papers (30. September 2022: 55,22 %)				
Kanada (30. September 2022: 1,76 %)				
			-	-
Frankreich (30. September 2022: 4,37 %)				
14.000.000	EUR	AXA Banque SACA, 3.76%, 03/01/2024 ¹	13.853	2,03
11.500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.62%, 06/11/2023 ¹	11.452	1,67
		Frankreich - Gesamt	25.305	3,70
Deutschland (30. September 2022: 5,24 %)				
10.000.000	EUR	SAP SE, 3.75%, 10/11/2023 ¹	9.954	1,46
		Deutschland - Gesamt	9.954	1,46
Japan (30. September 2022: 2,49 %)				
			-	-
Luxemburg (30. September 2022: 0,37 %)				
5.500.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 3.76%, 23/10/2023 ¹	5.485	0,80
4.500.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 3.77%, 21/11/2023 ¹	4.474	0,65
12.000.000	EUR	DH Europe Finance II SARL, 3.90%, 06/11/2023 ¹	11.950	1,75
		Luxemburg - Gesamt	21.909	3,20
Niederlande (30. September 2022: 4,62 %)				
5.000.000	EUR	Avery Dennison Corp., 3.71%, 10/10/2023 ¹	4.994	0,73
10.000.000	EUR	Avery Dennison Corp., 3.82%, 12/12/2023 ¹	9.914	1,45
5.000.000	EUR	Enel Finance International NV, 4.12%, 29/12/2023 ¹	4.949	0,72
		Niederlande - Gesamt	19.857	2,90

BLACKROCK EURO ULTRA SHORT CORE BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
		Spanien (30. September 2022: 0,87 %)	-	-
		Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 16,34 %)		
20.000.000	EUR	Amcor UK Finance plc, 3.50%, 11/10/2023 ¹	19.972	2,92
11.500.000	EUR	Amcor UK Finance plc, 3.81%, 12/12/2023 ¹	11.399	1,67
25.000.000	EUR	Barclays Bank plc, 3.60%, 05/02/2024 ¹	24.643	3,60
15.000.000	EUR	Sumitomo Corp. Capital Europe plc, 3.78%, 16/10/2023 ¹	14.972	2,19
7.500.000	EUR	Sumitomo Corp. Capital Europe plc, 3.87%, 23/10/2023 ¹	7.480	1,09
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	78.466	11,47
		Vereinigte Staaten (30. September 2022: 19,16 %)		
10.000.000	EUR	Danaher Corp., 3.78%, 17/10/2023 ¹	9.980	1,46
15.000.000	EUR	Honeywell International, Inc., 3.89%, 27/11/2023 ¹	14.902	2,18
7.000.000	EUR	Honeywell International, Inc., 3.86%, 04/01/2024 ¹	6.925	1,01
13.000.000	EUR	Realty Income Corp., 3.64%, 18/10/2023 ¹	12.973	1,90
		Vereinigte Staaten - Gesamt	44.780	6,55
		Anlagen in Commercial Papers - Gesamt	200.271	29,28
			Zeitwert	% des Netto-
			Tsd. EUR	inventarwerts
ANLEIHEN				
		Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2022: 33,97 %)		
		Australien (30. September 2022: 3,76 %)		
30.000.000	EUR	Macquarie Bank Ltd., FRN, 4.61%, 20/10/2023	30.005	4,39
		Australien - Gesamt	30.005	4,39
		Kanada (30. September 2022: 0,00 %)		
12.000.000	EUR	Canadian Imperial Bank of Commerce, 4.00%, 14/06/2024	11.972	1,75
		Kanada - Gesamt	11.972	1,75
		Finnland (30. September 2022: 1,64 %)		
13.000.000	EUR	OP Corporate Bank plc, FRN, 4.79%, 17/05/2024	13.060	1,91
		Finnland - Gesamt	13.060	1,91
		Frankreich (30. September 2022: 7,64 %)		
7.500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 4.01%, 17/01/2025	7.511	1,10
10.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 4.18%, 08/09/2025	10.000	1,46
10.000.000	EUR	BPCE SA, 0.63%, 28/04/2025	9.449	1,38
20.000.000	EUR	BPCE SA, FRN, 4.06%, 18/07/2025	19.990	2,92
6.300.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.15%, 23/12/2023	6.288	0,92
15.000.000	EUR	HSBC Continental Europe SA, FRN, 4.97%, 28/06/2024	15.067	2,21
12.500.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 4.12%, 13/01/2025	12.521	1,83
		Frankreich - Gesamt	80.826	11,82
		Deutschland (30. September 2022: 0,00 %)		
25.000.000	EUR	DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main, FRN, 4.22%, 28/02/2025	24.994	3,65
		Deutschland - Gesamt	24.994	3,65

BLACKROCK EURO ULTRA SHORT CORE BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
		Luxemburg (30. September 2022: 0,92 %)	-	-
		Niederlande (30. September 2022: 7,74 %)		
8.700.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 2.50%, 29/11/2023	8.676	1,27
13.900.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, FRN, 3.96%, 10/01/2025	13.923	2,03
24.000.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, FRN, 4.17%, 28/05/2025	24.000	3,51
		Niederlande - Gesamt	46.599	6,81
		Neuseeland (30. September 2022: 0,62 %)		
5.000.000	EUR	BNZ International Funding Ltd., 0.38%, 14/09/2024	4.823	0,70
		Neuseeland - Gesamt	4.823	0,70
		Norwegen (30. September 2022: 1,69 %)		
14.000.000	EUR	DNB Bank ASA, 0.05%, 14/11/2023	13.935	2,04
		Norwegen - Gesamt	13.935	2,04
		Spanien (30. September 2022: 0,00 %)		
4.000.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 4.74%, 05/05/2024	4.019	0,59
17.800.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 4.21%, 16/01/2025	17.839	2,61
		Spanien - Gesamt	21.858	3,20
		Schweden (30. September 2022: 2,36 %)	-	-
		Schweiz (30. September 2022: 3,87 %)	-	-
		Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 0,62 %)		
21.000.000	EUR	Lloyds Bank Corporate Markets plc, FRN, 4.22%, 30/08/2025	20.943	3,06
4.000.000	EUR	NatWest Markets plc, 2.00%, 27/08/2025	3.836	0,56
20.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, FRN, 4.35%, 03/03/2025	20.056	2,93
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	44.835	6,55
		Vereinigte Staaten (30. September 2022: 3,11 %)		
20.000.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, FRN, 4.32%, 18/06/2025	20.081	2,94
		Vereinigte Staaten - Gesamt	20.081	2,94
		Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt	312.988	45,76
		Anlagen in Anleihen - Gesamt	312.988	45,76
		Beschreibung	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR
		Kontrahent		% des Netto- inventarwerts
		Devisenterminkontrakte		
		Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2022: 0,06 %)	-	-
		Devisenterminkontrakte		
		Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2022: (0,18) %)	-	-

BLACKROCK EURO ULTRA SHORT CORE BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Anzahl der Kontrakte	Währung	Nennwert	Beschreibung	Fälligkeits-termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Nettoinventarwerts
Terminkontrakte (Futures)						
Deutschland (30. September 2022: 0,06 %)					-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) - Gesamt (30. September 2022: 0,06 %)					-	-
					Zeitwert Tsd. EUR	% des Nettoinventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					663.963	97,08
Zahlungsmittel					18.178	2,66
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					1.761	0,26
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					683.902	100,00
Analyse des Gesamtvermögens						% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind						45,76
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)						51,31
Sonstige Vermögenswerte						2,93
Gesamtvermögen						100,00

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

BLACKROCK ICS EURO GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen		Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts	
ANLEIHEN						
Staatsanleihen (30. September 2022: 49,98 %)						
Österreich (30. September 2022: 3,81 %)						
60.000.000	EUR	Austria Treasury Bill, 3.82%, 25/01/2024 ¹		59.276	3,95	
		Österreich - Gesamt		59.276	3,95	
Belgien (30. September 2022: 0,00 %)						
100.000	EUR	Belgium Treasury Bill, 3.22%, 09/11/2023 ¹		100	0,01	
100.000	EUR	Belgium Treasury Bill, 3.21%, 11/01/2024 ¹		99	0,01	
100.000	EUR	Belgium Treasury Bill, 3.25%, 07/03/2024 ¹		98	–	
		Belgien - Gesamt		297	0,02	
Frankreich (30. September 2022: 42,37 %)						
100.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 3.60%, 25/10/2023 ¹		100	0,01	
100.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 3.82%, 06/12/2023 ¹		99	0,01	
11.400.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 3.63%, 10/01/2024 ¹		11.287	0,75	
55.815.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 3.69%, 10/01/2024 ¹		55.251	3,68	
100.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 3.64%, 24/01/2024 ¹		99	0,01	
100.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 3.64%, 21/02/2024 ¹		99	–	
100.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 3.69%, 20/03/2024 ¹		98	–	
		Frankreich - Gesamt		67.033	4,46	
Deutschland (30. September 2022: 0,00 %)						
100.000	EUR	Germany Treasury Bill, 2.95%, 18/10/2023 ¹		100	0,01	
		Deutschland - Gesamt		100	0,01	
Niederlande (30. September 2022: 3,80 %)						
				–	–	
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt				126.706	8,44	
Supranationale Wertpapiere (30. September 2022: 0,00 %)						
3.000.000	EUR	European Stability Mechanism Treasury Bill, 3.64%, 09/11/2023 ¹		2.989	0,20	
4.500.000	EUR	European Union Bill, 3.64%, 12/01/2024 ¹		4.454	0,30	
17.275.000	EUR	European Union Bill, 3.66%, 09/02/2024 ¹		17.051	1,13	
Anlagen in supranationalen Wertpapieren - Gesamt				24.494	1,63	
Anlagen in Anleihen - Gesamt				151.200	10,07	
Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2022: 40,60 %)						
Kanada (30. September 2022: 13,95 %)						
199.000.000	EUR	Bank of Nova Scotia plc	3,70 %	02.10.2023	199.000	13,26
Kanada - Gesamt					199.000	13,26

BLACKROCK ICS EURO GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung)						
Frankreich (30. September 2022: 0,00 %)						
200.000.000	EUR	BNP Paribas SA	3,70 %	02.10.2023	200.000	13,32
200.000.000	EUR	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	3,68 %	02.10.2023	200.000	13,32
200.000.000	EUR	Natixis SA	3,69 %	02.10.2023	200.000	13,32
30.000.000	EUR	Societe Generale SA	3,63 %	02.10.2023	30.000	2,00
Frankreich - Gesamt					630.000	41,96
Japan (30. September 2022: 0,00 %)						
200.000.000	EUR	MUFG Securities EMEA plc	3,70 %	02.10.2023	200.000	13,32
Japan - Gesamt					200.000	13,32
Spanien (30. September 2022: 0,00 %)						
200.000.000	EUR	Santander UK plc	3,70 %	02.10.2023	200.000	13,32
Spanien - Gesamt					200.000	13,32
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 12,69 %)						
100.000.000	EUR	NatWest Markets plc	3,65 %	02.10.2023	100.000	6,66
Vereinigtes Königreich - Gesamt					100.000	6,66
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 13,96 %)						
5.000.000	EUR	BofA Securities Europe SA	3,57 %	02.10.2023	5.000	0,34
Vereinigte Staaten - Gesamt					5.000	0,34
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					1.334.000	88,86
					Zeitwert	% des Netto-
					Tsd. EUR	inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					1.485.200	98,93
Barmittel und Barsicherheiten					23.609	1,57
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					(7.482)	(0,50)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					1.501.327	100,00
Analyse des Gesamtvermögens						% des Gesamt-
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind						vermögens
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						10,02
Sonstige Vermögenswerte						88,39
Gesamtvermögen						1,59
						100,00

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

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (30. September 2022: 21,71 %)				
Belgien (30. September 2022: 0,71 %)				
100.000.000	EUR	KBC Bank NV, 3.94%, 31/10/2023 ¹	99.649	1,57
49.000.000	EUR	KBC Bank NV, 4.02%, 04/01/2024 ¹	48.468	0,76
131.000.000	EUR	KBC Bank NV, 4.00%, 08/01/2024 ¹	129.518	2,04
		Belgien - Gesamt	277.635	4,37
Kanada (30. September 2022: 2,91 %)				
15.500.000	EUR	Bank of Montreal, FRN, 4.14%, 21/06/2024	15.500	0,24
32.000.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 4.30%, 17/06/2024	32.019	0,50
125.500.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 4.30%, 18/07/2024	125.585	1,98
96.500.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 4.30%, 19/08/2024	96.572	1,52
15.000.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 4.23%, 18/09/2024 ¹	14.402	0,23
		Kanada - Gesamt	284.078	4,47
Finnland (30. September 2022: 2,56 %)				
37.500.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 4.00%, 17/06/2024 ¹	36.395	0,57
		Finnland - Gesamt	36.395	0,57
Frankreich (30. September 2022: 3,60 %)				
110.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.60%, 01/11/2023 ¹	109.603	1,72
117.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.83%, 03/01/2024 ¹	115.757	1,82
20.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 4.23%, 05/07/2024 ¹	19.372	0,31
53.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 4.23%, 08/07/2024 ¹	51.319	0,81
		Frankreich - Gesamt	296.051	4,66
Japan (30. September 2022: 6,60 %)				
52.500.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.90%, 10/11/2023 ¹	52.258	0,82
19.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.96%, 01/12/2023 ¹	18.868	0,30
52.500.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.97%, 10/01/2024 ¹	51.898	0,82
6.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.95%, 10/01/2024 ¹	5.931	0,09
24.000.000	EUR	Mizuho Corporate Bank Ltd., 3.95%, 20/10/2023 ¹	23.945	0,38
100.000.000	EUR	Mizuho Corporate Bank Ltd., 3.93%, 01/11/2023 ¹	99.637	1,57
17.500.000	EUR	Mizuho Corporate Bank Ltd., 3.95%, 01/12/2023 ¹	17.378	0,27
50.000.000	EUR	Mizuho Corporate Bank Ltd., 3.84%, 02/01/2024 ¹	49.473	0,78
75.500.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 3.80%, 17/10/2023 ¹	75.349	1,18
21.000.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 3.92%, 08/12/2023 ¹	20.837	0,33
40.000.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 3.93%, 12/12/2023 ¹	39.671	0,62
		Japan - Gesamt	455.245	7,16
Niederlande (30. September 2022: 0,00 %)				
25.500.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.90%, 02/01/2024 ¹	25.239	0,40
		Niederlande - Gesamt	25.239	0,40
Südkorea (30. September 2022: 0,00 %)				
5.000.000	EUR	KEB Hana Bank, 3.94%, 01/12/2023 ¹	4.968	0,08
5.000.000	EUR	KEB Hana Bank, 4.15%, 18/01/2024 ¹	4.940	0,08
4.000.000	EUR	KEB Hana Bank, 4.20%, 01/02/2024 ¹	3.945	0,06
3.500.000	EUR	KEB Hana Bank, 4.07%, 12/02/2024 ¹	3.448	0,05
2.500.000	EUR	KEB Hana Bank, 4.17%, 07/03/2024 ¹	2.456	0,04
8.000.000	EUR	KEB Hana Bank, 4.20%, 25/03/2024 ¹	7.841	0,12
4.000.000	EUR	KEB Hana Bank, 4.09%, 02/04/2024 ¹	3.917	0,06
5.000.000	EUR	KEB Hana Bank, 4.20%, 15/05/2024 ¹	4.871	0,08
		Südkorea - Gesamt	36.386	0,57
Schweiz (30. September 2022: 0,00 %)				
13.500.000	EUR	UBS AG, 3.67%, 31/10/2023 ¹	13.453	0,21

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- Inventarwerts
Einlagezertifikate (Fortsetzung)				
Schweiz (Fortsetzung)				
7.000.000	EUR	UBS AG, 3.67%, 03/11/2023 ¹	6.973	0,11
19.000.000	EUR	UBS AG, 3.63%, 13/11/2023 ¹	18.906	0,30
39.500.000	EUR	UBS AG, 3.97%, 03/01/2024 ¹	39.079	0,61
		Schweiz - Gesamt	78.411	1,23
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 5,33 %)				
30.000.000	EUR	Mizuho International plc, 3.87%, 20/11/2023 ¹	29.828	0,47
20.000.000	EUR	Mizuho International plc, 4.00%, 05/01/2024 ¹	19.783	0,31
7.500.000	EUR	Mizuho International plc, 4.00%, 08/02/2024 ¹	7.390	0,11
25.500.000	EUR	National Westminster Bank plc, 3.72%, 02/11/2023 ¹	25.405	0,40
36.000.000	EUR	National Westminster Bank plc, 3.95%, 05/01/2024 ¹	35.608	0,56
61.500.000	EUR	Standard Chartered Bank, 3.95%, 04/10/2023 ¹	61.466	0,97
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	179.480	2,82
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,00 %)				
25.000.000	EUR	Citibank NA, 3.90%, 02/01/2024 ¹	24.736	0,39
		Vereinigte Staaten - Gesamt	24.736	0,39
Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt			1.693.656	26,64
Commercial Papers (30. September 2022: 33,40 %)				
Finnland (30. September 2022: 0,08 %)				
			-	-
Frankreich (30. September 2022: 15,32 %)				
175.000.000	EUR	Antalis SA, 3.99%, 18/10/2023 ¹	174.619	2,75
6.000.000	EUR	Antalis SA, 4.00%, 23/10/2023 ¹	5.983	0,09
28.500.000	EUR	AXA Banque SACA, 3.63%, 13/11/2023 ¹	28.359	0,45
55.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 4.15%, 06/11/2023	55.001	0,87
80.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 4.27%, 02/01/2024	80.017	1,26
20.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 4.23%, 02/08/2024	20.007	0,31
53.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.66%, 06/11/2023 ¹	52.780	0,83
80.000.000	EUR	BPCE SA, FRN, 4.27%, 02/01/2024	80.022	1,26
95.000.000	EUR	BPCE SA, FRN, 4.24%, 15/07/2024	95.031	1,49
70.000.000	EUR	BPCE SA, 4.21%, 02/04/2024 ¹	68.517	1,08
250.000.000	EUR	La Banque Postale SA, 3.89%, 02/10/2023 ¹	249.918	3,93
250.000.000	EUR	La Banque Postale SA, 0.00%, 03/10/2023 ¹	249.973	3,93
25.000.000	EUR	Natixis SA, 3.95%, 02/01/2024 ¹	24.736	0,39
9.000.000	EUR	Satellite, 3.99%, 30/10/2023 ¹	8.968	0,14
60.000.000	EUR	Satellite, 4.00%, 09/11/2023 ¹	59.718	0,94
10.000.000	EUR	Satellite, 4.07%, 10/01/2024 ¹	9.879	0,16
13.000.000	EUR	Satellite, 4.09%, 22/01/2024 ¹	12.824	0,20
		Frankreich - Gesamt	1.276.352	20,08
Deutschland (30. September 2022: 2,74 %)				
4.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 4.14%, 03/04/2024 ¹	3.915	0,06
12.500.000	EUR	Standard Chartered Bank, 4.20%, 03/05/2024 ¹	12.191	0,19
25.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 4.20%, 02/07/2024 ¹	24.210	0,38
		Deutschland - Gesamt	40.316	0,63
Irland (30. September 2022: 6,41 %)				
40.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 4.00%, 01/11/2023 ¹	39.849	0,63
75.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 4.03%, 20/11/2023 ¹	74.551	1,17
7.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 3.92%, 24/11/2023 ¹	6.955	0,11
20.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 3.94%, 01/12/2023 ¹	19.855	0,31

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Irland (Fortsetzung)				
30.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 3.98%, 02/01/2024 ¹	29.667	0,47
73.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 4.11%, 22/01/2024 ¹	72.014	1,13
		Irland - Gesamt	242.891	3,82
Luxemburg (30. September 2022: 0,00 %)				
3.885.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 3.85%, 11/10/2023 ¹	3.880	0,06
20.000.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 3.85%, 16/10/2023 ¹	19.962	0,31
10.000.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 4.00%, 25/10/2023 ¹	9.971	0,16
20.000.000	EUR	Clearstream Banking SA, 3.98%, 27/11/2023 ¹	19.874	0,31
20.000.000	EUR	Clearstream Banking SA, 3.98%, 28/11/2023 ¹	19.872	0,31
15.000.000	EUR	Clearstream Banking SA, 3.98%, 30/11/2023 ¹	14.900	0,24
		Luxemburg - Gesamt	88.459	1,39
Schweden (30. September 2022: 1,73 %)				
25.000.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.06%, 17/06/2024 ¹	24.273	0,38
		Schweden - Gesamt	24.273	0,38
Schweiz (30. September 2022: 0,00 %)				
7.500.000	EUR	UBS AG, 3.67%, 20/10/2023 ¹	7.483	0,12
		Schweiz - Gesamt	7.483	0,12
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 5,40 %)				
100.000.000	EUR	Barclays Bank plc, FRN, 4.33%, 06/11/2023	100.015	1,57
95.000.000	EUR	Barclays Bank plc, FRN, 4.22%, 31/05/2024	95.045	1,50
30.000.000	EUR	Barclays Bank plc, 3.52%, 10/11/2023 ¹	29.862	0,47
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	224.922	3,54
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 1,72 %)				
10.000.000	EUR	Mont Blanc Capital Corp., 3.67%, 12/10/2023 ¹	9.986	0,16
		Vereinigte Staaten - Gesamt	9.986	0,16
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			1.914.682	30,12
Termineinlagen (30. September 2022: 37,46 %)				
Österreich (30. September 2022: 7,74 %)				
			-	-
Belgien (30. September 2022: 7,33 %)				
145.000.000	EUR	KBC Bank NV, 3.89%, 02/10/2023	145.000	2,28
		Belgien - Gesamt	145.000	2,28
Kanada (30. September 2022: 3,05 %)				
100.000.000	EUR	Bank of Nova Scotia (The), 3.87%, 02/10/2023	100.000	1,57
		Kanada - Gesamt	100.000	1,57
Frankreich (30. September 2022: 8,14 %)				
278.739.125	EUR	BRED Banque Populaire, 3.86%, 02/10/2023	278.739	4,39
100.000.000	EUR	Credit Mutuel, 3.85%, 02/10/2023	100.000	1,57
100.000.000	EUR	Societe Generale SA, 3.80%, 02/10/2023	100.000	1,57
		Frankreich - Gesamt	478.739	7,53

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Termineinlagen (Fortsetzung)				
550.411.849	EUR	Deutschland (30. September 2022: 7,13 %) DZ Bank AG, 3.85%, 02/10/2023	550.412	8,66
		Deutschland - Gesamt	550.412	8,66
200.000.000	EUR	Japan (30. September 2022: 4,07 %) Mizuho Bank Ltd., 3.87%, 02/10/2023	200.000	3,15
250.726.331	EUR	MUFG Bank Ltd., 3.90%, 02/10/2023	250.726	3,94
		Japan - Gesamt	450.726	7,09
		Anlagen in Termineinlagen - Gesamt	1.724.877	27,13

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
---------	---------	---------	----------------------	-------------------------------

ANLEIHEN

Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2022: 3,07 %)

124.000.000	EUR	Kanada (30. September 2022: 0,00 %) Bank of Nova Scotia (The), FRN, 4.21%, 14/06/2024	124.054	1,95
62.000.000	EUR	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 4.29%, 12/07/2024	62.031	0,98
110.000.000	EUR	Canadian Imperial Bank of Commerce, 4.00%, 14/06/2024	109.780	1,73
		Kanada - Gesamt	295.865	4,66
30.000.000	EUR	Luxemburg (30. September 2022: 3,07 %) SG Issuer SA, FRN, 3.97%, 19/01/2024	30.006	0,47
		Luxemburg - Gesamt	30.006	0,47
		Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt	325.871	5,13
		Anlagen in Anleihen - Gesamt	325.871	5,13

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2022: 2,03 %)						
Frankreich (30. September 2022: 0,00 %)						
300.000.000	EUR	BNP Paribas SA	3,70 %	02.10.2023	300.000	4,72
		Frankreich - Gesamt			300.000	4,72
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 2,03 %)						
400.000.000	EUR	NatWest Markets plc	3,65 %	02.10.2023	400.000	6,29
		Vereinigtes Königreich - Gesamt			400.000	6,29
		Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt			700.000	11,01

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	6.359.086	100,03
Zahlungsmittel	241.746	3,80
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	(243.361)	(3,83)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert	6.357.471	100,00

Analyse des Gesamtvermögens

	% des Gesamt- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind	4,47
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	11,04
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)	80,63
Sonstige Vermögenswerte	3,86
Gesamtvermögen	100,00

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

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (30. September 2022: 28,21 %)				
Belgien (30. September 2022: 0,74 %)				
273.000.000	EUR	KBC Bank NV, 3.94%, 31/10/2023 ¹	272.138	0,59
350.000.000	EUR	KBC Bank NV, 4.02%, 04/01/2024 ¹	346.368	0,75
367.500.000	EUR	KBC Bank NV, 4.00%, 08/01/2024 ¹	363.542	0,79
		Belgien - Gesamt	982.048	2,13
Kanada (30. September 2022: 3,47 %)				
109.000.000	EUR	Bank of Montreal, FRN, 4.14%, 21/06/2024	109.000	0,24
218.000.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 4.30%, 17/06/2024	218.000	0,47
872.000.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 4.30%, 18/07/2024	872.000	1,89
652.000.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 4.30%, 19/08/2024	652.000	1,41
		Kanada - Gesamt	1.851.000	4,01
Finnland (30. September 2022: 2,86 %)				
262.000.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 4.00%, 17/06/2024 ¹	254.753	0,55
		Finnland - Gesamt	254.753	0,55
Frankreich (30. September 2022: 3,29 %)				
350.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.60%, 01/11/2023 ¹	348.968	0,76
383.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.83%, 03/01/2024 ¹	379.298	0,82
499.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.98%, 08/04/2024 ¹	488.913	1,06
329.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 4.23%, 05/07/2024 ¹	318.638	0,69
545.500.000	EUR	Credit Agricole SA, 4.23%, 08/07/2024 ¹	528.144	1,14
		Frankreich - Gesamt	2.063.961	4,47
Japan (30. September 2022: 11,49 %)				
47.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.89%, 01/11/2023 ¹	46.849	0,10
50.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.88%, 03/11/2023 ¹	49.829	0,11
50.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.88%, 06/11/2023 ¹	49.813	0,11
22.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.90%, 10/11/2023 ¹	21.908	0,05
299.500.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.91%, 13/11/2023 ¹	298.147	0,65
130.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.96%, 01/12/2023 ¹	129.150	0,28
100.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.95%, 06/12/2023 ¹	99.294	0,22
50.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.95%, 08/12/2023 ¹	49.636	0,11
44.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.95%, 10/01/2024 ¹	43.525	0,09
22.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.97%, 10/01/2024 ¹	21.761	0,05
75.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.98%, 16/01/2024 ¹	74.134	0,16
176.000.000	EUR	Mizuho Corporate Bank Ltd., 3.95%, 20/10/2023 ¹	175.654	0,38
132.000.000	EUR	Mizuho Corporate Bank Ltd., 3.95%, 01/12/2023 ¹	131.138	0,28
249.000.000	EUR	Mizuho Corporate Bank Ltd., 3.84%, 02/01/2024 ¹	246.602	0,53
223.500.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 3.80%, 17/10/2023 ¹	223.149	0,48
200.000.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 3.93%, 05/12/2023 ¹	198.616	0,43
263.000.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 3.92%, 08/12/2023 ¹	261.100	0,57
210.000.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 3.93%, 12/12/2023 ¹	208.388	0,45
225.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 3.98%, 20/11/2023 ¹	223.790	0,48
549.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 3.90%, 14/12/2023 ¹	544.706	1,18
148.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 4.00%, 08/01/2024 ¹	146.408	0,32
200.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 4.00%, 09/01/2024 ¹	197.827	0,43
81.500.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.90%, 16/10/2023 ¹	81.377	0,18
150.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.90%, 08/11/2023 ¹	149.403	0,32
149.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.90%, 13/11/2023 ¹	148.327	0,32
80.500.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.91%, 14/11/2023 ¹	80.127	0,17
100.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.91%, 15/11/2023 ¹	99.525	0,22
99.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.92%, 08/12/2023 ¹	98.285	0,21
149.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.92%, 11/12/2023 ¹	147.875	0,32
248.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.92%, 04/01/2024 ¹	245.496	0,53
		Japan - Gesamt	4.491.839	9,73

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (Fortsetzung)				
Niederlande (30. September 2022: 0,00 %)				
174.000.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.90%, 02/01/2024 ¹	172.300	0,37
		Niederlande - Gesamt	172.300	0,37
Südkorea (30. September 2022: 0,00 %)				
34.500.000	EUR	KEB Hana Bank, 3.94%, 01/12/2023 ¹	34.276	0,07
26.000.000	EUR	KEB Hana Bank, 4.20%, 01/02/2024 ¹	25.638	0,06
26.500.000	EUR	KEB Hana Bank, 4.07%, 12/02/2024 ¹	26.110	0,06
17.500.000	EUR	KEB Hana Bank, 4.17%, 07/03/2024 ¹	17.189	0,04
26.000.000	EUR	KEB Hana Bank, 4.09%, 02/04/2024 ¹	25.473	0,05
15.000.000	EUR	KEB Hana Bank, 4.20%, 15/05/2024 ¹	14.615	0,03
		Südkorea - Gesamt	143.301	0,31
Schweiz (30. September 2022: 0,00 %)				
86.500.000	EUR	UBS AG, 3.67%, 31/10/2023 ¹	86.249	0,19
43.000.000	EUR	UBS AG, 3.67%, 03/11/2023 ¹	42.862	0,09
131.000.000	EUR	UBS AG, 3.63%, 13/11/2023 ¹	130.456	0,28
260.000.000	EUR	UBS AG, 3.97%, 03/01/2024 ¹	257.388	0,56
		Schweiz - Gesamt	516.955	1,12
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 6,36 %)				
44.000.000	EUR	Mizuho International plc, 3.87%, 20/11/2023 ¹	43.771	0,09
80.000.000	EUR	Mizuho International plc, 3.74%, 04/12/2023 ¹	79.486	0,17
41.500.000	EUR	Mizuho International plc, 4.00%, 08/02/2024 ¹	40.917	0,09
100.000.000	EUR	National Westminster Bank plc, 3.72%, 01/11/2023 ¹	99.695	0,22
74.000.000	EUR	National Westminster Bank plc, 3.72%, 02/11/2023 ¹	73.766	0,16
255.000.000	EUR	National Westminster Bank plc, 3.95%, 05/01/2024 ¹	252.400	0,55
437.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 3.95%, 04/10/2023 ¹	436.904	0,95
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	1.026.939	2,23
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,00 %)				
174.500.000	EUR	Citibank NA, 3.90%, 02/01/2024 ¹	172.793	0,38
		Vereinigte Staaten - Gesamt	172.793	0,38
Anlagen in Einlagenzertifikaten - Gesamt			11.675.889	25,30
Commercial Papers (30. September 2022: 41,95 %)				
Australien (30. September 2022: 0,83 %)				
			-	-
Österreich (30. September 2022: 0,54 %)				
			-	-
Belgien (30. September 2022: 1,41 %)				
			-	-
Dänemark (30. September 2022: 1,41 %)				
445.000.000	EUR	Jyske Bank A/S, 3.88%, 09/10/2023 ¹	444.665	0,96
		Dänemark - Gesamt	444.665	0,96
Finnland (30. September 2022: 1,08 %)				
			-	-
Frankreich (30. September 2022: 19,23 %)				
250.000.000	EUR	Antalis SA, 3.99%, 18/10/2023 ¹	249.558	0,54
235.000.000	EUR	Antalis SA, 3.99%, 18/10/2023 ¹	234.585	0,51
166.000.000	EUR	Antalis SA, 4.00%, 23/10/2023 ¹	165.614	0,36
195.000.000	EUR	AXA Banque SACA, 3.63%, 13/11/2023 ¹	194.189	0,42

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
344.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 4.15%, 06/11/2023	344.000	0,74
718.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 4.27%, 02/01/2024	718.000	1,56
479.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 4.23%, 02/08/2024	479.000	1,04
331.500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.66%, 06/11/2023 ¹	330.344	0,72
618.000.000	EUR	BPCE SA, FRN, 4.27%, 02/01/2024	618.000	1,34
249.000.000	EUR	BPCE SA, FRN, 4.29%, 24/01/2024	249.000	0,54
493.000.000	EUR	BPCE SA, FRN, 4.24%, 15/07/2024	493.000	1,07
382.000.000	EUR	BPCE SA, 4.21%, 02/04/2024 ¹	374.003	0,81
70.000.000	EUR	Eurotitrisation - SAT Magenta, 3.89%, 02/10/2023 ¹	70.000	0,15
60.000.000	EUR	Eurotitrisation - SAT Magenta, 0.00%, 03/10/2023 ¹	59.993	0,13
1.350.000.000	EUR	La Banque Postale SA, 3.89%, 02/10/2023 ¹	1.350.000	2,93
1.350.000.000	EUR	La Banque Postale SA, 0.00%, 03/10/2023 ¹	1.349.854	2,92
225.000.000	EUR	Natixis SA, 3.95%, 02/01/2024 ¹	222.773	0,48
21.000.000	EUR	Satellite, 3.99%, 30/10/2023 ¹	20.935	0,04
75.000.000	EUR	Satellite, 4.00%, 09/11/2023 ¹	74.685	0,16
10.000.000	EUR	Satellite, 4.07%, 10/01/2024 ¹	9.888	0,02
87.000.000	EUR	Satellite, 4.09%, 22/01/2024 ¹	85.908	0,19
		Frankreich - Gesamt	7.693.329	16,67
Deutschland (30. September 2022: 1,18 %)				
400.000.000	EUR	Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 3.90%, 02/10/2023 ¹	400.000	0,87
100.000.000	EUR	Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 3.90%, 02/10/2023 ¹	100.000	0,22
995.000.000	EUR	Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 3.90%, 09/10/2023 ¹	994.247	2,15
500.000.000	EUR	Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 3.90%, 09/10/2023 ¹	499.621	1,08
30.500.000	EUR	Standard Chartered Bank, 4.14%, 03/04/2024 ¹	29.872	0,06
87.500.000	EUR	Standard Chartered Bank, 4.20%, 03/05/2024 ¹	85.383	0,19
		Deutschland - Gesamt	2.109.123	4,57
Irland (30. September 2022: 3,64 %)				
117.500.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 4.00%, 01/11/2023 ¹	117.110	0,25
80.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 4.00%, 01/11/2023 ¹	79.735	0,17
500.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 4.03%, 20/11/2023 ¹	497.276	1,08
60.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 4.03%, 20/11/2023 ¹	59.673	0,13
35.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 3.92%, 24/11/2023 ¹	34.800	0,08
29.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 3.92%, 24/11/2023 ¹	28.834	0,06
80.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 3.94%, 01/12/2023 ¹	79.480	0,17
220.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 3.98%, 02/01/2024 ¹	217.800	0,47
100.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 3.98%, 02/01/2024 ¹	99.000	0,21
288.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 3.98%, 03/01/2024 ¹	285.088	0,62
75.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 3.98%, 03/01/2024 ¹	74.242	0,16
195.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 4.11%, 22/01/2024 ¹	192.541	0,42
50.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 4.11%, 22/01/2024 ¹	49.370	0,11
		Irland - Gesamt	1.814.949	3,93
Japan (30. September 2022: 1,40 %)				
150.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 3.84%, 03/11/2023 ¹	149.493	0,33
498.500.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 3.91%, 04/12/2023 ¹	495.127	1,07
		Japan - Gesamt	644.620	1,40
Luxemburg (30. September 2022: 2,24 %)				
25.059.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 3.99%, 11/10/2023 ¹	25.034	0,06
15.000.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 3.85%, 11/10/2023 ¹	14.986	0,03
99.367.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 3.85%, 16/10/2023 ¹	99.219	0,22
66.512.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 3.80%, 23/10/2023 ¹	66.366	0,14
8.204.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 4.00%, 23/10/2023 ¹	8.185	0,02
47.685.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 4.00%, 25/10/2023 ¹	47.564	0,10
6.271.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 4.00%, 31/10/2023 ¹	6.251	0,01

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Luxemburg (Fortsetzung)				
96.253.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 3.95%, 16/11/2023 ¹	95.781	0,21
32.232.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 3.94%, 22/11/2023 ¹	32.054	0,07
10.000.000	EUR	Clearstream Banking SA, 3.98%, 28/11/2023 ¹	9.937	0,02
112.250.000	EUR	Sunderland Receivables SA, 3.92%, 09/11/2023 ¹	111.790	0,24
125.000.000	EUR	Sunderland Receivables SA, 3.95%, 21/11/2023 ¹	124.321	0,27
134.500.000	EUR	Sunderland Receivables SA, 3.94%, 30/11/2023 ¹	133.640	0,29
		Luxemburg - Gesamt	775.128	1,68
Niederlande (30. September 2022: 3,60 %)				
500.000.000	EUR	BNG Bank NV, 3.87%, 25/10/2023 ¹	498.768	1,08
245.000.000	EUR	Kingdom of The Netherlands, 3.85%, 02/10/2023 ¹	245.000	0,53
1.000.000.000	EUR	Kingdom of The Netherlands, 3.85%, 05/10/2023 ¹	999.679	2,17
		Niederlande - Gesamt	1.743.447	3,78
Schweden (30. September 2022: 2,15 %)				
174.500.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.06%, 17/06/2024 ¹	169.610	0,37
		Schweden - Gesamt	169.610	0,37
Schweiz (30. September 2022: 0,00 %)				
52.000.000	EUR	UBS AG, 3.67%, 20/10/2023 ¹	51.906	0,11
		Schweiz - Gesamt	51.906	0,11
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 2,92 %)				
349.000.000	EUR	Barclays Bank plc, FRN, 4.33%, 06/11/2023	349.000	0,76
653.500.000	EUR	Barclays Bank plc, FRN, 4.22%, 31/05/2024	653.500	1,42
468.000.000	EUR	Barclays Bank plc, 3.52%, 10/11/2023 ¹	466.261	1,01
32.000.000	EUR	NTT Finance Uk Ltd., 3.92%, 20/10/2023 ¹	31.938	0,07
100.000.000	EUR	NTT Finance Uk Ltd., 4.08%, 10/11/2023 ¹	99.560	0,21
185.500.000	EUR	NTT Finance Uk Ltd., 4.12%, 08/12/2023 ¹	184.090	0,40
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	1.784.349	3,87
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,32 %)				
43.498.000	EUR	Mont Blanc Capital Corp., 3.67%, 12/10/2023 ¹	43.454	0,09
		Vereinigte Staaten - Gesamt	43.454	0,09
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			17.274.580	37,43
Termineinlagen (30. September 2022: 12,25 %)				
Österreich (30. September 2022: 4,84 %)				
4.038.869.968	EUR	Erste Group Bank AG, 3.90%, 02/10/2023	4.038.870	8,75
		Österreich - Gesamt	4.038.870	8,75
Belgien (30. September 2022: 0,10 %)				
225.000.000	EUR	KBC Bank NV, 3.89%, 02/10/2023	225.000	0,49
		Belgien - Gesamt	225.000	0,49
Frankreich (30. September 2022: 1,40 %)				
153.419.876	EUR	BRED Banque Populaire, 3.86%, 02/10/2023	153.420	0,33
300.000.000	EUR	Credit Mutuel, 3.85%, 02/10/2023	300.000	0,65
		Frankreich - Gesamt	453.420	0,98

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Termineinlagen (Fortsetzung)				
1.000.427.846	EUR	Deutschland (30. September 2022: 4,50 %) DZ Bank AG, 3.85%, 02/10/2023	1.000.428	2,17
		Deutschland - Gesamt	1.000.428	2,17
51.307.078	EUR	Japan (30. September 2022: 1,41 %) Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.92%, 02/10/2023	51.307	0,11
200.000.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 3.87%, 02/10/2023	200.000	0,44
600.000.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 3.90%, 02/10/2023	600.000	1,30
		Japan - Gesamt	851.307	1,85
Anlagen in Termineinlagen - Gesamt			6.569.025	14,24
ANLEIHEN				
Staatsanleihen (30. September 2022: 0,01 %)				
90.000.000	EUR	Österreich (30. September 2022: 0,00 %) Austria Treasury Bill, 3.82%, 25/01/2024 ¹	88.914	0,19
		Österreich - Gesamt	88.914	0,19
100.000	EUR	Frankreich (30. September 2022: 0,01 %) France Treasury Bill BTF, 3.65%, 01/11/2023 ¹	100	–
100.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 3.82%, 06/12/2023 ¹	99	–
428.600.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 3.63%, 10/01/2024 ¹	424.343	0,92
1.354.185.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 3.66%, 10/01/2024 ¹	1.340.621	2,91
100.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 3.63%, 24/01/2024 ¹	99	–
100.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 3.64%, 21/02/2024 ¹	99	–
100.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 3.69%, 20/03/2024 ¹	98	–
		Frankreich - Gesamt	1.765.459	3,83
50.000	EUR	Niederlande (30. September 2022: 0,00 %) Dutch Treasury Certificate, 3.78%, 30/10/2023 ¹	50	–
50.000	EUR	Dutch Treasury Certificate, 3.73%, 29/11/2023 ¹	50	–
		Niederlande - Gesamt	100	–
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt			1.854.473	4,02
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2022: 2,90 %)				
874.000.000	EUR	Kanada (30. September 2022: 0,00 %) Bank of Nova Scotia (The), FRN, 4.21%, 14/06/2024	874.000	1,89
437.000.000	EUR	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 4.29%, 12/07/2024	437.000	0,95
765.000.000	EUR	Canadian Imperial Bank of Commerce, 4.00%, 14/06/2024	765.000	1,66
		Kanada - Gesamt	2.076.000	4,50

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen			Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)						
		Luxemburg (30. September 2022: 2,90 %)				
430.000.000	EUR	SG Issuer SA, FRN, 3.97%, 19/01/2024			430.000	0,93
		Luxemburg - Gesamt			430.000	0,93
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt					2.506.000	5,43
Supranationale Wertpapiere (30. September 2022: 2,69 %)						
111.500.000	EUR	European Stability Mechanism Treasury Bill, 3.64%, 09/11/2023 ¹			111.076	0,24
185.100.000	EUR	European Union Bill, 3.64%, 12/01/2024 ¹			183.224	0,40
524.425.000	EUR	European Union Bill, 3.66%, 09/02/2024 ¹			517.623	1,12
Anlagen in supranationalen Wertpapieren - Gesamt					811.923	1,76
Anlagen in Anleihen - Gesamt					5.172.396	11,21
Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2022: 9,96 %)						
Kanada (30. September 2022: 2,23 %)						
751.000.000	EUR	Bank of Nova Scotia plc	3,70 %	02.10.2023	751.000	1,63
Kanada - Gesamt					751.000	1,63
Frankreich (30. September 2022: 2,25 %)						
400.000.000	EUR	BNP Paribas SA	3,70 %	02.10.2023	400.000	0,87
100.000.000	EUR	BNP Paribas SA	3,70 %	02.10.2023	100.000	0,22
750.000.000	EUR	Natixis SA	3,69 %	02.10.2023	750.000	1,62
170.000.000	EUR	Societe Generale SA	3,63 %	02.10.2023	170.000	0,37
Frankreich - Gesamt					1.420.000	3,08
Japan (30. September 2022: 0,00 %)						
300.000.000	EUR	MUFG Securities EMEA plc	3,70 %	02.10.2023	300.000	0,65
Japan - Gesamt					300.000	0,65
Niederlande (30. September 2022: 2,11 %)						
900.000.000	EUR	ING Bank NV	3,70 %	02.10.2023	900.000	1,95
Niederlande - Gesamt					900.000	1,95
Spanien (30. September 2022: 0,00 %)						
100.000.000	EUR	Santander UK plc	3,70 %	02.10.2023	100.000	0,21
50.000.000	EUR	Santander UK plc	3,70 %	02.10.2023	50.000	0,11
100.000.000	EUR	Santander UK plc	3,85 %	03.10.2023	100.000	0,22
Spanien - Gesamt					250.000	0,54

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung)						
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 1,12 %)						
600.000.000	EUR	NatWest Markets plc	3,65 %	02.10.2023	600.000	1,30
Vereinigtes Königreich - Gesamt					600.000	1,30
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 2,25 %)						
900.000.000	EUR	BofA Securities Europe SA	3,60 %	02.10.2023	900.000	1,95
Vereinigte Staaten - Gesamt					900.000	1,95
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					5.121.000	11,10
					Zeitwert¹ Tsd. EUR	des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					45.812.890	99,28
Barmittel und Barsicherheiten					1.732.204	3,75
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					(1.400.073)	(3,03)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					46.145.021	100,00
Analyse des Gesamtvermögens						% des Gesamt- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind						9,94
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						11,64
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)						74,47
Sonstige Vermögenswerte						3,95
Gesamtvermögen						100,00

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

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (30. September 2022: 13,05 %)				
Belgien (30. September 2022: 0,00 %)				
200.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 3.79%, 17/11/2023 ¹	198.918	3,90
		Belgien - Gesamt	198.918	3,90
Kanada (30. September 2022: 1,92 %)				
220.000.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 4.19%, 18/09/2024 ¹	211.228	4,15
		Kanada - Gesamt	211.228	4,15
Frankreich (30. September 2022: 3,63 %)				
184.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.52%, 13/02/2024 ¹	181.197	3,56
44.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.69%, 21/02/2024 ¹	43.272	0,85
		Frankreich - Gesamt	224.469	4,41
Irland (30. September 2022: 0,19 %)				
			-	-
Japan (30. September 2022: 5,39 %)				
60.000.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 3.70%, 01/11/2023 ¹	59.781	1,17
144.000.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 3.84%, 08/12/2023 ¹	142.879	2,81
50.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 3.81%, 14/12/2023 ¹	49.579	0,97
		Japan - Gesamt	252.239	4,95
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 1,92 %)				
100.000.000	EUR	Goldman Sachs International Bank, 3.89%, 07/12/2023 ¹	99.238	1,95
135.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 3.01%, 14/12/2023 ¹	133.865	2,62
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	233.103	4,57
Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt			1.119.957	21,98
Commercial Papers (30. September 2022: 71,01 %)				
Kanada (30. September 2022: 2,27 %)				
			-	-
Frankreich (30. September 2022: 19,64 %)				
96.000.000	EUR	Antalis SA, 3.52%, 18/10/2023 ¹	95.791	1,88
26.000.000	EUR	AXA Banque SACA, 3.59%, 13/11/2023 ¹	25.872	0,51
86.000.000	EUR	AXA Banque SACA, 3.76%, 03/01/2024 ¹	85.095	1,67
100.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.62%, 06/11/2023 ¹	99.584	1,95
50.000.000	EUR	BPCE SA, 4.23%, 24/09/2024 ¹	47.916	0,94
		Frankreich - Gesamt	354.258	6,95
Deutschland (30. September 2022: 1,92 %)				
15.000.000	EUR	SAP SE, 3.75%, 10/11/2023 ¹	14.931	0,29
		Deutschland - Gesamt	14.931	0,29
Irland (30. September 2022: 0,97 %)				
76.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 3.66%, 01/11/2023 ¹	75.713	1,49
80.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 3.79%, 20/11/2023 ¹	79.521	1,56
20.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 3.86%, 01/12/2023 ¹	19.855	0,39
		Irland - Gesamt	175.089	3,44

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
		Japan (30. September 2022: 4,83 %)	-	-
		Jersey (30. September 2022: 0,00 %)		
100.000.000	EUR	Royal Bank of Scotland International Ltd. (The), 3.74%, 01/11/2023 ¹	99.640	1,96
		Jersey - Gesamt	99.640	1,96
		Luxemburg (30. September 2022: 2,12 %)		
20.000.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 3.76%, 23/10/2023 ¹	19.947	0,39
33.061.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 3.53%, 25/10/2023 ¹	32.965	0,65
18.431.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 3.77%, 21/11/2023 ¹	18.322	0,36
50.000.000	EUR	DH Europe Finance II SARL, 3.90%, 06/11/2023 ¹	49.792	0,98
50.000.000	EUR	DH Europe Finance II SARL, 3.85%, 15/11/2023 ¹	49.742	0,97
25.000.000	EUR	Sunderland Receivables SA, 3.78%, 27/10/2023 ¹	24.920	0,49
		Luxemburg - Gesamt	195.688	3,84
		Niederlande (30. September 2022: 9,27 %)		
20.000.000	EUR	Avery Dennison Corp., 3.71%, 10/10/2023 ¹	19.974	0,39
50.000.000	EUR	Enel Finance International NV, 3.79%, 31/10/2023 ¹	49.825	0,98
28.000.000	EUR	Givaudan Finance Europe BV, 3.47%, 09/10/2023 ¹	27.969	0,55
80.000.000	EUR	Heineken NV, 3.91%, 27/11/2023 ¹	79.480	1,56
		Niederlande - Gesamt	177.248	3,48
		Spanien (30. September 2022: 2,76 %)	-	-
		Schweden (30. September 2022: 1,93 %)	-	-
		Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 9,87 %)		
100.000.000	EUR	Barclays Bank plc, 3.60%, 05/02/2024 ¹	98.573	1,93
7.500.000	EUR	Sumitomo Corp. Capital Europe plc, 3.87%, 23/10/2023 ¹	7.480	0,15
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	106.053	2,08
		Vereinigte Staaten (30. September 2022: 15,43 %)		
42.000.000	EUR	Danaher Corp., 3.78%, 17/10/2023 ¹	41.918	0,82
100.000.000	EUR	Realty Income Corp., 3.64%, 18/10/2023 ¹	99.788	1,96
		Vereinigte Staaten - Gesamt	141.706	2,78
		Anlagen in Commercial Papers - Gesamt	1.264.613	24,82
		Termineinlagen (30. September 2022: 4,69 %)		
		Belgien (30. September 2022: 0,00 %)		
11.000.000	EUR	KBC Bank NV, 3.89%, 02/10/2023	11.000	0,22
		Belgien - Gesamt	11.000	0,22
		Frankreich (30. September 2022: 0,83 %)		
150.000.000	EUR	Credit Mutuel, 3.85%, 02/10/2023	150.000	2,94
		Frankreich - Gesamt	150.000	2,94
		Deutschland (30. September 2022: 3,86 %)		
251.516.597	EUR	DZ Bank AG, 3.85%, 02/10/2023	251.517	4,93
		Deutschland - Gesamt	251.517	4,93
		Anlagen in Termineinlagen - Gesamt	412.517	8,09

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2022: 20,04 %)				
Australien (30. September 2022: 4,10 %)				
211.000.000	EUR	Macquarie Bank Ltd., FRN, 4.61%, 20/10/2023	211.038	4,14
		Australien - Gesamt	211.038	4,14
Kanada (30. September 2022: 0,00 %)				
90.000.000	EUR	Canadian Imperial Bank of Commerce, 4.00%, 14/06/2024	89.794	1,76
		Kanada - Gesamt	89.794	1,76
Finnland (30. September 2022: 1,70 %)				
87.000.000	EUR	OP Corporate Bank plc, FRN, 4.79%, 17/05/2024	87.403	1,71
		Finnland - Gesamt	87.403	1,71
Frankreich (30. September 2022: 3,16 %)				
51.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 4.01%, 17/01/2025	51.073	1,00
66.300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 4.18%, 08/09/2025	66.298	1,30
200.000.000	EUR	BPCE SA, FRN, 4.06%, 18/07/2025	199.900	3,92
27.100.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 4.12%, 07/03/2025	27.123	0,53
162.000.000	EUR	HSBC Continental Europe SA, FRN, 4.97%, 28/06/2024	162.728	3,20
68.900.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 4.12%, 13/01/2025	69.015	1,36
		Frankreich - Gesamt	576.137	11,31
Deutschland (30. September 2022: 0,00 %)				
205.000.000	EUR	DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main, FRN, 4.22%, 28/02/2025	204.948	4,02
		Deutschland - Gesamt	204.948	4,02
Luxemburg (30. September 2022: 3,50 %)				
			-	-
Niederlande (30. September 2022: 3,87 %)				
101.400.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, FRN, 3.96%, 10/01/2025	101.568	1,99
212.000.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, FRN, 4.17%, 28/05/2025	212.000	4,16
		Niederlande - Gesamt	313.568	6,15
Spanien (30. September 2022: 0,00 %)				
77.700.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 4.21%, 16/01/2025	77.872	1,53
		Spanien - Gesamt	77.872	1,53
Schweiz (30. September 2022: 3,71 %)				
			-	-
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 0,00 %)				
60.000.000	EUR	HSBC Bank plc, FRN, 4.20%, 08/03/2025	60.094	1,18
163.000.000	EUR	Lloyds Bank Corporate Markets plc, FRN, 4.22%, 30/08/2025	162.563	3,19
119.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, FRN, 4.35%, 03/03/2025	119.332	2,34
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	341.989	6,71

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts	
ANLEIHEN (Fortsetzung)					
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)					
150.000.000	EUR	Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,00 %) Metropolitan Life Global Funding I, FRN, 4.32%, 18/06/2025	150.604	2,96	
		Vereinigte Staaten - Gesamt	150.604	2,96	
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt			2.053.353	40,29	
Staatsanleihen (30. September 2022: 0,01 %)					
		Frankreich (30. September 2022: 0,01 %)	-	-	
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt			-	-	
Anlagen in Anleihen - Gesamt			2.053.353	40,29	
Beschreibung		Kontrahent	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Devisenterminkontrakte					
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2022: 0,06 %)				-	-
Devisenterminkontrakte					
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2022: (0,16) %)				-	-
				Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt				4.850.440	95,18
Barmittel und Barsicherheiten				235.044	4,61
Zahlungsmitteläquivalente					
Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (30. September 2022: 0,02 %)					
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				10.513	0,21
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert				5.095.997	100,00
Analyse des Gesamtvermögens					% des Gesamt- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind					40,28
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)					54,87
Sonstige Vermögenswerte					4,85
Gesamtvermögen					100,00

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

BLACKROCK ICS STERLING GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Staatsanleihen (30. September 2022: 15,70 %)				
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 15,70 %)				
100.000.000	GBP	UK Treasury Bill, 4.42%, 02/10/2023 ¹	100.000	2,15
50.000.000	GBP	UK Treasury Bill, 4.56%, 16/10/2023 ¹	49.915	1,07
25.000.000	GBP	UK Treasury Bill, 4.74%, 23/10/2023 ¹	24.933	0,54
138.133.000	GBP	UK Treasury Bill, 0.44%, 30/10/2023 ¹	137.586	2,95
25.000.000	GBP	UK Treasury Bill, 4.81%, 20/11/2023 ¹	24.842	0,53
57.864.000	GBP	UK Treasury Bill, 5.33%, 11/12/2023 ¹	57.283	1,23
138.000.000	GBP	UK Treasury Bill, 3.50%, 02/01/2024 ¹	136.136	2,92
100.000.000	GBP	UK Treasury Bill, 5.50%, 08/01/2024 ¹	98.548	2,12
172.620.000	GBP	UK Treasury Bill, 5.49%, 15/01/2024 ¹	169.939	3,65
38.000.000	GBP	UK Treasury Bill, 5.50%, 22/01/2024 ¹	37.371	0,80
Vereinigtes Königreich - Gesamt			836.553	17,96
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt			836.553	17,96
Anlagen in Anleihen - Gesamt			836.553	17,96

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2022: 96,00 %)						
Australien (30. September 2022: 0,00 %)						
350.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd.	5,18 %	02.10.2023	350.000	7,51
Australien - Gesamt					350.000	7,51
Kanada (30. September 2022: 0,00 %)						
250.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia plc	5,17 %	02.10.2023	250.000	5,37
100.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia plc	5,17 %	02.10.2023	100.000	2,15
100.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia plc	5,17 %	03.10.2023	100.000	2,15
152.850.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	02.10.2023	152.850	3,28
93.300.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	02.10.2023	93.300	2,00
48.912.500	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	02.10.2023	48.912	1,05
35.665.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	02.10.2023	35.665	0,77
19.272.500	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	02.10.2023	19.272	0,41
152.850.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	03.10.2023	152.850	3,28
93.450.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	03.10.2023	93.450	2,01
48.956.250	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	03.10.2023	48.956	1,05
35.665.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	03.10.2023	35.665	0,77
19.078.750	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	03.10.2023	19.079	0,41
100.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	100.000	2,15
100.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	100.000	2,15
57.292.200	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	57.292	1,23
45.351.800	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	45.352	0,97
42.316.720	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	42.317	0,91
5.039.280	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	5.039	0,11
Kanada - Gesamt					1.499.999	32,22
Frankreich (30. September 2022: 0,00 %)						
355.000.000	GBP	BNP Paribas SA	5,20 %	02.10.2023	355.000	7,62
55.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	5,21 %	02.10.2023	55.000	1,18

BLACKROCK ICS STERLING GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung)						
Frankreich (Fortsetzung)						
55.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	5,21 %	02.10.2023	55.000	1,18
55.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	5,21 %	02.10.2023	55.000	1,18
55.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	5,21 %	02.10.2023	55.000	1,18
40.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	5,21 %	02.10.2023	40.000	0,86
30.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	5,21 %	02.10.2023	30.000	0,64
10.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	5,21 %	02.10.2023	10.000	0,21
55.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	5,21 %	03.10.2023	55.000	1,18
55.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	5,21 %	03.10.2023	55.000	1,18
55.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	5,21 %	03.10.2023	55.000	1,18
55.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	5,21 %	03.10.2023	55.000	1,18
40.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	5,21 %	03.10.2023	40.000	0,86
40.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	5,21 %	03.10.2023	40.000	0,86
350.000.000	GBP	Societe Generale SA	5,17 %	02.10.2023	350.000	7,51
Frankreich - Gesamt					1.305.000	28,00
Japan (30. September 2022: 0,00 %)						
107.024.412	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	02.10.2023	107.024	2,30
97.294.920	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	02.10.2023	97.295	2,09
97.294.920	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	02.10.2023	97.295	2,09
122.431.206	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	03.10.2023	122.431	2,63
97.035.163	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	03.10.2023	97.035	2,08
76.657.779	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	03.10.2023	76.658	1,65
5.325.970	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	03.10.2023	5.326	0,11
Japan - Gesamt					603.064	12,95
Spanien (30. September 2022: 0,00 %)						
350.533.214	GBP	Santander UK plc	5,19 %	02.10.2023	350.533	7,53
Spanien - Gesamt					350.533	7,53
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 96,00 %)						
350.000.000	GBP	Barclays Bank plc	5,19 %	02.10.2023	350.000	7,51
143.397.000	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	143.397	3,08
143.250.000	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	143.250	3,08
63.353.000	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	63.353	1,36
Vereinigtes Königreich - Gesamt					700.000	15,03
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,00 %)						
54.353.750	GBP	Merrill Lynch International	5,15 %	02.10.2023	54.354	1,17
27.667.500	GBP	Merrill Lynch International	5,15 %	02.10.2023	27.668	0,59
8.392.500	GBP	Merrill Lynch International	5,15 %	02.10.2023	8.392	0,18

BLACKROCK ICS STERLING GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung)						
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)						
6.212.500	GBP	Merrill Lynch International	5,15 %	02.10.2023	6.213	0,13
3.373.750	GBP	Merrill Lynch International	5,15 %	02.10.2023	3.374	0,07
Vereinigte Staaten - Gesamt					100.001	2,14
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					4.908.597	105,38
					Zeitwert	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					5.745.150	123,34
Zahlungsmittel					135.549	2,91
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					(1.222.715)	(26,25)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					4.657.984	100,00
						% des Gesamt- vermögens
Analyse des Gesamtvermögens						
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						97,59
Sonstige Vermögenswerte						2,41
Gesamtvermögen						100,00

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

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (30. September 2022: 29,30 %)				
Australien (30. September 2022: 1,73 %)				
24.000.000	GBP	Commonwealth Bank of Australia, 4.85%, 20/10/2023 ¹	23.930	0,25
10.000.000	GBP	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.58%, 06/11/2023 ¹	9.943	0,11
54.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd., 5.04%, 04/01/2024	53.936	0,57
83.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd., 5.05%, 05/01/2024	82.903	0,87
90.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd., 5.05%, 08/01/2024	89.890	0,95
Australien - Gesamt			260.602	2,75
Belgien (30. September 2022: 0,80 %)				
			-	-
Kanada (30. September 2022: 3,01 %)				
67.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 4.99%, 23/10/2023	66.982	0,70
114.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 4.59%, 31/10/2023	113.916	1,20
90.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 5.08%, 09/01/2024	89.904	0,95
Kanada - Gesamt			270.802	2,85
Finnland (30. September 2022: 2,07 %)				
16.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 6.00%, 05/01/2024	16.021	0,17
16.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 6.00%, 18/01/2024 ¹	15.738	0,17
39.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 4.83%, 22/01/2024	38.899	0,41
75.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 6.00%, 04/03/2024 ¹	73.236	0,77
51.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 6.11%, 29/05/2024 ¹	49.119	0,52
33.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 6.10%, 05/06/2024 ¹	31.747	0,33
Finnland - Gesamt			224.760	2,37
Frankreich (30. September 2022: 1,36 %)				
30.000.000	GBP	BNP Paribas SA, 4.48%, 03/10/2023	29.997	0,31
20.000.000	GBP	BNP Paribas SA, 4.66%, 10/10/2023	19.995	0,21
109.000.000	GBP	Credit Agricole SA, 4.70%, 03/10/2023 ¹	108.937	1,15
Frankreich - Gesamt			158.929	1,67
Japan (30. September 2022: 6,98 %)				
50.000.000	GBP	Mitsubishi Trust Asset Management Co. Ltd., 5.59%, 10/11/2023	50.002	0,53
40.000.000	GBP	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.65%, 20/10/2023	40.003	0,42
50.000.000	GBP	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.65%, 02/11/2023 ¹	49.747	0,52
10.000.000	GBP	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.57%, 06/11/2023	10.000	0,11
10.000.000	GBP	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.60%, 15/11/2023	10.000	0,11
35.000.000	GBP	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.45%, 19/10/2023	35.002	0,37
100.000.000	GBP	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.54%, 06/11/2023	100.013	1,05
10.000.000	GBP	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.72%, 05/12/2023	10.005	0,11
50.000.000	GBP	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.70%, 05/01/2024 ¹	49.266	0,52
35.000.000	GBP	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.78%, 05/01/2024 ¹	34.486	0,36
100.000.000	GBP	MUFG Bank Ltd., 5.58%, 29/01/2024 ¹	98.091	1,03
Japan - Gesamt			486.615	5,13
Luxemburg (30. September 2022: 0,54 %)				
			-	-
Niederlande (30. September 2022: 1,28 %)				
101.000.000	GBP	ABN AMRO Bank NV, 5.87%, 01/02/2024 ¹	99.090	1,04
58.000.000	GBP	ABN AMRO Bank NV, 6.00%, 02/02/2024 ¹	56.894	0,60
105.000.000	GBP	ING Bank NV, 4.46%, 06/11/2023 ¹	104.420	1,10
100.000.000	GBP	ING Bank NV, 6.12%, 29/05/2024 ¹	96.283	1,02
Niederlande - Gesamt			356.687	3,76

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (Fortsetzung)				
Norwegen (30. September 2022: 0,54 %)				
34.000.000	GBP	DNB Bank ASA, 4.90%, 23/10/2023	33.992	0,36
		Norwegen - Gesamt	33.992	0,36
Singapur (30. September 2022: 5,91 %)				
10.000.000	GBP	DBS Bank Ltd., 5.79%, 30/01/2024 ¹	9.815	0,10
100.000.000	GBP	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 5.76%, 16/01/2024 ¹	98.337	1,04
10.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 5.05%, 15/11/2023	9.995	0,10
10.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 5.75%, 11/01/2024	10.005	0,10
20.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 5.95%, 05/03/2024	20.019	0,21
10.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 5.89%, 15/03/2024	10.006	0,11
10.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 5.90%, 26/03/2024	10.006	0,11
		Singapur - Gesamt	168.183	1,77
		Schweden (30. September 2022: 1,42 %)	-	-
		Schweiz (30. September 2022: 1,87 %)	-	-
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 1,54 %)				
39.000.000	GBP	Goldman Sachs International Bank, 5.61%, 02/01/2024 ¹	38.456	0,41
78.000.000	GBP	Goldman Sachs International Bank, 5.62%, 05/01/2024 ¹	76.877	0,81
54.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 4.95%, 02/10/2023 ¹	53.977	0,57
27.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 5.18%, 10/10/2023 ¹	26.957	0,28
15.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 6.00%, 02/02/2024 ¹	14.715	0,16
21.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 6.00%, 05/02/2024 ¹	20.592	0,22
25.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 6.00%, 05/03/2024 ¹	24.398	0,26
47.000.000	GBP	NatWest Group plc, 5.45%, 07/11/2023 ¹	46.734	0,49
17.000.000	GBP	NatWest Group plc, 5.77%, 25/03/2024 ¹	16.535	0,17
100.000.000	GBP	Standard Chartered Bank, 5.50%, 19/10/2023 ¹	99.703	1,05
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	418.944	4,42
		Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,25 %)	-	-
Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt			2.379.514	25,08
Commercial Papers (30. September 2022: 17,13 %)				
Australien (30. September 2022: 0,00 %)				
33.000.000	GBP	Toyota Finance Australia Ltd., 5.29%, 07/12/2023 ¹	32.663	0,34
115.000.000	GBP	Toyota Finance Australia Ltd., 5.67%, 22/03/2024 ¹	111.960	1,18
		Australien - Gesamt	144.623	1,52
Finnland (30. September 2022: 1,80 %)				
68.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 4.85%, 23/10/2023 ¹	67.770	0,71
		Finnland - Gesamt	67.770	0,71
Frankreich (30. September 2022: 2,72 %)				
98.000.000	GBP	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 5.21%, 03/10/2023 ¹	97.944	1,03
185.000.000	GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.95%, 02/04/2024 ¹	179.726	1,89
75.000.000	GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.92%, 11/04/2024 ¹	72.757	0,77
77.000.000	GBP	BPCE SA, 5.70%, 02/01/2024 ¹	75.912	0,80
75.000.000	GBP	BPCE SA, 5.99%, 19/02/2024 ¹	73.374	0,77
90.000.000	GBP	BPCE SA, 5.92%, 04/03/2024 ¹	87.847	0,93
85.000.000	GBP	BRED Banque Populaire, 6.00%, 26/02/2024 ¹	83.054	0,88
6.000.000	GBP	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 5.52%, 24/10/2023 ¹	5.978	0,06
23.000.000	GBP	Satellite, 5.36%, 09/10/2023 ¹	22.980	0,24

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
10.000.000	GBP	Frankreich (Fortsetzung) Satellite, 5.48%, 24/10/2023 ¹	9.963	0,11
		Frankreich - Gesamt	709.535	7,48
Deutschland (30. September 2022: 4,59 %)				
44.000.000	GBP	Allianz SE, 5.42%, 26/10/2023 ¹	43.828	0,46
50.000.000	GBP	Allianz SE, 5.42%, 27/10/2023 ¹	49.798	0,53
77.000.000	GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 5.18%, 02/10/2023 ¹	76.968	0,81
59.000.000	GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 5.18%, 03/10/2023 ¹	58.967	0,62
29.000.000	GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 5.18%, 04/10/2023 ¹	28.980	0,31
		Deutschland - Gesamt	258.541	2,73
Irland (30. September 2022: 2,43 %)				
88.000.000	GBP	Matchpoint Finance plc, 5.30%, 22/11/2023 ¹	87.309	0,92
146.000.000	GBP	Matchpoint Finance plc, 5.30%, 27/11/2023 ¹	144.744	1,53
		Irland - Gesamt	232.053	2,45
Luxemburg (30. September 2022: 0,47 %)				
16.000.000	GBP	Albion Capital Corp. SA, 5.55%, 20/11/2023 ¹	15.879	0,17
38.000.000	GBP	Sunderland Receivables SA, 5.52%, 06/11/2023 ¹	37.791	0,40
		Luxemburg - Gesamt	53.670	0,57
Niederlande (30. September 2022: 2,22 %)				
120.000.000	GBP	ING Bank NV, 5.68%, 28/06/2024 ¹	114.990	1,21
33.000.000	GBP	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 5.50%, 23/10/2023 ¹	32.884	0,35
10.000.000	GBP	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 5.65%, 11/01/2024 ¹	9.844	0,10
20.000.000	GBP	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 5.65%, 12/01/2024 ¹	19.685	0,21
		Niederlande - Gesamt	177.403	1,87
Norwegen (30. September 2022: 0,00 %)				
50.000.000	GBP	DNB Bank ASA, 4.76%, 20/10/2023 ¹		0,53
		Norwegen - Gesamt	49.853	0,53
Schweiz (30. September 2022: 0,29 %)				
			-	-
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 2,47 %)				
125.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 5.11%, 02/10/2023 ¹	124.946	1,32
68.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 5.11%, 06/10/2023 ¹	67.931	0,71
125.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 0.00%, 09/10/2023 ¹	124.876	1,32
19.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 5.90%, 07/03/2024 ¹	18.536	0,19
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	336.289	3,54
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,14 %)				
			-	-
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			2.029.737	21,40
Termineinlagen (30. September 2022: 30,90 %)				
Österreich (30. September 2022: 2,48 %)				
			-	-
Belgien (30. September 2022: 0,61 %)				
89.000.000	GBP	KBC Bank NV, 5.17%, 02/10/2023	89.000	0,94
		Belgien - Gesamt	89.000	0,94

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Termineinlagen (Fortsetzung)				
250.000.000	GBP	Kanada (30. September 2022: 3,71 %) Bank of Nova Scotia (The), 5.20%, 02/10/2023	250.000	2,63
		Kanada - Gesamt	250.000	2,63
167.159.301	GBP	Frankreich (30. September 2022: 7,43 %) BRED Banque Populaire, 5.19%, 02/10/2023	167.159	1,76
100.000.000	GBP	Societe Generale SA, 5.18%, 02/10/2023	100.000	1,07
		Frankreich - Gesamt	267.159	2,83
262.042.633	GBP	Deutschland (30. September 2022: 5,56 %) DZ Bank AG, 5.14%, 02/10/2023	262.043	2,76
		Deutschland - Gesamt	262.043	2,76
360.321.966	GBP	Japan (30. September 2022: 8,03 %) Mizuho Bank Ltd., 5.19%, 02/10/2023	360.322	3,80
412.114.777	GBP	MUFG Bank Ltd., 5.18%, 02/10/2023	412.115	4,34
		Japan - Gesamt	772.437	8,14
		Spanien (30. September 2022: 1,23 %)	-	-
500.000.000	GBP	Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 1,85 %) UK Debt Management Office, 5.20%, 02/10/2023	500.000	5,27
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	500.000	5,27
Anlagen in Termineinlagen - Gesamt			2.140.639	22,57

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2022: 10,55 %)				
64.000.000	GBP	Australien (30. September 2022: 1,83 %) Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 5.68%, 18/07/2024	64.010	0,67
56.000.000	GBP	Westpac Banking Corp., FRN, 5.64%, 14/06/2024	56.023	0,59
		Australien - Gesamt	120.033	1,26
88.000.000	GBP	Kanada (30. September 2022: 8,72 %) Bank of Montreal, FRN, 5.71%, 03/06/2024	88.072	0,93
80.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 5.70%, 13/06/2024	79.998	0,84
82.000.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.69%, 20/06/2024	82.056	0,86
29.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 6.24%, 25/01/2024	29.063	0,31
57.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 5.70%, 17/05/2024	56.974	0,60
128.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 5.73%, 08/07/2024	128.084	1,35
49.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 5.61%, 23/09/2024	48.995	0,52
20.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 5.70%, 17/06/2024	20.017	0,21
		Kanada - Gesamt	533.259	5,62

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
		Niederlande (30. September 2022: 0,00 %)		
29.000.000	GBP	Toyota Motor Finance Netherlands BV, FRN, 5.72%, 29/07/2024	29.002	0,31
		Niederlande - Gesamt	29.002	0,31
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt			682.294	7,19
Anlagen in Anleihen - Gesamt			682.294	7,19

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2022: 13,08 %)						
Australien (30. September 2022: 0,00 %)						
50.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd.	5,18 %	02.10.2023	50.000	0,53
		Australien - Gesamt			50.000	0,53

Kanada (30. September 2022: 0,00 %)

150.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia plc	5,17 %	02.10.2023	150.000	1,58
100.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia plc	5,17 %	02.10.2023	100.000	1,05
100.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia plc	5,17 %	03.10.2023	100.000	1,05
83.187.500	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	02.10.2023	83.188	0,88
80.162.500	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	02.10.2023	80.162	0,85
51.700.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	02.10.2023	51.700	0,55
46.117.500	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	02.10.2023	46.118	0,49
28.737.500	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	02.10.2023	28.738	0,30
23.265.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	02.10.2023	23.265	0,25
17.105.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	02.10.2023	17.105	0,18
10.887.125	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	02.10.2023	10.887	0,11
8.837.875	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	02.10.2023	8.838	0,09
83.118.750	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	03.10.2023	83.119	0,88
80.096.250	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	03.10.2023	80.096	0,84
51.700.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	03.10.2023	51.700	0,54
46.158.750	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	03.10.2023	46.159	0,49
28.713.750	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	03.10.2023	28.714	0,30
23.265.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	03.10.2023	23.265	0,25
17.132.500	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	03.10.2023	17.133	0,18
10.855.750	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	03.10.2023	10.856	0,11
8.959.250	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	5,19 %	03.10.2023	8.959	0,09
100.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	100.000	1,05
100.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	100.000	1,05
100.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	100.000	1,05
39.557.380	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	39.557	0,42
10.442.620	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	10.443	0,11
		Kanada - Gesamt			1.400.002	14,74

Frankreich (30. September 2022: 0,00 %)

200.000.000	GBP	BNP Paribas SA	5,20 %	02.10.2023	200.000	2,11
		Frankreich - Gesamt			200.000	2,11

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung)						
Spanien (30. September 2022: 0,00 %)						
300.457.040	GBP	Santander UK plc	5,19 %	02.10.2023	300.457	3,17
Spanien - Gesamt					300.457	3,17
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 13,08 %)						
300.000.000	GBP	Barclays Bank plc	5,19 %	02.10.2023	300.000	3,16
49.937.110	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	49.937	0,53
44.268.500	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	44.269	0,47
39.557.810	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	39.558	0,42
38.575.740	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	38.576	0,41
38.565.000	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	38.565	0,41
25.145.100	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	25.145	0,27
8.115.840	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	8.116	0,09
5.834.900	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	5.835	0,05
Vereinigtes Königreich - Gesamt					550.001	5,81
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					2.500.460	26,36
					Zeitwert	% des Netto-
					Tsd. GBP	inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					9.732.644	102,60
Zahlungsmittel					325.617	3,43
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					(571.845)	(6,03)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					9.486.416	100,00
Analyse des Gesamtvermögens						% des Gesamt-
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind						6,76
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						24,79
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)						64,92
Sonstige Vermögenswerte						3,53
Gesamtvermögen						100,00

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

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2023

h

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (30. September 2022: 36,99 %)				
Australien (30. September 2022: 2,14 %)				
120.000.000	GBP	Commonwealth Bank of Australia, 4.85%, 20/10/2023 ¹	119.720	0,34
40.000.000	GBP	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.58%, 06/11/2023 ¹	39.788	0,11
234.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd., 5.04%, 04/01/2024	234.000	0,66
383.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd., 5.05%, 05/01/2024	383.000	1,09
460.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd., 5.05%, 08/01/2024	460.000	1,30
Australien - Gesamt			1.236.508	3,50
Belgien (30. September 2022: 0,94 %)				
			-	-
Kanada (30. September 2022: 4,51 %)				
279.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 4.99%, 23/10/2023	279.000	0,79
557.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 4.59%, 31/10/2023	557.000	1,58
390.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 5.08%, 09/01/2024	390.000	1,10
Kanada - Gesamt			1.226.000	3,47
Finnland (30. September 2022: 3,10 %)				
82.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 6.00%, 05/01/2024	82.000	0,23
79.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 6.00%, 18/01/2024 ¹	77.638	0,22
202.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 4.83%, 22/01/2024	202.000	0,57
305.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 6.00%, 04/03/2024 ¹	297.525	0,84
237.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 6.11%, 29/05/2024 ¹	227.896	0,65
300.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 6.10%, 05/06/2024 ¹	288.154	0,82
Finnland - Gesamt			1.175.213	3,33
Frankreich (30. September 2022: 2,31 %)				
570.000.000	GBP	BNP Paribas SA, 4.48%, 03/10/2023	570.000	1,61
350.000.000	GBP	BNP Paribas SA, 4.66%, 10/10/2023	350.000	0,99
509.000.000	GBP	Credit Agricole SA, 4.70%, 03/10/2023 ¹	508.936	1,44
Frankreich - Gesamt			1.428.936	4,04
Japan (30. September 2022: 9,74 %)				
100.000.000	GBP	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.65%, 20/10/2023	100.000	0,28
100.000.000	GBP	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.65%, 20/10/2023 ¹	99.725	0,28
40.000.000	GBP	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.57%, 06/11/2023	40.000	0,11
40.000.000	GBP	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.60%, 15/11/2023	40.000	0,11
80.000.000	GBP	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.45%, 19/10/2023	80.000	0,23
150.000.000	GBP	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.60%, 02/11/2023 ¹	149.297	0,42
80.000.000	GBP	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.60%, 02/11/2023	80.000	0,23
89.000.000	GBP	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.72%, 05/12/2023	89.000	0,25
100.000.000	GBP	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.70%, 05/01/2024	100.000	0,28
100.000.000	GBP	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.70%, 05/01/2024 ¹	98.541	0,28
165.000.000	GBP	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.78%, 05/01/2024 ¹	162.566	0,46
400.000.000	GBP	MUFG Bank Ltd., 5.58%, 29/01/2024 ¹	392.860	1,11
150.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 5.70%, 13/12/2023	150.000	0,43
60.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.60%, 16/10/2023	60.000	0,17
236.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.69%, 30/11/2023	236.000	0,67
180.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.70%, 06/12/2023	180.000	0,51
150.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.70%, 07/12/2023	150.000	0,43
150.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.70%, 14/12/2023	150.000	0,43
50.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.68%, 22/01/2024 ¹	49.145	0,14
170.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.65%, 25/01/2024	170.000	0,48
50.000.000	GBP	Sumitomo Trust & Banking Co. Ltd., 5.68%, 22/01/2024	50.000	0,14
Japan - Gesamt			2.627.134	7,44

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (Fortsetzung)				
Luxemburg (30. September 2022: 0,59 %)			-	-
Niederlande (30. September 2022: 1,36 %)				
520.000.000	GBP	ABN AMRO Bank NV, 5.87%, 01/02/2024 ¹	510.042	1,44
226.000.000	GBP	ABN AMRO Bank NV, 6.00%, 02/02/2024 ¹	221.551	0,63
457.000.000	GBP	ING Bank NV, 4.46%, 06/11/2023 ¹	455.109	1,29
480.000.000	GBP	ING Bank NV, 6.12%, 29/05/2024 ¹	461.533	1,30
Niederlande - Gesamt			1.648.235	4,66
Norwegen (30. September 2022: 0,59 %)				
158.000.000	GBP	DNB Bank ASA, 4.90%, 23/10/2023	158.000	0,45
Norwegen - Gesamt			158.000	0,45
Singapur (30. September 2022: 4,44 %)				
51.000.000	GBP	DBS Bank Ltd., 5.79%, 30/01/2024 ¹	50.052	0,14
350.000.000	GBP	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 5.76%, 16/01/2024 ¹	344.264	0,97
90.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 5.05%, 15/11/2023	90.000	0,26
40.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 5.75%, 11/01/2024	40.000	0,11
50.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 5.95%, 26/02/2024	50.000	0,14
35.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 5.95%, 29/02/2024	35.000	0,10
30.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 5.95%, 04/03/2024	30.000	0,09
70.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 5.95%, 05/03/2024	70.000	0,20
90.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 5.89%, 15/03/2024	90.000	0,26
40.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 5.90%, 26/03/2024	40.000	0,11
Singapur - Gesamt			839.316	2,38
Schweden (30. September 2022: 1,27 %)			-	-
Schweiz (30. September 2022: 1,61 %)			-	-
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 4,16 %)				
149.000.000	GBP	Goldman Sachs International Bank, 5.61%, 02/01/2024 ¹	146.927	0,42
300.000.000	GBP	Goldman Sachs International Bank, 5.62%, 05/01/2024 ¹	295.685	0,84
259.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 4.95%, 02/10/2023 ¹	259.000	0,73
123.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 5.18%, 10/10/2023 ¹	122.863	0,35
55.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 6.00%, 02/02/2024 ¹	53.917	0,15
84.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 6.00%, 05/02/2024 ¹	82.307	0,23
102.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 6.00%, 05/03/2024 ¹	99.478	0,28
1.317.000.000	GBP	Nationwide Building Cosmetics UK Ltd., 5.18%, 04/10/2023	1.317.000	3,73
226.500.000	GBP	NatWest Group plc, 5.45%, 07/11/2023 ¹	225.308	0,64
70.000.000	GBP	NatWest Group plc, 5.77%, 25/03/2024 ¹	68.118	0,19
373.000.000	GBP	Standard Chartered Bank, 5.50%, 19/10/2023 ¹	372.049	1,05
Vereinigtes Königreich - Gesamt			3.042.652	8,61
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,23 %)			-	-
Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt			13.381.994	37,88
Commercial Papers (30. September 2022: 15,36 %)				
Australien (30. September 2022: 0,00 %)				
149.000.000	GBP	Toyota Finance Australia Ltd., 5.29%, 07/12/2023 ¹	147.594	0,42
52.000.000	GBP	Toyota Finance Australia Ltd., 5.82%, 05/01/2024 ¹	51.222	0,14
Australien - Gesamt			198.816	0,56

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Finnland (30. September 2022: 2,22 %)				
318.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 4.85%, 23/10/2023 ¹	317.122	0,90
		Finnland - Gesamt	317.122	0,90
Frankreich (30. September 2022: 3,49 %)				
374.000.000	GBP	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 5.21%, 03/10/2023 ¹	373.946	1,06
795.000.000	GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.95%, 02/04/2024 ¹	771.771	2,18
415.000.000	GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.92%, 11/04/2024 ¹	402.345	1,14
300.000.000	GBP	BPCE SA, 5.70%, 02/01/2024 ¹	295.727	0,84
305.000.000	GBP	BPCE SA, 5.99%, 19/02/2024 ¹	298.112	0,84
500.000.000	GBP	BPCE SA, 5.92%, 04/03/2024 ¹	487.710	1,38
387.000.000	GBP	BRED Banque Populaire, 6.00%, 26/02/2024 ¹	377.808	1,07
24.000.000	GBP	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 5.52%, 24/10/2023 ¹	23.920	0,07
95.000.000	GBP	Satellite, 5.36%, 09/10/2023 ¹	94.902	0,27
29.000.000	GBP	Satellite, 5.48%, 24/10/2023 ¹	28.904	0,08
80.000.000	GBP	Satellite, 5.50%, 25/10/2023 ¹	79.723	0,23
		Frankreich - Gesamt	3.234.868	9,16
Deutschland (30. September 2022: 2,31 %)				
30.000.000	GBP	Allianz SE, 5.42%, 26/10/2023 ¹	29.893	0,08
100.000.000	GBP	Allianz SE, 5.42%, 27/10/2023 ¹	99.629	0,28
295.000.000	GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 5.18%, 02/10/2023 ¹	295.000	0,84
224.000.000	GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 5.18%, 03/10/2023 ¹	223.968	0,63
113.000.000	GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 5.18%, 04/10/2023 ¹	112.968	0,32
		Deutschland - Gesamt	761.458	2,15
Irland (30. September 2022: 1,06 %)				
319.000.000	GBP	Matchpoint Finance plc, 5.30%, 22/11/2023 ¹	316.628	0,90
100.000.000	GBP	Matchpoint Finance plc, 5.30%, 27/11/2023 ¹	99.183	0,28
		Irland - Gesamt	415.811	1,18
Japan (30. September 2022: 1,89 %)				
228.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 5.51%, 15/11/2023 ¹	226.480	0,64
		Japan - Gesamt	226.480	0,64
Luxemburg (30. September 2022: 0,85 %)				
55.512.000	GBP	Albion Capital Corp. SA, 5.55%, 20/11/2023 ¹	55.096	0,16
24.374.000	GBP	Albion Capital Corp. SA, 5.55%, 20/11/2023 ¹	24.192	0,07
50.000.000	GBP	Sunderland Receivables SA, 5.52%, 06/11/2023 ¹	49.735	0,14
		Luxemburg - Gesamt	129.023	0,37
Niederlande (30. September 2022: 2,32 %)				
445.000.000	GBP	ING Bank NV, 5.68%, 28/06/2024 ¹	426.825	1,21
28.000.000	GBP	Nieuw Amsterdam Receivables Corp., 5.23%, 31/10/2023 ¹	27.883	0,08
56.000.000	GBP	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 5.50%, 20/10/2023 ¹	55.848	0,16
161.000.000	GBP	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 5.50%, 23/10/2023 ¹	160.490	0,45
38.500.000	GBP	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 5.65%, 11/01/2024 ¹	37.904	0,11
77.500.000	GBP	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 5.65%, 12/01/2024 ¹	76.288	0,21
		Niederlande - Gesamt	785.238	2,22
Norwegen (30. September 2022: 0,00 %)				
240.000.000	GBP	DNB Bank ASA, 4.76%, 20/10/2023 ¹	239.442	0,68
		Norwegen - Gesamt	239.442	0,68

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
		Schweiz (30. September 2022: 0,36 %)	-	-
		Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 0,22 %)		
205.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 5.11%, 02/10/2023 ¹	205.000	0,58
286.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 5.11%, 06/10/2023 ¹	285.838	0,81
194.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 0.00%, 09/10/2023 ¹	193.807	0,55
77.000.000	GBP	National Westminster Bank plc, 5.90%, 07/03/2024 ¹	75.077	0,21
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	759.722	2,15
		Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,64 %)		
60.000.000	GBP	Manhattan Asset Funding Co. LLC, 5.44%, 20/10/2023 ¹	59.837	0,17
12.000.000	GBP	Mont Blanc Capital Corp., 5.33%, 17/10/2023 ¹	11.974	0,03
21.814.000	GBP	Mont Blanc Capital Corp., 5.52%, 07/11/2023 ¹	21.695	0,06
		Vereinigte Staaten - Gesamt	93.506	0,26
		Anlagen in Commercial Papers - Gesamt	7.161.486	20,27
Termineinlagen (30. September 2022: 14,23 %)				
		Österreich (30. September 2022: 0,75 %)	-	-
		Belgien (30. September 2022: 0,06 %)		
89.000.000	GBP	KBC Bank NV, 5.17%, 02/10/2023	89.000	0,25
		Belgien - Gesamt	89.000	0,25
		Kanada (30. September 2022: 0,90 %)		
100.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia (The), 5.20%, 02/10/2023	100.000	0,28
		Kanada - Gesamt	100.000	0,28
		Frankreich (30. September 2022: 1,64 %)		
202.205.473	GBP	BNP Paribas SA, 5.20%, 02/10/2023	202.206	0,57
157.177.404	GBP	BRED Banque Populaire, 5.19%, 02/10/2023	157.177	0,45
		Frankreich - Gesamt	359.383	1,02
		Deutschland (30. September 2022: 1,94 %)	-	-
		Japan (30. September 2022: 5,24 %)		
103.028.694	GBP	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.18%, 02/10/2023	103.029	0,29
554.159.982	GBP	Mizuho Bank Ltd., 5.19%, 02/10/2023	554.160	1,57
100.014.192	GBP	MUFG Bank Ltd., 5.18%, 02/10/2023	100.014	0,29
1.520.041.032	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.20%, 02/10/2023	1.520.041	4,30
		Japan - Gesamt	2.277.244	6,45
		Niederlande (30. September 2022: 0,00 %)		
800.000.000	GBP	Rabobank International, 5.18%, 02/10/2023	800.000	2,26
		Niederlande - Gesamt	800.000	2,26
		Spanien (30. September 2022: 2,06 %)		
400.000.000	GBP	Banco Santander SA, 5.15%, 02/10/2023	400.000	1,13
		Spanien - Gesamt	400.000	1,13

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Termineinlagen (Fortsetzung)				
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 1,64 %)			-	-
Anlagen in Termineinlagen - Gesamt			4.025.627	11,39
Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Staatsanleihen (30. September 2022: 0,45 %)				
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 0,45 %)				
175.000.000	GBP	UK Treasury Bill, 4.75%, 23/10/2023 ¹	174.533	0,49
Vereinigtes Königreich - Gesamt			174.533	0,49
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt			174.533	0,49
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2022: 14,71 %)				
Australien (30. September 2022: 2,16 %)				
316.000.000	GBP	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 5.68%, 18/07/2024	316.000	0,89
265.000.000	GBP	Westpac Banking Corp., FRN, 5.64%, 14/06/2024	265.000	0,75
Australien - Gesamt			581.000	1,64
Kanada (30. September 2022: 11,06 %)				
392.000.000	GBP	Bank of Montreal, FRN, 5.71%, 03/06/2024	392.000	1,11
400.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 5.70%, 13/06/2024	400.000	1,13
398.000.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.69%, 20/06/2024	398.000	1,13
145.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 6.24%, 25/01/2024	145.276	0,41
250.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 5.70%, 17/05/2024	250.000	0,71
602.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 5.73%, 08/07/2024	602.000	1,70
188.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 5.61%, 23/09/2024	188.000	0,53
410.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 5.70%, 17/06/2024	410.000	1,16
Kanada - Gesamt			2.785.276	7,88
Niederlande (30. September 2022: 0,00 %)				
143.000.000	GBP	Toyota Motor Finance Netherlands BV, FRN, 5.72%, 29/07/2024	143.000	0,41
Niederlande - Gesamt			143.000	0,41
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 1,49 %)				
500.000.000	GBP	New York Life Global Funding, FRN, 5.61%, 30/08/2024	500.000	1,42
Vereinigte Staaten - Gesamt			500.000	1,42
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt			4.009.276	11,35
Anlagen in Anleihen - Gesamt			4.183.809	11,84

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2022: 18,15 %)						
Kanada (30. September 2022: 0,00 %)						
89.147.561	GBP	Bank of Montreal	5,17 %	02.10.2023	89.148	0,25
89.044.390	GBP	Bank of Montreal	5,17 %	03.10.2023	89.044	0,25
400.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia plc	5,17 %	02.10.2023	400.000	1,13
110.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	110.000	0,31
110.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	110.000	0,31
110.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	110.000	0,31
102.904.950	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	102.905	0,29
100.319.600	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	100.320	0,28
87.588.700	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	87.589	0,25
87.160.080	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	87.160	0,25
79.145.060	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	79.145	0,22
72.199.200	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	72.199	0,20
68.096.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	68.096	0,19
47.233.200	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	47.233	0,13
45.907.500	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	45.907	0,13
44.485.200	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	44.485	0,13
44.475.600	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	44.476	0,13
39.502.540	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	39.503	0,11
37.376.010	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	37.376	0,11
34.986.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	34.986	0,10
32.581.500	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	32.581	0,09
23.515.360	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	23.515	0,07
22.523.500	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	5,20 %	02.10.2023	22.523	0,06
Kanada - Gesamt					1.878.191	5,30
Frankreich (30. September 2022: 0,00 %)						
45.000.000	GBP	BNP Paribas SA	5,20 %	02.10.2023	45.000	0,13
Frankreich - Gesamt					45.000	0,13
Japan (30. September 2022: 0,00 %)						
97.747.515	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	02.10.2023	97.748	0,28
94.882.160	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	02.10.2023	94.882	0,27
78.828.641	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	02.10.2023	78.829	0,22
73.595.671	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	02.10.2023	73.596	0,21
72.128.943	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	02.10.2023	72.129	0,20
72.128.943	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	02.10.2023	72.129	0,20
66.113.035	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	02.10.2023	66.113	0,19
65.605.284	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	02.10.2023	65.605	0,19
57.187.775	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	02.10.2023	57.188	0,16
15.734.535	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	02.10.2023	15.735	0,04
9.561.168	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	02.10.2023	9.561	0,03
91.794.665	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	03.10.2023	91.795	0,26
78.323.093	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	03.10.2023	78.323	0,22
20.377.384	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	03.10.2023	20.377	0,06
12.194.552	GBP	MUFG Securities EMEA plc	5,17 %	03.10.2023	12.195	0,03
Japan - Gesamt					906.205	2,56
Spanien (30. September 2022: 0,00 %)						
1.051.166.703	GBP	Santander UK plc	5,19 %	02.10.2023	1.051.167	2,98
Spanien - Gesamt					1.051.167	2,98

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung)						
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 18,15 %)						
250.000.000	GBP	Barclays Bank plc	5,19 %	02.10.2023	250.000	0,71
133.387.920	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	133.388	0,38
92.996.970	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	92.997	0,26
74.190.120	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	74.190	0,21
73.132.386	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	73.132	0,21
67.635.060	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	67.635	0,19
35.168.640	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	35.169	0,10
23.488.904	GBP	Standard Chartered Bank	5,18 %	02.10.2023	23.489	0,07
Vereinigtes Königreich - Gesamt					750.000	2,13
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,00 %)						
400.000.000	GBP	Citigroup Global Markets Ltd.	5,21 %	02.10.2023	400.000	1,13
80.062.500	GBP	Merrill Lynch International	5,15 %	02.10.2023	80.062	0,23
71.238.750	GBP	Merrill Lynch International	5,15 %	02.10.2023	71.239	0,20
39.272.500	GBP	Merrill Lynch International	5,15 %	02.10.2023	39.272	0,11
6.101.250	GBP	Merrill Lynch International	5,15 %	02.10.2023	6.101	0,02
3.325.000	GBP	Merrill Lynch International	5,15 %	02.10.2023	3.325	0,01
Vereinigte Staaten - Gesamt					599.999	1,70
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					5.230.562	14,80
					Zeitwert	% des Netto
					Tsd. GBP	inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					33.983.478	96,18
Zahlungsmittel					1.700.184	4,81
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					(351.484)	(0,99)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					35.332.178	100,00
Analyse des Gesamtvermögens						% des Gesamt-
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind						vermögens
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						11,15
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)						15,03
Sonstige Vermögenswerte						68,31
Gesamtvermögen						5,51
						100,00

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

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (30. September 2022: 42,19 %)				
		Australien (30. September 2022: 3,68 %)	-	-
		Belgien (30. September 2022: 0,00 %)		
80.000.000	GBP	Belfius Bank SA, 5.37%, 21/11/2023 ¹	79.386	3,31
		Belgien - Gesamt	79.386	3,31
		Kanada (30. September 2022: 11,63 %)		
60.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 5.29%, 22/04/2024 ¹	58.073	2,43
50.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 6.05%, 19/09/2024 ¹	47.240	1,97
		Kanada - Gesamt	105.313	4,40
		Finnland (30. September 2022: 4,26 %)		
60.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 5.29%, 26/04/2024 ¹	58.094	2,43
		Finnland - Gesamt	58.094	2,43
		Frankreich (30. September 2022: 4,28 %)		
70.000.000	GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.89%, 09/11/2023 ¹	69.585	2,91
70.000.000	GBP	BNP Paribas SA, 4.66%, 10/10/2023	69.985	2,92
70.000.000	GBP	Societe Generale SA, 4.66%, 31/01/2024 ¹	68.663	2,87
		Frankreich - Gesamt	208.233	8,70
		Japan (30. September 2022: 7,03 %)		
60.000.000	GBP	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.37%, 18/10/2023 ¹	59.833	2,50
50.000.000	GBP	MUFG Bank Ltd., 5.28%, 03/10/2023 ¹	49.970	2,08
50.000.000	GBP	MUFG Bank Ltd., 5.42%, 31/10/2023 ¹	49.760	2,08
50.000.000	GBP	MUFG Bank Ltd., 0.00%, 04/12/2023 ¹	49.546	2,07
50.000.000	GBP	Norinchukin Bank (The), 5.49%, 05/12/2023 ¹	49.496	2,06
50.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 5.39%, 29/11/2023 ¹	49.551	2,07
60.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 5.50%, 07/12/2023 ¹	59.387	2,48
40.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.21%, 02/10/2023 ¹	39.982	1,67
45.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.38%, 05/10/2023 ¹	44.960	1,88
		Japan - Gesamt	452.485	18,89
		Niederlande (30. September 2022: 0,00 %)		
60.000.000	GBP	ING Bank NV, 5.27%, 10/05/2024 ¹	57.945	2,42
		Niederlande - Gesamt	57.945	2,42
		Spanien (30. September 2022: 0,00 %)		
60.000.000	GBP	Banco Santander SA, 5.32%, 06/11/2023 ¹	59.675	2,49
		Spanien - Gesamt	59.675	2,49
		Schweiz (30. September 2022: 8,90 %)	-	-
		Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 2,41 %)		
50.000.000	GBP	Goldman Sachs International Bank, 5.63%, 07/12/2023 ¹	49.492	2,06
60.000.000	GBP	Lloyds Bank plc, 5.28%, 17/05/2024 ¹	57.881	2,42
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	107.373	4,48
		Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt	1.128.504	47,12

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (30. September 2022: 28,46 %)				
		Australien (30. September 2022: 4,18 %)	-	-
		Kanada (30. September 2022: 1,45 %)	-	-
70.000.000	GBP	Dänemark (30. September 2022: 3,66 %) Jyske Bank A/S, 4.61%, 13/02/2024 ¹	68.561	2,86
		Dänemark - Gesamt	68.561	2,86
60.000.000	GBP	Finnland (30. September 2022: 0,00 %) OP Corporate Bank plc, 4.94%, 11/03/2024 ¹	58.527	2,44
		Finnland - Gesamt	58.527	2,44
60.000.000	GBP	Frankreich (30. September 2022: 8,94 %) Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.79%, 12/04/2024 ¹	58.241	2,43
60.000.000	GBP	BPCE SA, 6.33%, 16/08/2024 ¹	57.017	2,38
21.540.000	GBP	Eurotitrisation - SAT Magenta, 3.84%, 02/10/2023 ¹	21.531	0,90
70.000.000	GBP	La Banque Postale SA, 4.79%, 23/02/2024 ¹	68.488	2,86
22.500.000	GBP	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 0.00%, 03/10/2023 ¹	22.497	0,94
30.000.000	GBP	Satellite, 5.31%, 02/10/2023 ¹	29.987	1,25
30.000.000	GBP	Satellite, 4.63%, 02/11/2023 ¹	29.865	1,25
		Frankreich - Gesamt	287.626	12,01
35.000.000	GBP	Irland (30. September 2022: 0,00 %) Matchpoint Finance plc, 5.49%, 27/11/2023 ¹	34.699	1,45
		Irland - Gesamt	34.699	1,45
60.000.000	GBP	Jersey (30. September 2022: 0,00 %) Royal Bank of Scotland International Ltd. (The), 5.32%, 06/11/2023 ¹	59.670	2,49
36.500.000	GBP	Royal Bank of Scotland International Ltd. (The), 5.79%, 22/01/2024 ¹	35.871	1,50
		Jersey - Gesamt	95.541	3,99
16.000.000	GBP	Luxemburg (30. September 2022: 0,00 %) Corelux SA, 5.27%, 02/11/2023 ¹	15.921	0,66
25.000.000	GBP	Corelux SA, 4.90%, 07/11/2023 ¹	24.859	1,04
		Luxemburg - Gesamt	40.780	1,70
30.000.000	EUR	Niederlande (30. September 2022: 0,00 %) Avery Dennison Corp., 3.86%, 04/12/2023 ¹	25.832	1,08
32.000.000	EUR	Givaudan Finance Europe BV, 3.64%, 08/11/2023 ¹	27.636	1,15
20.000.000	GBP	PACCAR Financial Europe BV, 4.96%, 05/10/2023 ¹	19.983	0,84
50.000.000	GBP	PACCAR Financial Europe BV, 0.00%, 06/11/2023 ¹	49.754	2,08
		Niederlande - Gesamt	123.205	5,15
10.000.000	GBP	Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 3,46 %) Honda Finance Europe plc, 4.83%, 05/10/2023 ¹	9.991	0,42
10.000.000	GBP	Honda Finance Europe plc, 5.38%, 30/11/2023 ¹	9.910	0,41
40.000.000	GBP	NTT Finance Uk Ltd., 5.44%, 20/10/2023 ¹	39.878	1,67
60.000.000	GBP	NTT Finance Uk Ltd., 5.41%, 08/12/2023 ¹	59.379	2,48
30.000.000	EUR	Sumitomo Corp. Capital Europe plc, 3.63%, 25/10/2023 ¹	25.949	1,08
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	145.107	6,06

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
60.000.000	EUR	Vereinigte Staaten (30. September 2022: 6,77 %) Realty Income Corp., 3.67%, 18/10/2023 ¹	51.936	2,17
		Vereinigte Staaten - Gesamt	51.936	2,17
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			905.982	37,83

Termineinlagen (30. September 2022: 16,63 %)

115.000.000	GBP	Belgien (30. September 2022: 0,00 %) KBC Bank NV, 5.17%, 02/10/2023	115.000	4,80
		Belgien - Gesamt	115.000	4,80
101.570.272	GBP	Japan (30. September 2022: 8,63 %) MUFG Bank Ltd., 5.18%, 02/10/2023	101.570	4,24
		Japan - Gesamt	101.570	4,24
150.000.000	GBP	Spanien (30. September 2022: 8,00 %) Banco Santander SA, 5.15%, 02/10/2023	150.000	6,27
		Spanien - Gesamt	150.000	6,27
Anlagen in Termineinlagen - Gesamt			366.570	15,31

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwert
---------	---------	---------	----------------------	------------------------------

ANLEIHEN

Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2022: 7,76 %)

Frankreich (30. September 2022: 1,59 %)	-	-
Niederlande (30. September 2022: 6,17 %)	-	-

Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt

-	-
---	---

Beschreibung	Kontrahent	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Devisenterminkontrakte²				
Buy GBP 26,055,381; Sell EUR 30,000,000	Standard Chartered	25.10.2023	12	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2022: 0,02 %)			12	-

Devisenterminkontrakte²

Buy GBP 176,410; Sell EUR 205,295	Toronto-Dominion Bank	18.10.2023	(2)	-
Buy GBP 51,397,699; Sell EUR 59,794,705	Standard Chartered	18.10.2023	(498)	(0,02)
Buy GBP 169,939; Sell EUR 197,388	Toronto-Dominion Bank	08.11.2023	(2)	-
Buy GBP 27,381,438; Sell EUR 31,802,612	Standard Chartered	08.11.2023	(242)	(0,01)
Buy GBP 185,015; Sell EUR 213,716	Merrill Lynch	04.12.2023	(1)	-
Buy GBP 25,785,909; Sell EUR 29,786,284	Morgan Stanley	04.12.2023	(113)	(0,01)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2022: (0,34) %)			(858)	(0,04)

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	2.401.068	100,26
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	(858)	(0,04)
Zahlungsmittel	101.130	4,22
Zahlungsmitteläquivalente		
Bestand Währung Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (30. September 2022: 4,32 %)		
85.000.000 GBP BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Dis) ³	85.000	3,55
Zahlungsmitteläquivalente - Gesamt	<u>85.000</u>	<u>3,55</u>
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	<u>(191.469)</u>	<u>(7,99)</u>
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert	<u>2.394.871</u>	<u>100,00</u>

	% des Gesamt- vermögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)	92,65
Investmentfonds (CIS)	3,28
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)*	–
Sonstige Vermögenswerte	4,07
Gesamtvermögen	<u>100,00</u>

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

² Devisenterminkontrakte, die bei einem Kontrahenten mit der gleichen Kaufwährung, Verkaufswährung und Fälligkeit gehalten werden, werden gegebenenfalls als Summe ausgewiesen. Aktiv- und Passivpositionen werden nicht verrechnet.

³ Dem Fonds nahestehende Partei.

* Anlagen, die weniger als 0,005 % des Gesamtvermögens betragen, werden auf null abgerundet.

	Basisengagement TSD. GBP
Derivative Finanzinstrumente	
Devisenterminkontrakte	131.850

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (30. September 2022: 27,09 %)				
Australien (30. September 2022: 0,00 %)				
12.000.000	USD	Commonwealth Bank of Australia, 5.95%, 28/08/2024 ¹	11.384	0,29
20.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.71%, 12/01/2024	20.012	0,52
10.000.000	USD	Westpac Banking Corp., FRN, 5.63%, 06/11/2023	10.002	0,26
13.000.000	USD	Westpac Banking Corp., FRN, 5.90%, 22/05/2024	13.014	0,33
Australien - Gesamt			54.412	1,40
Belgien (30. September 2022: 0,00 %)				
13.000.000	USD	KBC Bank NV, 5.80%, 23/02/2024 ¹	12.699	0,33
Belgien - Gesamt			12.699	0,33
Kanada (30. September 2022: 10,43 %)				
15.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.46%, 22/11/2023 ¹	14.880	0,38
15.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.80%, 07/02/2024 ¹	14.697	0,38
4.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.82%, 28/05/2024	3.996	0,10
20.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 5.78%, 03/06/2024	19.997	0,51
8.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), 5.82%, 28/05/2024	7.993	0,21
20.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.85%, 18/01/2024	20.027	0,52
11.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.60%, 01/12/2023	11.002	0,28
5.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.23%, 02/02/2024	4.992	0,13
11.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.40%, 08/02/2024	10.990	0,28
19.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.90%, 13/06/2024	19.002	0,49
10.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 5.96%, 19/09/2024	10.004	0,26
18.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.55%, 05/01/2024 ¹	17.725	0,46
10.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.61%, 27/02/2024 ¹	9.763	0,25
9.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 6.00%, 12/04/2024 ¹	8.721	0,22
12.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.82%, 24/05/2024	11.990	0,31
16.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 6.00%, 01/08/2024 ¹	15.223	0,39
13.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 6.00%, 26/08/2024 ¹	12.319	0,32
Kanada - Gesamt			213.321	5,49
Finnland (30. September 2022: 2,81 %)				
5.000.000	USD	OP Corporate Bank plc, 5.42%, 08/02/2024 ¹	4.900	0,13
5.000.000	USD	OP Corporate Bank plc, 5.45%, 12/02/2024 ¹	4.897	0,12
Finnland - Gesamt			9.797	0,25
Frankreich (30. September 2022: 1,67 %)				
5.000.000	USD	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.90%, 08/01/2024 ¹	4.924	0,13
10.000.000	USD	BNP Paribas SA, 5.35%, 16/11/2023	9.997	0,26
15.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN, 5.69%, 17/11/2023	15.006	0,39
12.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 5.40%, 10/11/2023	11.999	0,31
8.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 5.69%, 13/12/2023	8.003	0,20
20.000.000	USD	Credit Agricole SA, 5.80%, 04/01/2024 ¹	19.701	0,51
15.000.000	USD	Credit Agricole SA, 5.80%, 05/01/2024 ¹	14.773	0,38
10.000.000	USD	Credit Agricole SA, 5.60%, 23/02/2024 ¹	9.772	0,25
24.000.000	USD	Credit Industriel et Commercial, FRN, 5.68%, 03/11/2023	24.006	0,62
20.000.000	USD	Credit Industriel et Commercial, 5.60%, 27/11/2023	20.003	0,51
10.000.000	USD	Natixis SA, 5.70%, 01/12/2023	10.003	0,26
Frankreich - Gesamt			148.187	3,82
Deutschland (30. September 2022: 0,33 %)				
26.000.000	USD	DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main, FRN, 5.67%, 08/11/2023	26.006	0,67
11.000.000	USD	DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main, 5.40%, 09/11/2023	10.998	0,28
Deutschland - Gesamt			37.004	0,95

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (Fortsetzung)				
Japan (30. September 2022: 1,77 %)				
15.000.000	USD	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.70%, 01/11/2023 ¹	14.925	0,39
12.000.000	USD	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.60%, 03/01/2024	12.000	0,31
20.000.000	USD	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.60%, 05/01/2024	20.000	0,52
8.000.000	USD	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.85%, 17/01/2024 ¹	7.861	0,20
19.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., FRN, 5.73%, 20/02/2024	19.005	0,49
9.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.62%, 05/10/2023 ¹	8.992	0,23
13.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.65%, 23/10/2023 ¹	12.953	0,33
13.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.70%, 27/11/2023 ¹	12.884	0,33
15.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.70%, 08/12/2023 ¹	14.840	0,38
5.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.80%, 24/01/2024 ¹	4.909	0,13
13.000.000	USD	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.50%, 31/10/2023 ¹	12.937	0,33
20.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., 5.65%, 31/10/2023 ¹	19.902	0,51
11.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., 5.50%, 01/11/2023 ¹	10.945	0,28
13.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., 5.58%, 02/11/2023 ¹	12.933	0,33
10.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., 5.70%, 14/12/2023 ¹	9.882	0,26
7.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., 0.00%, 02/05/2024 ¹	7.000	0,18
Japan - Gesamt			201.968	5,20
Niederlande (30. September 2022: 0,93 %)				
18.000.000	USD	ABN AMRO Bank NV, 5.84%, 02/01/2024 ¹	17.736	0,46
20.000.000	USD	ING Bank NV, 5.42%, 08/02/2024 ¹	19.587	0,50
18.000.000	USD	ING Bank NV, 5.89%, 04/03/2024 ¹	17.555	0,45
Niederlande - Gesamt			54.878	1,41
Norwegen (30. September 2022: 0,19 %)				
13.000.000	USD	DNB Bank ASA, 5.30%, 07/02/2024 ¹	12.739	0,33
15.000.000	USD	DNB Bank ASA, 5.97%, 27/08/2024 ¹	14.219	0,37
Norwegen - Gesamt			26.958	0,70
Singapur (30. September 2022: 0,00 %)				
8.000.000	USD	Standard Chartered Bank, 5.69%, 15/11/2023 ¹	7.943	0,21
Singapur - Gesamt			7.943	0,21
Spanien (30. September 2022: 0,25 %)				
			-	-
Schweden (30. September 2022: 1,56 %)				
18.000.000	USD	Swedbank AB, 5.60%, 01/12/2023	18.004	0,46
Schweden - Gesamt			18.004	0,46
Schweiz (30. September 2022: 1,16 %)				
			-	-
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 3,67 %)				
15.500.000	USD	Barclays Bank plc, 5.70%, 16/02/2024	15.486	0,40
13.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 5.71%, 11/12/2023 ¹	12.856	0,33
19.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 5.75%, 08/01/2024 ¹	18.704	0,48
15.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 5.78%, 16/01/2024 ¹	14.748	0,38
12.000.000	USD	National Westminster Bank plc, 5.90%, 19/01/2024 ¹	11.791	0,30
20.000.000	USD	Standard Chartered Bank, FRN, 5.84%, 02/01/2024	20.016	0,52
Vereinigtes Königreich - Gesamt			93.601	2,41
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 2,32 %)				
23.490.000	USD	Bank of America NA, FRN, 5.77%, 29/01/2024	23.505	0,60
25.000.000	USD	Bank of America NA, 5.56%, 04/12/2023	25.002	0,64
10.000.000	USD	Bank of America NA, 5.75%, 09/01/2024	10.002	0,26
10.000.000	USD	Bank of America NA, 6.00%, 21/08/2024	10.001	0,26

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
8.000.000	USD	Citibank NA, 5.80%, 04/03/2024	7.999	0,21
10.000.000	USD	Citibank NA, 5.89%, 10/05/2024	10.000	0,26
20.000.000	USD	Citibank NA, 5.92%, 20/06/2024	19.999	0,51
		Vereinigte Staaten - Gesamt	106.508	2,74
Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt			985.280	25,37
Commercial Papers (30. September 2022: 36,70 %)				
Australien (30. September 2022: 3,76 %)				
12.000.000	USD	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 5.43%, 20/11/2023 ¹	11.904	0,31
9.000.000	USD	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 5.43%, 22/11/2023 ¹	8.925	0,23
9.000.000	USD	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 5.65%, 08/12/2023 ¹	8.906	0,23
11.000.000	USD	Commonwealth Bank of Australia, FRN, 5.81%, 18/03/2024	11.009	0,28
20.000.000	USD	Commonwealth Bank of Australia, 5.40%, 16/02/2024	19.984	0,52
23.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.77%, 29/01/2024	23.019	0,59
23.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.79%, 02/02/2024	23.020	0,59
5.400.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.81%, 08/04/2024	5.404	0,14
18.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.66%, 19/04/2024	17.998	0,46
10.000.000	USD	Toyota Finance Australia Ltd., 5.70%, 08/12/2023 ¹	9.894	0,26
19.000.000	USD	Toyota Finance Australia Ltd., 5.82%, 05/02/2024 ¹	18.622	0,48
7.000.000	USD	Toyota Finance Australia Ltd., 5.86%, 20/02/2024 ¹	6.844	0,18
23.000.000	USD	Westpac Banking Corp., FRN, 5.81%, 22/04/2024	23.017	0,59
18.000.000	USD	Westpac Banking Corp., FRN, 5.78%, 22/07/2024	18.002	0,46
6.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 5.72%, 13/03/2024 ¹	5.847	0,15
9.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 5.56%, 06/05/2024 ¹	8.693	0,22
		Australien - Gesamt	221.088	5,69
Österreich (30. September 2022: 0,49 %)				
15.000.000	USD	Republic of Austria, 5.67%, 30/01/2024 ¹	14.724	0,38
14.000.000	USD	Republic of Austria, 5.66%, 29/02/2024 ¹	13.675	0,35
		Österreich - Gesamt	28.399	0,73
Belgien (30. September 2022: 1,38 %)				
			-	-
Kanada (30. September 2022: 2,56 %)				
22.000.000	USD	Bank of Montreal, FRN, 5.71%, 18/12/2023	22.010	0,57
10.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.82%, 01/04/2024 ¹	9.712	0,25
9.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.82%, 03/04/2024 ¹	8.738	0,23
12.250.000	USD	Bank of Montreal, 5.98%, 30/07/2024 ¹	11.666	0,30
12.000.000	USD	CDP Financial, Inc., 5.80%, 08/08/2024 ¹	11.409	0,29
18.000.000	USD	Royal Bank of Canada, FRN, 5.91%, 23/05/2024	18.023	0,46
		Kanada - Gesamt	81.558	2,10
Cayman-Inseln (30. September 2022: 0,86 %)				
			-	-
Finnland (30. September 2022: 0,00 %)				
20.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.40%, 04/10/2023 ¹	19.985	0,51
8.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.36%, 10/10/2023 ¹	7.987	0,21
9.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.65%, 03/01/2024 ¹	8.871	0,23
8.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.65%, 04/01/2024 ¹	7.884	0,20
15.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.70%, 18/01/2024 ¹	14.751	0,38
5.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.70%, 19/01/2024 ¹	4.916	0,13
10.000.000	USD	OP Corporate Bank plc, 5.45%, 09/02/2024 ¹	9.799	0,25
		Finnland - Gesamt	74.193	1,91

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Frankreich (30. September 2022: 10,47 %)				
41.000.000	USD	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 5.35%, 02/10/2023 ¹	40.982	1,05
30.000.000	USD	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 5.39%, 02/10/2023 ¹	29.987	0,77
15.000.000	USD	BPCE SA, 5.70%, 07/12/2023 ¹	14.842	0,38
10.000.000	USD	BPCE SA, 5.93%, 15/04/2024 ¹	9.697	0,25
50.000.000	USD	BRED Banque Populaire, 5.34%, 02/10/2023 ¹	49.977	1,29
50.000.000	USD	BRED Banque Populaire, 0.00%, 03/10/2023 ¹	49.993	1,29
15.000.000	USD	BRED Banque Populaire, 5.85%, 02/01/2024 ¹	14.784	0,38
10.000.000	USD	Eurotitrisation - SAT Magenta, 5.53%, 31/10/2023 ¹	9.952	0,26
55.000.000	USD	La Banque Postale SA, 5.30%, 02/10/2023 ¹	54.975	1,42
55.000.000	USD	La Banque Postale SA, 0.00%, 03/10/2023 ¹	54.992	1,42
5.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 5.53%, 31/10/2023 ¹	4.976	0,13
8.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 5.53%, 02/11/2023 ¹	7.959	0,20
5.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 5.73%, 05/12/2023 ¹	4.948	0,13
10.000.000	USD	Satellite, 5.50%, 12/10/2023 ¹	9.980	0,26
6.000.000	USD	Satellite, 5.50%, 18/10/2023 ¹	5.983	0,15
5.000.000	USD	Satellite, 5.50%, 23/10/2023 ¹	4.982	0,13
5.000.000	USD	Satellite, 5.50%, 23/10/2023 ¹	4.982	0,13
15.000.000	USD	Satellite, 5.57%, 03/11/2023 ¹	14.920	0,38
		Frankreich - Gesamt	388.911	10,02
Deutschland (30. September 2022: 4,59 %)				
30.000.000	USD	FMS Wertmanagement, 5.35%, 06/10/2023 ¹	29.969	0,77
6.000.000	USD	FMS Wertmanagement, 5.73%, 02/05/2024 ¹	5.802	0,15
6.000.000	USD	FMS Wertmanagement, 5.73%, 03/05/2024 ¹	5.801	0,15
70.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 5.34%, 02/10/2023 ¹	69.969	1,80
18.000.000	USD	NRW. Bank, 5.65%, 12/02/2024 ¹	17.631	0,46
20.000.000	USD	NRW. Bank, 5.67%, 23/02/2024 ¹	19.555	0,50
20.000.000	USD	NRW. Bank, 5.70%, 01/03/2024 ¹	19.534	0,50
		Deutschland - Gesamt	168.261	4,33
Hongkong (30. September 2022: 1,02 %)				
			-	-
Irland (30. September 2022: 0,12 %)				
5.000.000	USD	Matchpoint Finance plc, 5.82%, 05/02/2024 ¹	4.900	0,13
5.000.000	USD	Matchpoint Finance plc, 5.82%, 12/02/2024 ¹	4.895	0,12
		Irland - Gesamt	9.795	0,25
Luxemburg (30. September 2022: 0,00 %)				
33.000.000	USD	DZ Privatbank SA, 5.40%, 02/10/2023 ¹	32.985	0,85
13.000.000	USD	DZ Privatbank SA, 5.40%, 04/10/2023 ¹	12.990	0,33
33.000.000	USD	DZ Privatbank SA, 0.00%, 10/10/2023 ¹	32.946	0,85
		Luxemburg - Gesamt	78.921	2,03
Niederlande (30. September 2022: 2,46 %)				
30.000.000	USD	BNG Bank NV, 0.00%, 10/10/2023 ¹	29.969	0,77
15.000.000	USD	BNG Bank NV, 0.00%, 11/10/2023 ¹	14.982	0,39
15.000.000	USD	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 5.80%, 02/02/2024 ¹	14.709	0,38
		Niederlande - Gesamt	59.660	1,54
Neuseeland (30. September 2022: 0,00 %)				
8.000.000	USD	ANZ New Zealand Int'l Ltd., 5.90%, 17/06/2024 ¹	7.678	0,20
		Neuseeland - Gesamt	7.678	0,20
Norwegen (30. September 2022: 0,89 %)				
10.000.000	USD	DNB Bank ASA, FRN, 5.79%, 29/04/2024	10.006	0,26

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Norwegen (Fortsetzung)				
15.000.000	USD	DNB Bank ASA, 5.90%, 13/06/2024 ¹	14.398	0,37
		Norwegen - Gesamt	24.404	0,63
Singapur (30. September 2022: 0,61 %)				
10.000.000	USD	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 5.64%, 19/01/2024 ¹	9.829	0,25
19.000.000	USD	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 5.66%, 23/01/2024 ¹	18.662	0,48
		Singapur - Gesamt	28.491	0,73
Supranational (30. September 2022: 0,00 %)				
21.000.000	USD	European Investment Bank, 5.61%, 31/01/2024 ¹	20.614	0,53
80.000.000	USD	International Development Association, 5.36%, 16/10/2023 ¹	79.796	2,05
20.000.000	USD	International Development Association, 5.65%, 07/02/2024 ¹	19.609	0,51
		Supranational - Gesamt	120.019	3,09
Schweden (30. September 2022: 0,98 %)				
8.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, 5.68%, 12/12/2023 ¹	7.912	0,21
30.000.000	USD	Swedbank AB, FRN, 5.72%, 28/12/2023	30.016	0,77
		Schweden - Gesamt	37.928	0,98
Schweiz (30. September 2022: 1,16 %)				
17.000.000	USD	UBS AG, 5.45%, 16/10/2023 ¹	16.957	0,44
13.000.000	USD	UBS AG, 5.99%, 31/05/2024 ¹	12.495	0,32
		Schweiz - Gesamt	29.452	0,76
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 4,12 %)				
9.000.000	USD	HSBC Bank plc, FRN, 5.74%, 26/01/2024	9.003	0,23
21.000.000	USD	Lloyds Bank plc, 5.51%, 19/10/2023 ¹	20.938	0,54
4.000.000	USD	Lloyds Bank plc, 5.69%, 15/12/2023 ¹	3.953	0,10
10.000.000	USD	Lloyds Bank plc, 5.80%, 01/03/2024 ¹	9.759	0,25
35.000.000	USD	Standard Chartered Bank, 5.32%, 05/10/2023 ¹	34.969	0,90
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	78.622	2,02
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 1,23 %)				
17.450.000	USD	Alinghi Funding Co. LLC, 5.83%, 28/03/2024 ¹	16.954	0,44
26.000.000	USD	HAT Holdings I LLC, 5.39%, 26/10/2023 ¹	25.890	0,67
10.000.000	USD	ING US Funding LLC, FRN, 5.85%, 01/04/2024	10.007	0,26
9.000.000	USD	ING US Funding LLC, 5.43%, 08/11/2023 ¹	8.946	0,23
37.000.000	USD	Microsoft Corp., 5.33%, 23/10/2023 ¹	36.869	0,95
25.000.000	USD	Microsoft Corp., 5.51%, 03/01/2024 ¹	24.642	0,63
		Vereinigte Staaten - Gesamt	123.308	3,18
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			1.560.688	40,19
Termineinlagen (30. September 2022: 12,42 %)				
Kanada (30. September 2022: 4,20 %)				
50.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.31%, 02/10/2023	50.000	1,29
120.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 5.32%, 02/10/2023	120.000	3,09
		Kanada - Gesamt	170.000	4,38
Frankreich (30. September 2022: 0,40 %)				
3.000.000	USD	Credit Agricole SA, 5.30%, 02/10/2023	3.000	0,08
		Frankreich - Gesamt	3.000	0,08

NM0124U-3356337-123/233

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Termineinlagen (Fortsetzung)				
		Japan (30. September 2022: 3,69 %)	-	-
		Schweden (30. September 2022: 4,13 %)		
129.000.000	USD	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 5.32%, 02/10/2023	129.000	3,32
5.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, 5.30%, 02/10/2023	5.000	0,13
		Schweden - Gesamt	134.000	3,45
		Anlagen in Termineinlagen - Gesamt	307.000	7,91

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Staatsanleihen (30. September 2022: 0,00 %)				
		Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,00 %)		
13.000.000	USD	US Treasury, FRN, 5.44%, 31/10/2023	13.000	0,33
30.570.700	USD	US Treasury Bill, 5.27%, 19/10/2023 ¹	30.495	0,79
		Vereinigte Staaten - Gesamt	43.495	1,12
		Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt	43.495	1,12

Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2022: 0,58 %)				
		Luxemburg (30. September 2022: 0,00 %)		
25.000.000	USD	SG Issuer SA, 0.00%, 05/01/2024 ²	25.000	0,64
		Luxemburg - Gesamt	25.000	0,64
		Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,58 %)		
10.000.000	USD	Bank of America NA, 5.25%, 31/01/2024	9.977	0,26
9.654.000	USD	Bank of America NA, 5.44%, 06/02/2024	9.638	0,25
		Vereinigte Staaten - Gesamt	19.615	0,51
		Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt	44.615	1,15
		Anlagen in Anleihen - Gesamt	88.110	2,27

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2022: 22,70 %)						
Frankreich (30. September 2022: 0,00 %)						
120.000.000	USD	BNP Paribas SA	5,29 %	02.10.2023	120.000	3,09
		Frankreich - Gesamt			120.000	3,09
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 22,70 %)						
455.500.000	USD	Bofa Securities Inc.	5,30 %	02.10.2023	455.500	11,73

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung)						
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)						
230.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	5,30 %	02.10.2023	230.000	5,92
192.620.000	USD	J.P. Morgan Securities LLC	5,31 %	02.10.2023	192.620	4,96
Vereinigte Staaten - Gesamt					878.120	22,61
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					998.120	25,70
					Zeitwert	% des Netto
					Tsd. USD	inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					3.939.198	101,44
Zahlungsmittel					140.902	3,63
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					(196.921)	(5,07)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					3.883.179	100,00
						% des Gesamt-
Analyse des Gesamtvermögens						vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind						0,32
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						26,25
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)						69,78
Sonstige Vermögenswerte						3,65
Gesamtvermögen						100,00

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

²Nullkupon-Anleihe

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (30. September 2022: 30,75 %)				
Australien (30. September 2022: 0,00 %)				
221.000.000	USD	Commonwealth Bank of Australia, 5.95%, 28/08/2024 ¹	209.598	0,32
257.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.71%, 12/01/2024	257.000	0,40
86.000.000	USD	Westpac Banking Corp., FRN, 5.63%, 06/11/2023	86.000	0,13
		Australien - Gesamt	552.598	0,85
Belgien (30. September 2022: 0,11 %)				
33.000.000	USD	Euroclear Bank SA, 5.60%, 01/11/2023 ¹	32.848	0,05
125.000.000	USD	Euroclear Bank SA, 5.80%, 18/01/2024 ¹	122.886	0,19
30.000.000	USD	Euroclear Bank SA, 5.85%, 18/03/2024 ¹	29.204	0,04
180.000.000	USD	KBC Bank NV, 5.52%, 31/10/2023	180.000	0,28
215.000.000	USD	KBC Bank NV, 5.80%, 23/02/2024 ¹	210.139	0,32
		Belgien - Gesamt	575.077	0,88
Kanada (30. September 2022: 8,44 %)				
214.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.46%, 22/11/2023	212.390	0,33
218.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.80%, 07/02/2024 ¹	213.634	0,33
51.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.82%, 28/05/2024	51.000	0,08
186.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.95%, 03/07/2024 ¹	177.921	0,27
117.420.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 5.80%, 26/01/2024	117.420	0,18
122.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 5.79%, 31/01/2024	121.999	0,19
300.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 5.78%, 03/06/2024	300.000	0,46
100.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), 5.82%, 28/05/2024	100.000	0,15
248.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 5.85%, 18/01/2024	248.000	0,38
142.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.60%, 01/12/2023	142.000	0,22
100.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.23%, 02/02/2024	100.000	0,15
136.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.40%, 08/02/2024	136.000	0,21
286.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.90%, 13/06/2024	286.000	0,44
100.000.000	USD	Royal Bank of Canada, FRN, 5.84%, 11/04/2024	100.000	0,15
200.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 5.96%, 19/09/2024	200.000	0,31
125.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 5.82%, 29/01/2024	125.000	0,19
180.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.55%, 05/01/2024 ¹	177.452	0,27
121.825.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.63%, 11/01/2024	121.824	0,19
150.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.27%, 24/01/2024	150.000	0,23
173.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.61%, 27/02/2024 ¹	169.225	0,26
100.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 6.00%, 12/04/2024 ¹	96.923	0,15
165.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.82%, 24/05/2024	165.000	0,25
181.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 6.00%, 01/08/2024 ¹	172.354	0,26
177.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 6.00%, 26/08/2024 ¹	167.854	0,26
		Kanada - Gesamt	3.851.996	5,91
Finnland (30. September 2022: 1,06 %)				
90.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 5.81%, 18/03/2024	90.000	0,14
50.000.000	USD	OP Corporate Bank plc, 5.42%, 08/02/2024 ¹	49.079	0,08
88.000.000	USD	OP Corporate Bank plc, 5.45%, 12/02/2024 ¹	86.321	0,13
		Finnland - Gesamt	225.400	0,35
Frankreich (30. September 2022: 2,22 %)				
193.000.000	USD	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.90%, 08/01/2024 ¹	189.989	0,29
150.000.000	USD	BNP Paribas SA, 5.35%, 16/11/2023	150.000	0,23
217.000.000	USD	BNP Paribas SA, 5.25%, 31/01/2024	217.000	0,33
212.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN, 5.69%, 17/11/2023	212.000	0,33
159.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 5.40%, 10/11/2023	159.000	0,24
111.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 5.69%, 13/12/2023	111.000	0,17
258.000.000	USD	Credit Agricole SA, 5.80%, 04/01/2024 ¹	254.189	0,39
213.000.000	USD	Credit Agricole SA, 5.80%, 05/01/2024 ¹	209.837	0,32
190.000.000	USD	Credit Agricole SA, 5.60%, 23/02/2024 ¹	185.972	0,29
311.000.000	USD	Credit Industriel et Commercial, FRN, 5.68%, 03/11/2023	311.000	0,48

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
250.000.000	USD	Credit Industriel et Commercial, FRN, 5.68%, 08/04/2024	250.000	0,38
180.000.000	USD	Credit Industriel et Commercial, 5.60%, 27/11/2023	180.000	0,28
200.000.000	USD	Credit Industriel et Commercial, 5.35%, 19/01/2024	200.003	0,31
100.000.000	USD	Credit Industriel et Commercial, 5.26%, 06/02/2024	100.002	0,15
200.000.000	USD	Natixis SA, FRN, 5.60%, 17/11/2023	200.000	0,31
85.000.000	USD	Natixis SA, 5.70%, 01/12/2023	85.000	0,13
		Frankreich - Gesamt	3.014.992	4,63
Deutschland (30. September 2022: 0,00 %)				
339.000.000	USD	DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main, FRN, 5.67%, 08/11/2023	339.000	0,52
		Deutschland - Gesamt	339.000	0,52
Japan (30. September 2022: 9,42 %)				
240.000.000	USD	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., FRN, 5.71%, 19/03/2024	240.000	0,37
125.000.000	USD	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.70%, 01/11/2023 ¹	124.415	0,19
209.000.000	USD	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.60%, 03/01/2024	209.000	0,32
271.000.000	USD	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.60%, 05/01/2024	271.000	0,42
90.000.000	USD	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.85%, 17/01/2024 ¹	88.468	0,14
95.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., FRN, 5.66%, 17/11/2023	95.017	0,15
100.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., FRN, 5.80%, 22/11/2023	100.001	0,15
243.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., FRN, 5.73%, 20/02/2024	243.000	0,37
90.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.62%, 05/10/2023 ¹	89.958	0,14
160.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.65%, 23/10/2023 ¹	159.480	0,24
185.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.70%, 27/11/2023 ¹	183.387	0,28
84.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.70%, 08/12/2023 ¹	83.120	0,13
288.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.80%, 22/01/2024 ¹	282.903	0,43
175.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.80%, 24/01/2024 ¹	171.847	0,26
310.000.000	USD	Mizuho Corporate Bank Ltd., 5.50%, 31/10/2023 ¹	308.633	0,47
148.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., FRN, 5.75%, 10/11/2023	148.000	0,23
230.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., 5.65%, 31/10/2023 ¹	228.969	0,35
187.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., 5.50%, 01/11/2023 ¹	186.148	0,29
187.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., 5.58%, 02/11/2023 ¹	186.112	0,29
290.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., 5.70%, 14/12/2023 ¹	286.693	0,44
140.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., 0.00%, 02/05/2024 ¹	140.000	0,22
250.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN, 5.64%, 15/11/2023	250.000	0,38
200.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN, 5.71%, 20/02/2024	200.000	0,31
268.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.60%, 29/11/2023	268.000	0,41
200.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.61%, 19/12/2023	200.000	0,31
205.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5.70%, 18/01/2024	205.000	0,31
		Japan - Gesamt	4.949.151	7,60
Niederlande (30. September 2022: 1,23 %)				
245.000.000	USD	ABN AMRO Bank NV, 5.84%, 02/01/2024 ¹	241.455	0,37
149.000.000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 5.66%, 08/12/2023	149.000	0,23
300.000.000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 5.69%, 28/12/2023	300.000	0,46
224.000.000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 5.81%, 01/04/2024	224.000	0,34
293.000.000	USD	ING Bank NV, 5.42%, 08/02/2024 ¹	287.605	0,44
253.000.000	USD	ING Bank NV, 5.89%, 04/03/2024 ¹	246.814	0,38
		Niederlande - Gesamt	1.448.874	2,22
Norwegen (30. September 2022: 0,26 %)				
205.000.000	USD	DNB Bank ASA, 5.30%, 07/02/2024 ¹	201.333	0,31
235.000.000	USD	DNB Bank ASA, 5.97%, 27/08/2024 ¹	222.872	0,34
		Norwegen - Gesamt	424.205	0,65

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (Fortsetzung)				
Singapur (30. September 2022: 0,45 %)				
100.000.000	USD	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., FRN, 5.67%, 06/03/2024	100.000	0,15
90.000.000	USD	Standard Chartered Bank, 5.69%, 15/11/2023 ¹	89.383	0,14
Singapur - Gesamt			189.383	0,29
Südkorea (30. September 2022: 0,00 %)				
98.000.000	USD	Korea Development Bank, 5.63%, 29/11/2023 ¹	97.124	0,15
90.000.000	USD	Korea Development Bank, 5.72%, 01/12/2023 ¹	89.154	0,14
Südkorea - Gesamt			186.278	0,29
Schweden (30. September 2022: 1,25 %)				
100.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.67%, 06/11/2023	100.000	0,15
375.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.87%, 29/04/2024	375.000	0,58
100.000.000	USD	Swedbank AB, 5.60%, 01/12/2023	100.000	0,15
Schweden - Gesamt			575.000	0,88
Schweiz (30. September 2022: 0,88 %)				
			-	-
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 3,54 %)				
150.000.000	USD	Barclays Bank plc, FRN, 6.20%, 22/11/2023	150.000	0,23
250.000.000	USD	Barclays Bank plc, 5.70%, 16/02/2024	250.000	0,38
210.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 5.71%, 11/12/2023 ¹	207.702	0,32
255.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 5.75%, 08/01/2024 ¹	251.102	0,39
210.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 5.78%, 16/01/2024 ¹	206.505	0,32
165.000.000	USD	National Westminster Bank plc, 5.90%, 19/01/2024 ¹	162.138	0,25
100.000.000	USD	Standard Chartered Bank, FRN, 5.84%, 02/01/2024	100.000	0,15
100.000.000	USD	Standard Chartered Bank, 5.63%, 01/03/2024	100.000	0,15
Vereinigtes Königreich - Gesamt			1.427.447	2,19
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 1,89 %)				
181.000.000	USD	Bank of America NA, FRN, 5.64%, 14/12/2023	181.000	0,28
200.000.000	USD	Bank of America NA, FRN, 5.82%, 16/01/2024	200.000	0,31
366.000.000	USD	Bank of America NA, FRN, 5.77%, 29/01/2024	366.000	0,56
100.000.000	USD	Bank of America NA, FRN, 5.69%, 27/03/2024	100.000	0,15
120.000.000	USD	Bank of America NA, 5.75%, 09/01/2024	120.000	0,19
137.000.000	USD	Bank of America NA, 6.00%, 21/08/2024	137.000	0,21
100.000.000	USD	Citibank NA, 5.80%, 04/03/2024	100.000	0,15
151.000.000	USD	Citibank NA, 5.80%, 18/03/2024	151.000	0,23
124.000.000	USD	Citibank NA, 5.89%, 10/05/2024	124.000	0,19
200.000.000	USD	Citibank NA, 5.92%, 20/06/2024	200.000	0,31
250.000.000	USD	Wells Fargo Bank NA, FRN, 5.66%, 07/03/2024	250.000	0,38
225.000.000	USD	Wells Fargo Bank NA, FRN, 5.91%, 04/09/2024	225.000	0,35
Vereinigte Staaten - Gesamt			2.154.000	3,31
Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt			19.913.401	30,57
Commercial Papers (30. September 2022: 32,99 %)				
Australien (30. September 2022: 2,84 %)				
150.000.000	USD	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 5.81%, 02/04/2024	150.000	0,23
170.000.000	USD	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 5.43%, 20/11/2023 ¹	168.778	0,26
130.000.000	USD	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 5.43%, 22/11/2023 ¹	129.027	0,20
125.000.000	USD	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 5.65%, 08/12/2023 ¹	123.723	0,19
143.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.66%, 05/12/2023	143.000	0,22
277.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.77%, 29/01/2024	277.000	0,42
277.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.79%, 02/02/2024	277.000	0,42

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Australien (Fortsetzung)				
170.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.83%, 01/04/2024	170.000	0,26
75.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.81%, 08/04/2024	75.000	0,11
84.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.81%, 12/04/2024	84.000	0,13
277.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.66%, 19/04/2024	277.000	0,43
115.000.000	USD	Toyota Finance Australia Ltd., 5.62%, 16/10/2023 ¹	114.754	0,18
63.000.000	USD	Toyota Finance Australia Ltd., 5.70%, 08/12/2023 ¹	62.344	0,10
45.000.000	USD	Toyota Finance Australia Ltd., 5.82%, 05/02/2024 ¹	44.110	0,07
92.000.000	USD	Toyota Finance Australia Ltd., 5.86%, 20/02/2024 ¹	89.951	0,14
140.000.000	USD	Toyota Finance Australia Ltd., 5.81%, 08/03/2024 ¹	136.532	0,21
100.000.000	USD	Westpac Banking Corp., FRN, 5.81%, 19/04/2024	100.000	0,15
277.000.000	USD	Westpac Banking Corp., FRN, 5.81%, 22/04/2024	277.000	0,43
250.000.000	USD	Westpac Banking Corp., FRN, 5.78%, 22/07/2024	250.000	0,38
67.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 5.72%, 13/03/2024 ¹	65.337	0,10
115.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 5.56%, 06/05/2024 ¹	111.340	0,17
Australien - Gesamt			3.125.896	4,80
Österreich (30. September 2022: 0,51 %)				
230.000.000	USD	Republic of Austria, 5.67%, 30/01/2024 ¹	225.754	0,35
230.000.000	USD	Republic of Austria, 5.66%, 29/02/2024 ¹	224.728	0,34
Österreich - Gesamt			450.482	0,69
Belgien (30. September 2022: 2,20 %)				
			-	-
Kanada (30. September 2022: 4,04 %)				
281.000.000	USD	Bank of Montreal, FRN, 5.71%, 18/12/2023	281.000	0,43
140.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.82%, 01/04/2024 ¹	136.015	0,21
149.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.82%, 03/04/2024 ¹	144.705	0,22
158.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.98%, 30/07/2024 ¹	150.524	0,23
164.000.000	USD	CDP Financial, Inc., 5.80%, 08/08/2024 ¹	156.238	0,24
198.000.000	USD	Export Development Canada, 5.75%, 08/02/2024 ¹	194.006	0,30
99.000.000	USD	Export Development Canada, 5.75%, 26/02/2024 ¹	96.731	0,15
85.000.000	USD	Export Development Canada, 5.75%, 11/03/2024 ¹	82.870	0,13
143.000.000	USD	Federation des Caisses Desjardins du Quebec (The), 5.80%, 19/03/2024 ¹	139.220	0,21
150.000.000	USD	Royal Bank of Canada, FRN, 5.67%, 22/11/2023	150.000	0,23
15.800.000	USD	Royal Bank of Canada, FRN, 5.91%, 23/05/2024	15.800	0,02
Kanada - Gesamt			1.547.109	2,37
Cayman-Inseln (30. September 2022: 0,43 %)				
			-	-
Dänemark (30. September 2022: 0,47 %)				
595.000.000	USD	Jyske Bank A/S, 5.44%, 02/10/2023 ¹	595.000	0,92
595.000.000	USD	Jyske Bank A/S, 0.00%, 10/10/2023 ¹	594.292	0,91
Dänemark - Gesamt			1.189.292	1,83
Finnland (30. September 2022: 0,59 %)				
102.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.40%, 04/10/2023 ¹	101.970	0,16
98.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.36%, 05/10/2023 ¹	97.956	0,15
120.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.36%, 10/10/2023 ¹	119.857	0,18
140.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.65%, 03/01/2024 ¹	137.998	0,21
90.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.65%, 04/01/2024 ¹	88.698	0,14
140.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.70%, 08/01/2024 ¹	137.873	0,21
129.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.70%, 18/01/2024 ¹	126.840	0,20
95.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.70%, 19/01/2024 ¹	93.395	0,14
97.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.70%, 02/02/2024 ¹	95.152	0,15
200.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 5.71%, 11/10/2023	200.000	0,31
55.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 5.65%, 31/10/2023	55.000	0,08
175.000.000	USD	OP Corporate Bank plc, 5.80%, 05/01/2024 ¹	172.408	0,26

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Finnland (Fortsetzung)				
63.000.000	USD	OP Corporate Bank plc, 5.45%, 09/02/2024 ¹	61.825	0,10
		Finnland - Gesamt	1.488.972	2,29
Frankreich (30. September 2022: 8,19 %)				
702.000.000	USD	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 5.35%, 02/10/2023 ¹	702.000	1,08
465.000.000	USD	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 5.39%, 02/10/2023 ¹	465.000	0,71
400.000.000	USD	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 5.35%, 06/10/2023 ¹	399.763	0,61
150.000.000	USD	BPCE SA, 5.70%, 07/12/2023 ¹	148.477	0,23
190.000.000	USD	BPCE SA, 5.93%, 15/04/2024 ¹	184.075	0,28
350.000.000	USD	BRED Banque Populaire, 5.34%, 02/10/2023 ¹	350.000	0,54
350.000.000	USD	BRED Banque Populaire, 0.00%, 03/10/2023 ¹	349.948	0,54
235.000.000	USD	BRED Banque Populaire, 5.85%, 02/01/2024 ¹	231.591	0,36
102.500.000	USD	Eurotitrisation - SAT Magenta, 5.40%, 02/10/2023 ¹	102.500	0,16
102.500.000	USD	Eurotitrisation - SAT Magenta, 0.00%, 03/10/2023 ¹	102.485	0,16
95.000.000	USD	Eurotitrisation - SAT Magenta, 5.53%, 31/10/2023 ¹	94.579	0,14
443.000.000	USD	La Banque Postale SA, 5.30%, 02/10/2023 ¹	443.000	0,68
443.000.000	USD	La Banque Postale SA, 0.00%, 03/10/2023 ¹	442.935	0,68
85.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 5.53%, 31/10/2023 ¹	84.624	0,13
35.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 5.53%, 02/11/2023 ¹	34.834	0,05
90.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 5.73%, 05/12/2023 ¹	89.097	0,14
93.000.000	USD	Satellite, 5.50%, 12/10/2023 ¹	92.859	0,14
57.000.000	USD	Satellite, 5.50%, 18/10/2023 ¹	56.861	0,09
45.000.000	USD	Satellite, 5.50%, 23/10/2023 ¹	44.856	0,07
34.000.000	USD	Satellite, 5.50%, 23/10/2023 ¹	33.891	0,05
118.000.000	USD	Satellite, 5.57%, 03/11/2023 ¹	117.421	0,18
250.000.000	USD	Societe Generale SA, 5.48%, 31/10/2023 ¹	248.904	0,38
		Frankreich - Gesamt	4.819.700	7,40
Deutschland (30. September 2022: 3,50 %)				
100.000.000	USD	DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main, 0.00%, 02/10/2023	100.000	0,15
247.000.000	USD	FMS Wertmanagement, 5.35%, 02/10/2023 ¹	247.000	0,38
247.000.000	USD	FMS Wertmanagement, 5.35%, 04/10/2023 ¹	246.927	0,38
267.000.000	USD	FMS Wertmanagement, 5.35%, 06/10/2023 ¹	266.842	0,41
63.000.000	USD	FMS Wertmanagement, 5.73%, 02/05/2024 ¹	60.954	0,09
61.750.000	USD	FMS Wertmanagement, 5.73%, 03/05/2024 ¹	59.735	0,09
920.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 5.34%, 02/10/2023 ¹	920.000	1,41
300.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 5.34%, 05/10/2023 ¹	299.867	0,46
250.000.000	USD	NRW. Bank, 5.30%, 03/10/2023 ¹	249.963	0,38
400.000.000	USD	NRW. Bank, 5.30%, 04/10/2023 ¹	399.882	0,62
65.000.000	USD	NRW. Bank, 5.25%, 24/11/2023 ¹	64.517	0,10
255.000.000	USD	NRW. Bank, 5.65%, 12/02/2024 ¹	249.827	0,38
150.000.000	USD	NRW. Bank, 5.71%, 12/02/2024 ¹	146.913	0,23
276.000.000	USD	NRW. Bank, 5.67%, 23/02/2024 ¹	269.917	0,42
260.000.000	USD	NRW. Bank, 5.70%, 01/03/2024 ¹	253.965	0,39
		Deutschland - Gesamt	3.836.309	5,89
Hongkong (30. September 2022: 0,94 %)				
			-	-
Irland (30. September 2022: 0,11 %)				
67.000.000	USD	Matchpoint Finance plc, 5.82%, 05/02/2024 ¹	65.668	0,10
35.000.000	USD	Matchpoint Finance plc, 5.82%, 12/02/2024 ¹	34.266	0,05
		Irland - Gesamt	99.934	0,15
Luxemburg (30. September 2022: 0,00 %)				
183.000.000	USD	Banque et Caisse d'Epargne de l'Etat, 5.70%, 12/02/2024 ¹	179.256	0,28
562.000.000	USD	DZ Privatbank SA, 5.40%, 02/10/2023 ¹	562.000	0,86

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Luxemburg (Fortsetzung)				
235.000.000	USD	DZ Privatbank SA, 5.40%, 04/10/2023 ¹	234.930	0,36
562.000.000	USD	DZ Privatbank SA, 0.00%, 10/10/2023 ¹	561.331	0,86
		Luxemburg - Gesamt	1.537.517	2,36
Niederlande (30. September 2022: 1,33 %)				
466.000.000	USD	BNG Bank NV, 0.00%, 10/10/2023 ¹	465.516	0,71
285.000.000	USD	BNG Bank NV, 0.00%, 11/10/2023 ¹	284.662	0,44
244.000.000	USD	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 5.80%, 04/01/2024 ¹	240.394	0,37
200.000.000	USD	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 5.80%, 02/02/2024 ¹	196.143	0,30
		Niederlande - Gesamt	1.186.715	1,82
Neuseeland (30. September 2022: 0,00 %)				
118.600.000	USD	ANZ New Zealand Int'l Ltd., 5.90%, 17/06/2024 ¹	113.779	0,17
		Neuseeland - Gesamt	113.779	0,17
Norwegen (30. September 2022: 0,44 %)				
150.000.000	USD	DNB Bank ASA, FRN, 5.79%, 29/04/2024	150.000	0,23
220.000.000	USD	DNB Bank ASA, 5.90%, 13/06/2024 ¹	211.203	0,32
		Norwegen - Gesamt	361.203	0,55
Singapur (30. September 2022: 1,40 %)				
161.000.000	USD	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 5.64%, 19/01/2024 ¹	158.304	0,24
155.000.000	USD	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 5.66%, 22/01/2024 ¹	152.324	0,23
190.000.000	USD	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 5.66%, 23/01/2024 ¹	186.690	0,29
		Singapur - Gesamt	497.318	0,76
Supranational (30. September 2022: 0,15 %)				
275.000.000	USD	European Investment Bank, 5.61%, 31/01/2024 ¹	269.952	0,42
580.000.000	USD	International Development Association, 5.36%, 16/10/2023 ¹	578.795	0,89
275.000.000	USD	International Development Association, 5.65%, 07/02/2024 ¹	269.631	0,41
		Supranational - Gesamt	1.118.378	1,72
Schweden (30. September 2022: 0,91 %)				
198.000.000	USD	Svensk Exportkredit AB, 0.00%, 04/10/2023 ¹	197.941	0,30
110.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, 5.68%, 12/12/2023 ¹	108.803	0,17
370.000.000	USD	Swedbank AB, FRN, 5.72%, 28/12/2023	370.000	0,57
		Schweden - Gesamt	676.744	1,04
Schweiz (30. September 2022: 0,62 %)				
189.000.000	USD	UBS AG, 5.99%, 31/05/2024 ¹	181.720	0,28
		Schweiz - Gesamt	181.720	0,28
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 1,68 %)				
118.000.000	USD	HSBC Bank plc, FRN, 5.74%, 26/01/2024	118.000	0,18
242.000.000	USD	Lloyds Bank plc, 5.40%, 10/10/2023 ¹	241.716	0,37
52.000.000	USD	Lloyds Bank plc, 5.69%, 15/12/2023 ¹	51.409	0,08
100.000.000	USD	Lloyds Bank plc, 5.80%, 01/03/2024 ¹	97.639	0,15
616.000.000	USD	Standard Chartered Bank, 5.32%, 05/10/2023 ¹	615.727	0,95
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	1.124.491	1,73
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 2,64 %)				
245.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc., 5.80%, 22/03/2024 ¹	238.410	0,37
351.000.000	USD	Erste Finance (Delaware) LLC, 5.34%, 04/10/2023 ¹	350.896	0,54

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
183.075.000	USD	GTA Funding LLC, 5.33%, 02/10/2023 ¹	183.075	0,28
166.000.000	USD	ING US Funding LLC, FRN, 5.85%, 01/04/2024	166.000	0,25
125.000.000	USD	ING US Funding LLC, 5.43%, 08/11/2023 ¹	124.322	0,19
750.000.000	USD	Microsoft Corp., 5.33%, 23/10/2023 ¹	747.681	1,15
360.000.000	USD	Microsoft Corp., 5.39%, 09/11/2023 ¹	357.967	0,55
200.000.000	USD	Microsoft Corp., 5.51%, 02/01/2024 ¹	197.225	0,30
418.000.000	USD	Microsoft Corp., 5.51%, 03/01/2024 ¹	412.136	0,63
		Vereinigte Staaten - Gesamt	2.777.712	4,26
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			26.133.271	40,11
Termineinlagen (30. September 2022: 15,48 %)				
Australien (30. September 2022: 0,94 %)				
200.000.000	USD	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 5.32%, 02/10/2023	200.000	0,31
		Australien - Gesamt	200.000	0,31
Belgien (30. September 2022: 0,00 %)				
200.000.000	USD	KBC Bank NV, 5.32%, 02/10/2023	200.000	0,31
		Belgien - Gesamt	200.000	0,31
Kanada (30. September 2022: 4,21 %)				
2.714.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 5.32%, 02/10/2023	2.714.000	4,16
		Kanada - Gesamt	2.714.000	4,16
Frankreich (30. September 2022: 1,31 %)				
26.000.000	USD	Credit Agricole SA, 5.30%, 02/10/2023	26.000	0,04
		Frankreich - Gesamt	26.000	0,04
Japan (30. September 2022: 1,33 %)				
			-	-
Niederlande (30. September 2022: 2,39 %)				
650.000.000	USD	ABN AMRO Bank NV, 5.31%, 02/10/2023	650.000	1,00
		Niederlande - Gesamt	650.000	1,00
Schweden (30. September 2022: 5,30 %)				
1.950.000.000	USD	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 5.32%, 02/10/2023	1.950.000	2,99
1.073.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, 5.30%, 02/10/2023	1.073.000	1,65
		Schweden - Gesamt	3.023.000	4,64
Vereinigte Arabische Emirate (30. September 2022: 0,00 %)				
2.907.000.000	USD	First Abu Dhabi Bank USA NV, 5.32%, 02/10/2023	2.907.000	4,46
		Vereinigte Arabische Emirate - Gesamt	2.907.000	4,46
Anlagen in Termineinlagen - Gesamt			9.720.000	14,92

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30 September 2023

Bestand	Währung	Anlagen			Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN						
Staatsanleihen (30. September 2022: 0,00 %)						
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,00 %)						
402.000.000	USD	US Treasury, FRN, 5.44%, 31/10/2023			401.999	0,62
418.244.300	USD	US Treasury Bill, 5.27%, 19/10/2023 ¹			417.215	0,64
		Vereinigte Staaten - Gesamt			819.214	1,26
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt					819.214	1,26
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2022: 0,46 %)						
Luxemburg (30. September 2022: 0,00 %)						
270.000.000	USD	SG Issuer SA, 0.00%, 05/01/2024 ²			270.000	0,42
		Luxemburg - Gesamt			270.000	0,42
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,46 %)						
137.910.000	USD	Bank of America NA, 5.44%, 06/02/2024			137.910	0,21
124.000.000	USD	Bank of America NA, FRN, 5.58%, 01/04/2024			124.000	0,19
		Vereinigte Staaten - Gesamt			261.910	0,40
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt					531.910	0,82
Anlagen in Anleihen - Gesamt					1.351.124	2,08
Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2022: 19,11 %)						
Kanada (30. September 2022: 0,00 %)						
300.000.000	USD	Royal Bank of Canada	5,30 %	02.10.2023	300.000	0,46
		Kanada - Gesamt			300.000	0,46
Frankreich (30. September 2022: 0,00 %)						
725.000.000	USD	BNP Paribas SA	5,29 %	02.10.2023	725.000	1,11
500.000.000	USD	BNP Paribas SA	5,30 %	02.10.2023	500.000	0,77
5.000.000	USD	Credit Agricole SA	5,30 %	02.10.2023	5.000	0,01
		Frankreich - Gesamt			1.230.000	1,89
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 19,11 %)						
1.823.100.000	USD	Bofa Securities Inc.	5,30 %	02.10.2023	1.823.100	2,80
1.010.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	5,30 %	02.10.2023	1.010.000	1,55
3.637.000.000	USD	J.P. Morgan Securities LLC	5,31 %	02.10.2023	3.637.000	5,58
1.380.000.000	USD	Wells Fargo Securities LLC	5,31 %	02.10.2023	1.380.000	2,12
		Vereinigte Staaten - Gesamt			7.850.100	12,05
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					9.380.100	14,40

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30 September 2023

	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	66.497.896	102,08
Zahlungsmittel	1.948.269	2,99
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	(3.300.133)	(5,07)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert	65.146.032	100,00

Analyse des Gesamtvermögens

	% des Gesamt- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind	0,59
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	15,05
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)	81,28
Sonstige Vermögenswerte	3,08
Gesamtvermögen	100,00

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

²Nullkupon-Anleihe

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Bankakzepte (30. September 2022: 2,60 %)				
Kanada (30. September 2022: 2,60 %)				
24.000.000	CAD	Bank of Nova Scotia (The), 5.40%, 04/12/2023 ¹	17.587	0,39
30.000.000	CAD	National Bank of Canada, 5.10%, 13/10/2023 ¹	22.152	0,49
22.213.000	CAD	National Bank of Canada, 5.28%, 01/12/2023 ¹	16.288	0,36
22.500.000	CAD	Royal Bank of Canada, 5.14%, 10/10/2023 ¹	16.621	0,37
30.000.000	CAD	Royal Bank of Canada, 5.02%, 18/10/2023 ¹	22.137	0,49
40.000.000	CAD	Royal Bank of Canada, 5.31%, 04/12/2023 ¹	29.317	0,65
		Kanada - Gesamt	124.102	2,75
Anlagen in Bankakzepten - Gesamt			124.102	2,75
Einlagenzertifikate (30. September 2022: 22,34 %)				
Australien (30. September 2022: 0,57 %)				
15.000.000	USD	Commonwealth Bank of Australia, 5.89%, 28/08/2024 ¹	14.230	0,32
15.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.83%, 26/04/2024	15.013	0,33
10.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 5.34%, 16/02/2024	9.984	0,22
		Australien - Gesamt	39.227	0,87
Belgien (30. September 2022: 0,00 %)				
22.000.000	USD	Euroclear Bank SA, 5.67%, 18/01/2024 ¹	21.634	0,48
18.000.000	USD	KBC Bank NV, 5.73%, 23/02/2024 ¹	17.583	0,39
		Belgien - Gesamt	39.217	0,87
Kanada (30. September 2022: 5,88 %)				
10.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.00%, 06/10/2023	9.999	0,22
10.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.40%, 13/10/2023	9.999	0,22
15.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.34%, 22/11/2023 ¹	14.880	0,33
15.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.68%, 07/02/2024 ¹	14.697	0,33
10.300.000	USD	Bank of Montreal, 5.82%, 01/04/2024	10.302	0,23
12.495.000	USD	Bank of Montreal, 5.93%, 12/04/2024	12.500	0,28
10.000.000	USD	Bank of Montreal, 5.87%, 03/07/2024 ¹	9.562	0,21
10.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), 5.82%, 13/06/2024	9.990	0,22
10.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.23%, 02/02/2024	9.983	0,22
10.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.40%, 08/02/2024	9.991	0,22
27.020.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.94%, 12/04/2024	27.038	0,60
40.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.80%, 07/06/2024	39.955	0,89
10.000.000	USD	Royal Bank of Canada, FRN, 5.84%, 11/04/2024	10.008	0,22
15.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.20%, 11/10/2023	14.998	0,33
27.500.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.33%, 06/02/2024	27.449	0,61
12.910.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.52%, 22/02/2024	12.896	0,29
16.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.55%, 27/02/2024 ¹	15.621	0,35
10.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.96%, 12/04/2024 ¹	9.691	0,22
21.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.52%, 22/05/2024 ¹	20.216	0,45
5.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 5.97%, 26/08/2024 ¹	4.738	0,11
		Kanada - Gesamt	294.513	6,55
Finnland (30. September 2022: 0,69 %)				
20.000.000	USD	OP Corporate Bank plc, 5.39%, 08/02/2024 ¹	19.601	0,44
		Finnland - Gesamt	19.601	0,44
Frankreich (30. September 2022: 1,97 %)				
20.000.000	USD	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.84%, 11/03/2024 ¹	19.501	0,43
15.000.000	USD	BNP Paribas SA, 5.35%, 16/11/2023	14.996	0,33
31.850.000	USD	BNP Paribas SA, 5.70%, 04/03/2024	31.837	0,71
20.000.000	USD	Credit Agricole SA, 5.66%, 04/01/2024 ¹	19.701	0,44
20.000.000	USD	Credit Agricole SA, 5.74%, 05/01/2024 ¹	19.697	0,44

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
40.000.000	USD	Credit Agricole SA, 5.57%, 23/02/2024 ¹	39.087	0,87
		Frankreich - Gesamt	144.819	3,22
Deutschland (30. September 2022: 0,75 %)				
25.500.000	USD	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 5.30%, 26/01/2024	25.451	0,57
		Deutschland - Gesamt	25.451	0,57
Japan (30. September 2022: 2,64 %)				
30.000.000	USD	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 5.41%, 01/11/2023 ¹	29.849	0,66
25.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.53%, 23/10/2023 ¹	24.910	0,56
10.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.71%, 22/01/2024 ¹	9.822	0,22
20.040.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.80%, 29/01/2024	20.047	0,45
15.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 5.53%, 21/02/2024	14.957	0,33
28.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN, 5.73%, 07/02/2024	28.010	0,62
		Japan - Gesamt	127.595	2,84
Niederlande (30. September 2022: 1,26 %)				
36.000.000	USD	ABN AMRO Bank NV, 5.78%, 02/01/2024 ¹	35.471	0,79
20.000.000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, 5.18%, 01/02/2024	19.970	0,45
28.000.000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, 5.94%, 11/09/2024 ¹	26.472	0,59
30.000.000	USD	ING Bank NV, 5.39%, 08/02/2024 ¹	29.381	0,65
25.000.000	USD	ING Bank NV, 5.83%, 04/03/2024 ¹	24.382	0,54
		Niederlande - Gesamt	135.676	3,02
Norwegen (30. September 2022: 0,33 %)				
6.770.000	USD	DNB Bank ASA, 5.63%, 14/12/2023	6.772	0,15
8.230.000	USD	DNB Bank ASA, 5.65%, 20/12/2023	8.233	0,18
24.000.000	USD	DNB Bank ASA, 5.27%, 07/02/2024 ¹	23.518	0,53
20.000.000	USD	DNB Bank ASA, 5.91%, 27/08/2024 ¹	18.957	0,42
		Norwegen - Gesamt	57.480	1,28
Singapur (30. September 2022: 0,69 %)				
			-	-
Südkorea (30. September 2022: 0,80 %)				
19.000.000	USD	KEB Hana Bank, 5.87%, 22/01/2024 ¹	18.658	0,41
39.000.000	USD	KEB Hana Bank, 6.03%, 27/02/2024 ¹	38.077	0,85
9.000.000	USD	Korea Development Bank, 5.60%, 01/12/2023 ¹	8.914	0,20
		Südkorea - Gesamt	65.649	1,46
Spanien (30. September 2022: 1,04 %)				
			-	-
Schweden (30. September 2022: 0,92 %)				
18.948.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.67%, 25/10/2023	18.951	0,42
13.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.85%, 19/04/2024	13.012	0,29
35.170.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.87%, 29/04/2024	35.208	0,79
		Schweden - Gesamt	67.171	1,50
Schweiz (30. September 2022: 1,49 %)				
20.000.000	USD	UBS AG, 5.35%, 05/10/2023 ¹	19.982	0,45
25.000.000	USD	UBS AG, 5.37%, 03/11/2023 ¹	24.869	0,55
		Schweiz - Gesamt	44.851	1,00

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (Fortsetzung)				
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 2,62 %)				
15.000.000	USD	Barclays Bank plc, FRN, 6.20%, 22/11/2023	15.016	0,33
20.000.000	USD	Barclays Bank plc, 5.55%, 07/02/2024	19.974	0,45
10.000.000	USD	Barclays Bank plc, 5.70%, 16/02/2024	9.991	0,22
25.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 5.47%, 11/12/2023 ¹	24.723	0,55
22.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 5.67%, 08/01/2024 ¹	21.657	0,48
20.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 5.62%, 16/01/2024 ¹	19.663	0,44
20.000.000	USD	Lloyds Bank plc, 5.24%, 12/10/2023	19.998	0,45
18.000.000	USD	National Westminster Bank plc, 5.84%, 19/01/2024 ¹	17.687	0,39
Vereinigtes Königreich - Gesamt			148.709	3,31
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,69 %)				
11.150.000	USD	Bank of America NA, 6.00%, 21/08/2024	11.151	0,25
5.670.000	USD	Bank of America NA, 6.00%, 23/09/2024	5.670	0,13
13.900.000	USD	Citibank NA, 5.80%, 26/02/2024	13.904	0,31
5.630.000	USD	Citibank NA, 5.88%, 08/05/2024	5.630	0,13
23.340.000	USD	HSBC Bank plc, 5.90%, 09/05/2024	23.342	0,52
6.500.000	USD	HSBC Bank plc, 5.90%, 06/06/2024	6.499	0,14
3.310.000	USD	HSBC Bank plc, 5.97%, 16/08/2024	3.318	0,07
10.000.000	USD	State Street Bank & Trust Co., FRN, 5.82%, 28/03/2024	10.007	0,22
27.400.000	USD	Wells Fargo Bank NA, FRN, 5.81%, 22/01/2024	27.421	0,61
25.000.000	USD	Wells Fargo Bank NA, FRN, 5.95%, 08/07/2024	25.023	0,56
Vereinigte Staaten - Gesamt			131.965	2,94
Anlagen in Einlagenzertifikaten - Gesamt			1.341.924	29,87
Commercial Papers (30. September 2022: 62,76 %)				
Australien (30. September 2022: 5,90 %)				
5.000.000	USD	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 5.57%, 01/11/2023 ¹	4.975	0,11
12.000.000	USD	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 5.37%, 20/11/2023 ¹	11.904	0,27
7.000.000	USD	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 5.32%, 22/11/2023 ¹	6.942	0,15
15.400.000	USD	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 5.45%, 01/12/2023 ¹	15.256	0,34
11.800.000	USD	Commonwealth Bank of Australia, FRN, 5.81%, 18/03/2024	11.810	0,26
43.250.000	USD	Commonwealth Bank of Australia, 5.84%, 26/07/2024 ¹	41.245	0,92
12.500.000	USD	Macquarie Bank Ltd., FRN, 5.96%, 09/01/2024	12.511	0,28
20.000.000	USD	Macquarie Bank Ltd., 5.54%, 12/02/2024 ¹	19.574	0,44
22.000.000	USD	Macquarie Bank Ltd., 5.91%, 13/05/2024 ¹	21.211	0,47
24.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.66%, 25/10/2023	24.004	0,53
12.200.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.81%, 12/04/2024	12.209	0,27
10.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., FRN, 5.93%, 14/06/2024	10.014	0,22
12.700.000	USD	Suncorp-Metway Ltd., 5.66%, 09/11/2023 ¹	12.618	0,28
12.250.000	USD	Suncorp-Metway Ltd., 5.83%, 30/01/2024 ¹	12.005	0,27
10.000.000	USD	Toyota Finance Australia Ltd., 5.66%, 05/02/2024 ¹	9.801	0,22
12.000.000	USD	Toyota Finance Australia Ltd., 5.75%, 08/03/2024 ¹	11.700	0,26
7.194.000	USD	Westpac Banking Corp., 5.20%, 04/01/2024 ¹	7.089	0,16
Australien - Gesamt			244.868	5,45
Bermuda (30. September 2022: 0,76 %)				
10.000.000	USD	Brookfield Renewable Partners LP, 5.93%, 03/10/2023 ¹	9.994	0,22
Bermuda - Gesamt			9.994	0,22
Kanada (30. September 2022: 9,87 %)				
14.750.000	USD	Bank of Montreal, 5.98%, 30/07/2024 ¹	14.047	0,31
45.220.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), 5.77%, 28/02/2024 ¹	44.164	0,98
35.000.000	USD	Brookfield Corporate Treasury Ltd., 5.73%, 02/10/2023 ¹	34.984	0,78
19.500.000	USD	Brookfield Corporate Treasury Ltd., 5.73%, 04/10/2023 ¹	19.485	0,43
37.250.000	USD	Brookfield Corporate Treasury Ltd., 5.82%, 05/10/2023 ¹	37.216	0,83

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2023

Bestand	Wahrung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Kanada (Fortsetzung)				
15.000.000	USD	CDP Financial, Inc., FRN, 6.12%, 01/11/2023	15.008	0,34
6.796.000	USD	CDP Financial, Inc., 5.32%, 12/01/2024 ¹	6.688	0,15
1.792.000	USD	CDP Financial, Inc., 5.82%, 07/06/2024 ¹	1.722	0,04
20.000.000	USD	CDP Financial, Inc., 5.77%, 08/08/2024 ¹	19.015	0,42
10.000.000	USD	Federation des Caisses Desjardins du Quebec (The), 5.76%, 12/01/2024 ¹	9.839	0,22
14.450.000	CAD	Honda Canada Finance, Inc., 5.29%, 09/11/2023 ¹	10.626	0,24
25.400.000	CAD	Honda Canada Finance, Inc., 5.25%, 04/01/2024 ¹	18.527	0,41
20.000.000	CAD	Honda Canada Finance, Inc., 5.35%, 30/01/2024 ¹	14.532	0,32
19.467.000	CAD	Hydro One, Inc., 5.21%, 02/11/2023 ¹	14.330	0,32
11.000.000	USD	Nutrien Ltd., 5.67%, 18/10/2023 ¹	10.968	0,25
36.850.000	USD	Ontario Teachers' Finance Trust, 5.79%, 06/05/2024 ¹	35.601	0,79
10.000.000	USD	PSP Capital, Inc., 5.27%, 13/11/2023 ¹	9.933	0,22
20.000.000	CAD	Sumitomo Canada Ltd., 5.04%, 16/10/2023 ¹	14.757	0,33
		Kanada - Gesamt	331.442	7,38
		Danemark (30. September 2022: 0,34 %)	-	-
		Finnland (30. September 2022: 1,19 %)		
7.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 5.61%, 08/01/2024 ¹	6.894	0,15
22.000.000	USD	OP Corporate Bank plc, 5.69%, 05/01/2024 ¹	21.678	0,48
25.000.000	USD	OP Corporate Bank plc, 5.42%, 09/02/2024 ¹	24.497	0,55
		Finnland - Gesamt	53.069	1,18
		Frankreich (30. September 2022: 4,87 %)		
13.550.000	USD	BPCE SA, 5.93%, 28/05/2024 ¹	13.035	0,29
7.000.000	USD	BPCE SA, 5.96%, 15/07/2024 ¹	6.682	0,15
45.000.000	USD	BRED Banque Populaire, 5.73%, 02/01/2024 ¹	44.353	0,99
10.154.000	USD	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 5.23%, 09/02/2024 ¹	9.951	0,22
4.169.000	USD	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 5.28%, 12/02/2024 ¹	4.084	0,09
24.400.000	USD	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 5.78%, 21/03/2024 ¹	23.755	0,53
32.800.000	USD	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 5.76%, 09/05/2024 ¹	31.678	0,70
12.300.000	USD	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 5.43%, 17/05/2024 ¹	11.864	0,26
20.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 5.61%, 05/12/2023 ¹	19.792	0,44
10.997.000	USD	Sanofi, 5.64%, 08/04/2024 ¹	10.674	0,24
5.000.000	USD	Satellite, 4.85%, 12/10/2023 ¹	4.990	0,11
1.000.000	USD	Satellite, 4.85%, 18/10/2023 ¹	997	0,02
10.000.000	USD	Societe Generale SA, 5.46%, 12/02/2024 ¹	9.787	0,22
		Frankreich - Gesamt	191.642	4,26
		Deutschland (30. September 2022: 3,10 %)		
54.320.000	USD	BASF SE, 5.49%, 02/10/2023 ¹	54.296	1,21
10.500.000	USD	E.On SE, 5.12%, 11/10/2023 ¹	10.481	0,23
18.250.000	USD	FMS Wertmanagement, 5.69%, 02/05/2024 ¹	17.647	0,39
18.000.000	USD	FMS Wertmanagement, 5.69%, 03/05/2024 ¹	17.403	0,39
10.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 5.29%, 27/02/2024 ¹	9.771	0,22
19.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 5.72%, 02/05/2024 ¹	18.360	0,41
24.000.000	USD	NRW. Bank, 5.21%, 24/11/2023 ¹	23.800	0,53
22.000.000	USD	NRW. Bank, 5.59%, 12/02/2024 ¹	21.548	0,48
17.000.000	USD	NRW. Bank, 5.64%, 01/03/2024 ¹	16.603	0,37
		Deutschland - Gesamt	189.909	4,23

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
		Hongkong (30. September 2022: 0,76 %)	-	-
		Irland (30. September 2022: 0,67 %)	-	-
		Japan (30. September 2022: 0,60 %)	-	-
		Luxemburg (30. September 2022: 0,00 %)		
15.000.000	USD	Banque et Caisse d'Epargne de l'Etat, 5.64%, 12/02/2024 ¹	14.685	0,33
		Luxemburg - Gesamt	14.685	0,33
		Neuseeland (30. September 2022: 0,66 %)		
17.060.000	USD	ANZ New Zealand Int'l Ltd., 5.31%, 09/11/2023 ¹	16.955	0,38
12.898.000	USD	ANZ New Zealand Int'l Ltd., 5.28%, 15/11/2023 ¹	12.807	0,28
19.250.000	USD	ANZ New Zealand Int'l Ltd., 5.86%, 17/06/2024 ¹	18.475	0,41
10.000.000	USD	Westpac Securities NZ Ltd., 5.58%, 23/02/2024 ¹	9.801	0,22
		Neuseeland - Gesamt	58.038	1,29
		Norwegen (30. September 2022: 1,14 %)		
4.250.000	USD	DNB Bank ASA, 5.86%, 22/05/2024 ¹	4.094	0,09
34.840.000	USD	DNB Bank ASA, 5.94%, 30/07/2024 ¹	33.190	0,74
		Norwegen - Gesamt	37.284	0,83
		Singapur (30. September 2022: 0,92 %)		
19.810.000	USD	Hitachi International Treasury Ltd., 5.43%, 02/10/2023 ¹	19.801	0,44
		Singapur - Gesamt	19.801	0,44
		Südkorea (30. September 2022: 0,67 %)		
16.245.000	USD	Korea Development Bank, 5.36%, 06/10/2023 ¹	16.228	0,36
		Südkorea - Gesamt	16.228	0,36
		Spanien (30. September 2022: 0,23 %)		
57.980.000	USD	Banco Santander SA, 5.87%, 01/02/2024 ¹	56.862	1,27
		Spanien - Gesamt	56.862	1,27
		Schweden (30. September 2022: 2,63 %)		
7.000.000	USD	Kommuninvest I Sverige Ab, 0.00%, 03/07/2024 ¹	6.708	0,15
		Schweden - Gesamt	6.708	0,15
		Schweiz (30. September 2022: 1,15 %)		
17.000.000	USD	UBS AG, 5.97%, 26/06/2024 ¹	16.269	0,36
		Schweiz - Gesamt	16.269	0,36
		Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 3,09 %)		
10.000.000	USD	HSBC Bank plc, FRN, 6.17%, 01/11/2023	10.006	0,22
9.000.000	USD	LSEGA Financing plc, 5.60%, 23/10/2023 ¹	8.967	0,20
3.500.000	USD	LSEGA Financing plc, 5.54%, 03/11/2023 ¹	3.481	0,08
15.000.000	USD	NatWest Markets plc, 5.89%, 20/05/2024 ¹	14.441	0,32
40.000.000	USD	Sumitomo Corp. Capital Europe plc, 4.96%, 19/10/2023 ¹	39.879	0,89
40.000.000	USD	Sumitomo Corp. Capital Europe plc, 5.14%, 23/10/2023 ¹	39.855	0,89
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	116.629	2,60
		Vereinigte Staaten (30. September 2022: 24,21 %)		
10.955.000	USD	ABN AMRO Funding USA LLC, 5.22%, 13/10/2023 ¹	10.932	0,24

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
8.065.000	USD	Amazon.com, Inc., 5.24%, 06/11/2023 ¹	8.021	0,18
3.963.000	USD	Amazon.com, Inc., 5.19%, 13/11/2023 ¹	3.937	0,09
8.037.000	USD	Amazon.com, Inc., 5.19%, 16/11/2023 ¹	7.982	0,18
18.750.000	USD	American Honda Finance Corp., 5.54%, 10/10/2023 ¹	18.719	0,42
22.250.000	USD	American Honda Finance Corp., 5.67%, 18/10/2023 ¹	22.186	0,49
70.000.000	USD	AutoZone, Inc., 5.41%, 04/10/2023 ¹	69.948	1,56
25.000.000	USD	BofA Securities, Inc., 5.72%, 03/11/2023 ¹	24.868	0,55
8.720.000	USD	Brighthouse Financial Short Term Funding LLC, 5.36%, 16/10/2023 ¹	8.698	0,19
4.413.000	USD	Brighthouse Financial Short Term Funding LLC, 5.42%, 14/11/2023 ¹	4.383	0,10
15.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc., 5.52%, 27/11/2023 ¹	14.865	0,33
15.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc., 5.43%, 08/01/2024 ¹	14.768	0,33
46.650.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc., 5.80%, 06/06/2024 ¹	44.806	1,00
25.000.000	USD	Columbia Funding Co. LLC, 5.81%, 01/02/2024 ¹	24.514	0,55
13.500.000	USD	Daimler Truck Finance North America LLC, 5.53%, 16/10/2023 ¹	13.462	0,30
9.500.000	USD	Dollar Tree, Inc., 5.48%, 05/10/2023 ¹	9.491	0,21
35.000.000	USD	Enterprise Products Operating LLC, 0.00%, 02/10/2023	34.984	0,78
3.750.000	USD	Eversource Energy, 5.33%, 10/10/2023 ¹	3.744	0,08
5.670.000	USD	Fidelity National Information Services, Inc., 5.57%, 10/10/2023 ¹	5.661	0,13
12.000.000	USD	GlaxoSmithKline LLC, 5.32%, 06/11/2023 ¹	11.932	0,26
14.706.000	USD	HSBC USA, Inc., 5.43%, 17/10/2023 ¹	14.667	0,33
8.027.000	USD	HSBC USA, Inc., 5.39%, 01/11/2023 ¹	7.987	0,18
5.000.000	USD	Hyundai Capital America, Inc., 5.50%, 26/10/2023 ¹	4.979	0,11
8.930.000	USD	ING US Funding LLC, 5.90%, 07/06/2024 ¹	8.577	0,19
25.000.000	USD	J.P. Morgan Securities LLC, 5.79%, 25/03/2024 ¹	24.303	0,54
8.870.000	USD	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 5.83%, 23/09/2024 ¹	8.382	0,19
22.677.000	USD	Marriott International, Inc., 5.52%, 06/10/2023 ¹	22.652	0,50
10.000.000	USD	Microchip Technology, Inc., 5.48%, 23/10/2023 ¹	9.962	0,22
8.500.000	USD	Mitsubishi HC Finance America LLC, 5.62%, 02/10/2023 ¹	8.496	0,19
34.500.000	USD	NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 5.55%, 11/10/2023 ¹	34.437	0,77
45.000.000	USD	NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 5.55%, 16/10/2023 ¹	44.884	1,00
28.677.000	USD	Novartis Finance Corp., 5.33%, 02/10/2023 ¹	28.664	0,64
23.250.000	USD	Nutrien Financial US LLC, 5.60%, 06/10/2023 ¹	23.225	0,52
10.500.000	USD	Penske Truck Leasing Co. LP, 5.54%, 02/10/2023 ¹	10.495	0,23
27.000.000	USD	Penske Truck Leasing Co. LP, 5.51%, 03/10/2023 ¹	26.983	0,60
18.680.000	USD	Penske Truck Leasing Co. LP, 5.51%, 10/10/2023 ¹	18.648	0,41
15.500.000	USD	Penske Truck Leasing Co. LP, 5.54%, 13/10/2023 ¹	15.466	0,34
11.500.000	USD	Penske Truck Leasing Co. LP, 5.54%, 20/10/2023 ¹	11.462	0,25
22.830.000	USD	Prcoa Short Term Funding LLC, 5.19%, 18/10/2023 ¹	22.766	0,51
5.317.000	USD	Procter & Gamble Co. (The), 5.23%, 24/10/2023 ¹	5.298	0,12
17.630.000	USD	Ryder System, Inc., 5.52%, 06/10/2023 ¹	17.611	0,39
14.250.000	USD	Ryder System, Inc., 5.57%, 16/10/2023 ¹	14.213	0,32
30.060.000	USD	Sony Capital Corp., 5.51%, 02/10/2023 ¹	30.046	0,67
15.000.000	USD	Sony Capital Corp., 5.46%, 03/10/2023 ¹	14.991	0,33
25.000.000	USD	Sony Capital Corp., 5.46%, 04/10/2023 ¹	24.981	0,56
10.050.000	USD	Sony Capital Corp., 5.47%, 05/10/2023 ¹	10.041	0,22
31.445.000	USD	Spire, Inc., 5.56%, 10/10/2023 ¹	31.393	0,70
24.800.000	USD	Spire, Inc., 5.56%, 18/10/2023 ¹	24.728	0,55
10.000.000	USD	Spire, Inc., 5.64%, 03/11/2023 ¹	9.946	0,22
12.200.000	USD	Toyota Industries Commercial Finance, Inc., 5.41%, 26/01/2024 ¹	11.981	0,27
4.540.000	USD	Toyota Industries Commercial Finance, Inc., 5.20%, 05/02/2024 ¹	4.452	0,10
15.250.000	USD	Versailles Assets LLC, 5.81%, 02/01/2024 ¹	15.026	0,33
38.860.000	USD	Volvo Treasury North America LP, 0.00%, 26/10/2023	38.699	0,86
11.000.000	USD	Vulcan Materials Co., 5.54%, 10/10/2023 ¹	10.982	0,24
40.000.000	USD	Western Union Co. (The), 5.50%, 02/10/2023 ¹	39.982	0,89
		Vereinigte Staaten - Gesamt	1.009.306	22,46
		Anlagen in Commercial Papers - Gesamt	2.372.734	52,81

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Staatsanleihen (30. September 2022: 0,00 %)				
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 0,00 %)				
49.000.000	USD	US Treasury Bill, 5.28%, 10/10/2023 ¹	48.943	1,09
23.000.000	USD	US Treasury Bill, 5.40%, 16/01/2024 ¹	22.639	0,51
		Vereinigte Staaten - Gesamt	71.582	1,60
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt			71.582	1,60
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2022: 6,15 %)				
Australien (30. September 2022: 0,44 %)				
25.202.000	USD	Westpac Banking Corp., 5.65%, 18/11/2024	25.127	0,56
		Australien - Gesamt	25.127	0,56
Kanada (30. September 2022: 1,26 %)				
			-	-
Frankreich (30. September 2022: 0,04 %)				
15.000.000	USD	Societe Generale SA, FRN, 6.41%, 29/09/2025	15.000	0,34
		Frankreich - Gesamt	15.000	0,34
Japan (30. September 2022: 0,00 %)				
3.620.000	USD	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 3.41%, 07/03/2024	3.580	0,08
10.039.000	USD	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 2.80%, 18/07/2024	9.793	0,22
29.650.000	CAD	MUFG Bank Ltd., 0.00%, 14/12/2023 ²	21.689	0,48
30.000.000	CAD	MUFG Bank Ltd., 0.00%, 18/01/2024 ²	21.830	0,49
4.134.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.85%, 25/03/2024	4.036	0,09
		Japan - Gesamt	60.928	1,36
Niederlande (30. September 2022: 0,00 %)				
12.200.000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 6.08%, 18/07/2025	12.221	0,27
		Niederlande - Gesamt	12.221	0,27
Südkorea (30. September 2022: 0,23 %)				
			-	-
Schweiz (30. September 2022: 0,00 %)				
10.850.000	USD	UBS AG, FRN, 6.27%, 11/09/2025	10.854	0,24
		Schweiz - Gesamt	10.854	0,24
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 4,18 %)				
25.000.000	USD	Bank of America NA, 5.25%, 31/01/2024	24.941	0,55
22.985.000	USD	Bank of America NA, 5.44%, 06/02/2024	22.947	0,51
9.565.000	USD	Florida Power & Light Co., FRN, 5.75%, 12/01/2024	9.564	0,21
19.865.000	USD	John Deere Capital Corp., FRN, 5.86%, 03/07/2025	19.889	0,44
34.800.000	USD	Mercedes-Benz Finance North America LLC, FRN, 5.93%, 01/08/2025	34.800	0,78
6.400.000	USD	Metropolitan Life Global Funding I, FRN, 5.70%, 07/01/2024	6.400	0,14
19.188.000	USD	Morgan Stanley, FRN, 5.82%, 25/01/2024	19.184	0,43
10.955.000	USD	Morgan Stanley Bank NA, FRN, 6.15%, 16/07/2025	10.965	0,24
14.200.000	USD	New York Life Global Funding, FRN, 6.02%, 13/06/2025	14.234	0,32
12.000.000	USD	Northwestern Mutual Global Funding, FRN, 6.02%, 13/06/2025	12.010	0,27
15.000.000	USD	Toyota Motor Credit Corp., FRN, 5.96%, 29/12/2023	15.011	0,33
4.535.000	USD	Toyota Motor Credit Corp., FRN, 5.70%, 22/02/2024	4.534	0,10
9.815.000	USD	Toyota Motor Credit Corp., FRN, 5.94%, 13/06/2024	9.827	0,22

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
		Vereinigte Staaten (Fortsetzung)		
29.590.000	USD	Wells Fargo Bank NA, FRN, 6.15%, 01/08/2025	29.645	0,66
		Vereinigte Staaten - Gesamt	233.951	5,20
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt			358.081	7,97
Anlagen in Anleihen - Gesamt			429.663	9,57

Beschreibung	Kontrahent	Fälligkeits- Termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Devisenterminkontrakte:				
Buy USD 22,147,177; Sell CAD 29,895,300	NatWest Markets plc	13.10.2023	32	-
Buy USD 77,563; Sell CAD 104,700 ₄	Citibank	13.10.2023	-	-
Buy USD 14,974,770; Sell CAD 19,742,000	Barclays	16.10.2023	370	0,01
Buy USD 195,715; Sell CAD 258,000	Citibank	16.10.2023	5	-
Buy USD 22,308,002; Sell CAD 29,878,200	NatWest Markets plc	18.10.2023	204	0,01
Buy USD 90,939; Sell CAD 121,800	Toronto-Dominion Bank	18.10.2023	1	-
Buy USD 10,581,298; Sell CAD 14,257,093	NatWest Markets plc	09.11.2023	31	-
Buy USD 143,145; Sell CAD 192,907 ₄	State Street	09.11.2023	-	-
Buy USD 21,970,997; Sell CAD 29,650,000	Toronto-Dominion Bank	14.12.2023	15	-
Buy USD 14,832,564; Sell CAD 20,000,000	State Street	30.01.2024	11	-
Nicht realisierter Gewinn - Gesamt (30. September 2022: 0,50 %)			669	0,02
Anteilklasse Heritage (CHF Hedged)				
Buy CHF 637,244; Sell USD 693,213	State Street	03.10.2023	3	-
Buy USD 9,993,709; Sell CHF 8,874,539	State Street	03.10.2023	293	-
Nicht realisierter Gewinn - Gesamt (30. September 2022: 0,00 %)₅			296	-
Anteilklasse Heritage (SGD Hedged)				
Buy USD 183,958; Sell SGD 248,134	State Street	03.10.2023	3	-
Nicht realisierter Gewinn - Gesamt (30. September 2022: 0,00 %)₅			3	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2022: 0,50 %)			968	0,02

Devisenterminkontrakte:				
Buy USD 67,154; Sell CAD 91,125 ₄	Toronto-Dominion Bank	10.10.2023	-	-
Buy USD 16,514,283; Sell CAD 22,408,875	NatWest Markets plc	10.10.2023	(62)	-
Buy USD 14,269,110; Sell CAD 19,467,000	Toronto-Dominion Bank	02.11.2023	(136)	-
Buy USD 198,099; Sell CAD 269,888	Toronto-Dominion Bank	01.12.2023	(2)	-
Buy USD 16,106,280; Sell CAD 21,943,112	Citibank	01.12.2023	(138)	(0,01)
Buy USD 229,885; Sell CAD 312,480	Toronto-Dominion Bank	04.12.2023	(2)	-
Buy USD 371,582; Sell CAD 505,600	NatWest Markets plc	04.12.2023	(3)	-
Buy USD 17,426,772; Sell CAD 23,687,520	Citibank	04.12.2023	(109)	-
Buy USD 29,025,718; Sell CAD 39,494,400	State Street	04.12.2023	(212)	(0,01)

NM0124U-3356337-142/233

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30 September 2023

Beschreibung	Kontrahent	Fälligkeits-Termin	Zeitwert Tsd.USD	% des Nettoinventarwerts
Devisenterminkontrakte³ (Fortsetzung)				
Buy USD 489,998; Sell CAD 662,700	Goldman Sachs	18.01.2024	(1)	–
Buy USD 21,693,647; Sell CAD 29,337,300	State Street	18.01.2024	(44)	–
Nicht realisierter Verlust - Gesamt (30. September 2022: 0,00 %)			(709)	(0,02)

Anteilklasse Heritage (CHF Hedged)

Buy CHF 75,703,361; Sell USD 85,593,784	State Street	03.10.2023	(2.840)	(0,06)
Nicht realisierter Verlust - Gesamt (30. September 2022: (0,01) %)			(2.840)	(0,06)

Anteilklasse Heritage (SGD Hedged)

Buy SGD 9,230,583; Sell USD 6,843,628	State Street	03.10.2023	(80)	–
Nicht realisierter Verlust - Gesamt (30. September 2022: (0,01) %)			(80)	–

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2022: (0,02) %)

	Zeitwert Tsd. USD	% des Nettoinventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	4.269.391	95,02
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	(3.629)	(0,08)
Zahlungsmittel	23.288	0,52
Zahlungsmitteläquivalente		
Bestand Währung Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (30. September 2022: 4,44 %)		
199.013 USD BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Dis) ⁶	199.013	4,43
Zahlungsmitteläquivalente - Gesamt	199.013	4,43
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	5.012	0,11
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert	4.493.075	100,00

Analyse des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind	0,71
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	11,49
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)	81,89
Investmentfonds (CIS)	4,39
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,02
Sonstige Vermögenswerte	1,50
Gesamtvermögen	100,00

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

²Nullkupon-Anleihe

³Devisenterminkontrakte, die bei einem Kontrahenten mit der gleichen Kaufwährung, Verkaufswährung und Fälligkeit gehalten werden, werden gegebenenfalls als Summe ausgewiesen. Aktiv- und Passivpositionen werden nicht verrechnet.

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

⁵Prozentangabe des Nettoinventarwerts vom Vorjahr auf 0,00 % gerundet.

⁶Dem Fonds nahestehende Partei.

Derivative Finanzinstrumente

	Basisengagement TSD. USD
Devisenterminkontrakte	324.145

BLACKROCK ICS US TREASURY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Staatsanleihen (30. September 2022: 40,40 %)				
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 40,40 %)				
50.000.000	USD	US Treasury, FRN, 5.44%, 31/10/2023	50.004	0,22
574.165.000	USD	US Treasury, FRN, 5.39%, 31/01/2024	574.151	2,55
197.170.000	USD	US Treasury, FRN, 5.33%, 30/04/2024	197.108	0,87
2.020.000.000	USD	US Treasury, FRN, 5.44%, 31/07/2024	2.020.598	8,98
1.347.215.000	USD	US Treasury Bill, 5.30%, 03/10/2023 ¹	1.347.017	5,98
375.030.000	USD	US Treasury Bill, 5.31%, 05/10/2023 ¹	374.865	1,67
52.785.000	USD	US Treasury Bill, 5.30%, 10/10/2023 ¹	52.723	0,23
110.000.000	USD	US Treasury Bill, 5.30%, 17/10/2023 ¹	109.758	0,49
32.420.000	USD	US Treasury Bill, 5.32%, 19/10/2023 ¹	32.339	0,14
1.695.820.000	USD	US Treasury Bill, 5.30%, 24/10/2023 ¹	1.690.350	7,51
18.090.000	USD	US Treasury Bill, 5.31%, 26/10/2023 ¹	18.027	0,08
1.500.000.000	USD	US Treasury Bill, 5.32%, 02/11/2023 ¹	1.493.173	6,63
199.805.000	USD	US Treasury Bill, 5.36%, 09/11/2023 ¹	198.690	0,88
15.000.000	USD	US Treasury Bill, 5.33%, 14/11/2023 ¹	14.905	0,07
40.590.000	USD	US Treasury Bill, 5.39%, 05/12/2023 ¹	40.208	0,18
64.335.000	USD	US Treasury Bill, 5.69%, 14/12/2023 ¹	63.642	0,28
47.840.000	USD	US Treasury Bill, 5.34%, 21/12/2023 ¹	47.284	0,21
194.845.000	USD	US Treasury Bill, 5.36%, 28/12/2023 ¹	192.389	0,86
10.670.000	USD	US Treasury Bill, 5.41%, 11/01/2024 ¹	10.512	0,05
20.000	USD	US Treasury Bill, 4.91%, 25/01/2024 ¹	20	–
100.056.400	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 30/01/2024 ¹	98.289	0,44
32.130.000	USD	US Treasury Bill, 5.41%, 08/02/2024 ¹	31.524	0,14
268.440.000	USD	US Treasury Bill, 5.44%, 22/02/2024 ¹	262.796	1,17
47.815.000	USD	US Treasury Bill, 5.45%, 07/03/2024 ¹	46.710	0,21
297.905.500	USD	US Treasury Bill, 5.45%, 14/03/2024 ¹	290.713	1,29
40.050.000	USD	US Treasury Bill, 5.44%, 21/03/2024 ¹	39.042	0,17
1.000.000	USD	US Treasury Bill, 4.75%, 18/04/2024 ¹	975	–
68.200.000	USD	US Treasury Bill, 5.00%, 16/05/2024 ¹	66.151	0,29
83.080.000	USD	US Treasury Bill, 5.21%, 13/06/2024 ¹	80.168	0,36
81.500.000	USD	US Treasury Bill, 5.33%, 08/08/2024 ¹	77.937	0,35
52.360.000	USD	US Treasury Bill, 5.41%, 05/09/2024 ¹	49.829	0,22
Vereinigte Staaten - Gesamt			9.571.897	42,52
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt			9.571.897	42,52
Anlagen in Anleihen - Gesamt			9.571.897	42,52

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (30. September 2022: 56,04 %)						
Kanada (30. September 2022: 0,00 %)						
273.000.000	USD	Bank of Nova Scotia plc	5,28 %	02.10.2023	273.000	1,21
175.000.000	USD	Royal Bank of Canada	5,29 %	02.10.2023	175.000	0,78
1.350.000.000	USD	TD Securities (USA) LLC	5,30 %	02.10.2023	1.350.000	6,00
Kanada - Gesamt					1.798.000	7,99
Frankreich (30. September 2022: 0,00 %)						
2.760.000.000	USD	BNP Paribas SA	5,29 %	02.10.2023	2.760.000	12,26
103.000.000	USD	BNP Paribas SA	5,29 %	02.10.2023	103.000	0,46
1.550.000.000	USD	Credit Agricole SA	5,29 %	02.10.2023	1.550.000	6,89
135.000.000	USD	Credit Agricole SA	5,29 %	02.10.2023	135.000	0,60

BLACKROCK ICS US TREASURY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2023

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits-termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte (Fortsetzung)						
Frankreich (Fortsetzung)						
250.000.000	USD	Natixis SA	5,29 %	02.10.2023	250.000	1,11
1.975.000.000	USD	Societe Generale SA	5,28 %	02.10.2023	1.975.000	8,77
Frankreich - Gesamt					6.773.000	30,09
Vereinigtes Königreich (30. September 2022: 0,00 %)						
500.000.000	USD	Barclays Capital, Inc.	5,27 %	02.10.2023	500.000	2,22
Vereinigtes Königreich - Gesamt					500.000	2,22
Vereinigte Staaten (30. September 2022: 56,04 %)						
840.000.000	USD	Bofa Securities Inc.	5,29 %	02.10.2023	840.000	3,73
200.000.000	USD	Bofa Securities Inc.	5,29 %	02.10.2023	200.000	0,89
745.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	5,29 %	02.10.2023	745.000	3,31
50.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	5,29 %	02.10.2023	50.000	0,22
1.625.000.000	USD	Wells Fargo Securities LLC	5,29 %	02.10.2023	1.625.000	7,22
Vereinigte Staaten - Gesamt					3.460.000	15,37
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					12.531.000	55,67
					Zeitwert	% des Netto-
					Tsd. USD	inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					22.102.897	98,19
Zahlungsmittel					583.687	2,59
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					(176.751)	(0,78)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					22.509.833	100,00
Analyse des Gesamtvermögens						% des Gesamt-
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind						22,91
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						74,36
Sonstige Vermögenswerte						2,73
Gesamtvermögen						100,00

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

BLACKROCK EURO ULTRA SHORT CORE BOND FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
1.917.991	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Agency (Acc T0) Shares, 0.00%	189.000
35.000.000	Enel Finance America LLC, 0.00%, 17/01/2023	34.576
	DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main, FRN, 4.22%, 28/02/2025	
30.000.000		30.000
30.000.000	Toronto-Dominion Bank (The) Discount Notes, 4.19%, 18/09/2024	28.763
29.000.000	National Westminster Bank plc Discount Notes, 3.90%, 08/12/2023	28.513
25.000.000	Avery Dennison Treasury Management BV, 0.00%, 07/11/2022	24.978
25.000.000	Avery Dennison Treasury Management BV, 0.00%, 24/02/2023	24.962
25.000.000	Avery Dennison Treasury Management BV, 0.00%, 09/01/2023	24.918
25.000.000	Barclays Bank plc Discount Notes, 3.60%, 05/02/2024	24.113
24.000.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV, FRN, 4.17%, 28/05/2025	24.000
23.000.000	Universal Music Group NV, 0.00%, 07/11/2022	22.980
23.000.000	Mohawk Capital Luxembourg SA, 0.00%, 05/07/2023	22.932
23.000.000	Mohawk Capital Luxembourg SA, 0.00%, 05/06/2023	22.929
23.000.000	Universal Music Group NV, 0.00%, 06/01/2023	22.928
23.000.000	Mohawk Capital Luxembourg SA, 0.00%, 07/09/2023	22.923
23.000.000	Mohawk Capital Luxembourg SA, 0.00%, 07/08/2023	22.922
23.000.000	Universal Music Group NV, 0.00%, 06/03/2023	22.910
22.000.000	Santander Consumer Finance SA, 0.00%, 27/01/2023	21.908
21.000.000	Lloyds Bank Corporate Markets plc, FRN, 4.22%, 30/08/2025	21.000
21.000.000	Realty Income Corp., 0.00%, 09/12/2022	20.970

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
1.917.991	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Agency (Acc T0) Shares, 0.00%	189.027
23.000.000	Universal Music Group NV, 0.00%, 06/03/2023	22.994
20.000.000	HSBC Continental Europe SA, 0.60%, 20/03/2023	19.982
20.000.000	Standard Chartered Bank, 0.00%, 01/06/2023	19.858
17.350.000	Credit Suisse AG, FRN, 3.18%, 31/05/2024	16.970
15.000.000	Barclays Bank plc, 2.20%, 05/05/2023	15.100
15.000.000	Santander Consumer Finance SA, 0.00%, 23/01/2023	14.994
15.000.000	AXA Banque SA, 0.00%, 09/10/2023	14.967
13.100.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.50%, 13/03/2023	13.094
13.575.000	Credit Suisse AG, FRN, 3.72%, 01/09/2023	12.192
10.000.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 01/03/2023	9.984
8.000.000	Mohawk Capital Luxembourg SA, 0.00%, 23/03/2023	7.988
7.000.000	Heineken NV, 0.00%, 27/09/2023	6.994
6.000.000	Realty Income Corp., 0.00%, 21/12/2022	5.999
5.500.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.00%, 20/02/2023	5.499
	DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main, FRN, 4.22%, 28/02/2025	
5.000.000		5.007
5.000.000	CA Consumer Finance SA, 0.00%, 03/03/2023	5.000
5.000.000	Mohawk Capital Luxembourg SA, 0.00%, 03/03/2023	5.000
5.000.000	Ancor UK Finance plc, 0.00%, 02/12/2022	5.000
5.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 16/12/2022	5.000
5.000.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 0.63%, 26/09/2023	4.997

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

BLACKROCK ICS EURO GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
240.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 01/06/2023	239.886
225.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 07/06/2023	224.984
220.025.000	Germany Treasury Bill, 0.00%, 17/05/2023	219.921
213.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 24/05/2023	212.985
200.000.000	Belgium Treasury Bill, 0.00%, 11/05/2023	199.900
150.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 02/08/2023	149.902
140.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 13/04/2023	139.946
139.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 11/05/2023	138.967
125.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 04/05/2023	125.008
120.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 26/04/2023	119.969
110.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 17/05/2023	110.050
102.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 05/04/2023	101.987
100.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 21/06/2023	100.057
95.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 19/04/2023	95.053
81.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 08/02/2023	81.019
80.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 28/06/2023	80.050
78.000.000	Germany Treasury Bill, 0.00%, 22/03/2023	77.960
67.215.000	France Treasury Bill BTF Discount Notes, 3.69%, 10/01/2024	66.274
65.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 25/01/2023	65.067
61.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 04/01/2023	60.960
60.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 22/03/2023	59.892
60.000.000	Austria Treasury Bill Discount Notes, 3.83%, 25/01/2024	59.253
52.025.000	Germany Treasury Bill, 0.00%, 13/04/2023	51.996
50.600.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 15/03/2023	50.562
50.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 01/02/2023	49.919
46.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 09/11/2022	45.994
46.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 11/01/2023	45.979
45.500.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 02/11/2022	45.493
45.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 18/01/2023	45.075
42.500.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 03/08/2023	42.421
40.100.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 01/03/2023	40.079
40.025.000	Germany Treasury Bill, 0.00%, 19/07/2023	40.006
40.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 04/05/2023	39.913
39.218.000	European Union Bill, 0.00%, 06/01/2023	39.182
38.100.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 23/02/2023	38.075

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
10.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 01/02/2023	9.988
5.000.000	Belgium Treasury Bill, 0.00%, 12/01/2023	4.999
3.000.000	Germany Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2023	2.999

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

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
300.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 30/08/2023	299.970
300.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 08/09/2023	299.970
300.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 18/08/2023	299.970
300.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 29/08/2023	299.970
300.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 25/08/2023	299.970
300.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 24/08/2023	299.970
300.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 22/08/2023	299.970
300.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 06/09/2023	299.970
300.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 07/09/2023	299.970
300.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 24/07/2023	299.915
300.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 28/08/2023	299.909
300.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 21/08/2023	299.909
250.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 05/04/2023	249.980
250.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 30/03/2023	249.980
250.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 31/03/2023	249.980
250.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 04/04/2023	249.980
250.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 06/04/2023	249.980
250.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 12/04/2023	249.980
250.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 13/04/2023	249.980
250.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 14/04/2023	249.980

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
107.000.000	Credit Agricole SA, 0.00%, 04/08/2023	106.293
80.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.82%, 20/04/2023	80.023
37.000.000	National Westminster Bank plc Discount Notes, 3.90%, 08/12/2023	36.512
25.000.000	Credit Agricole SA, 0.00%, 02/01/2024	24.313
5.000.000	Standard Chartered Bank, 0.00%, 12/10/2022	4.999

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

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
1.950.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 07/07/2023	1.949.816
1.950.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 20/07/2023	1.949.816
1.950.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 19/07/2023	1.949.816
1.950.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 18/07/2023	1.949.816
1.950.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 05/07/2023	1.949.816
1.950.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 21/07/2023	1.949.816
1.950.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 30/06/2023	1.949.816
1.950.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 06/07/2023	1.949.816
1.950.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 29/06/2023	1.949.816
1.950.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 04/07/2023	1.949.816
1.950.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 03/07/2023	1.949.449
1.950.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 17/07/2023	1.949.449
1.900.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 24/07/2023	1.899.463
1.850.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 09/05/2023	1.849.851
1.850.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 28/06/2023	1.849.826
1.850.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 08/05/2023	1.849.555
1.800.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 21/06/2023	1.799.843
1.800.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 09/06/2023	1.799.843
1.800.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 02/06/2023	1.799.843
1.800.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 06/06/2023	1.799.843

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
718.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.82%, 20/04/2023	718.206
600.000.000	BPCE SA, 2.07%, 03/01/2023	600.018
585.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 01/02/2023	584.064
477.000.000	Societe Generale SA, 0.00%, 31/01/2023	476.087
475.000.000	Credit Agricole SA, 0.00%, 02/01/2024	461.947
440.000.000	Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 0.00%, 29/03/2023	439.828
393.000.000	Credit Agricole SA, 0.00%, 04/08/2023	390.404
259.500.000	National Westminster Bank plc Discount Notes, 3.90%, 08/12/2023	256.080
240.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 04/01/2023	239.931
147.000.000	Germany Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2023	146.906
135.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 12/01/2023	134.919
116.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 19/01/2023	115.880
108.300.000	European Union Bill Discount Notes, 3.66%, 09/02/2024	106.603
100.000.000	Toronto-Dominion Bank (The), 2.50%, 25/05/2023	100.000
100.000.000	MUFG Bank Ltd., 0.00%, 31/10/2022	99.972
100.000.000	Finland T-Bill, 0.00%, 12/01/2023	99.946
100.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 21/03/2023	99.908
100.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 01/08/2023	99.811
80.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 04/04/2023	79.498
76.000.000	Bundesschatzanweisungen, 0.00%, 15/12/2022	75.950
70.000.000	Colgate-Palmolive Co., 0.00%, 05/01/2023	69.950

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

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
14.157.265	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Agency (Acc T0) Shares, 0.00%	1.405.300
250.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 17/02/2023	249.983
250.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 18/04/2023	249.980
250.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 17/04/2023	249.940
220.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 09/05/2023	219.627
212.000.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV, FRN, 4.17%, 28/05/2025	212.000
220.000.000	Toronto-Dominion Bank (The) Discount Notes, 4.19%, 18/09/2024	210.932
206.600.000	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 0.00%, 08/11/2022	206.592
206.000.000	DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main, FRN, 4.22%, 28/02/2025	206.000
200.700.000	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 0.00%, 09/11/2022	200.692
200.000.000	BPCE SA, FRN, 4.06%, 18/07/2025	200.000
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 02/11/2022	199.996
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 27/10/2022	199.996
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 04/10/2022	199.996
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 28/10/2022	199.996
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 01/11/2022	199.996
200.000.000	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 0.00%, 25/10/2022	199.996
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 10/11/2022	199.992
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 29/11/2022	199.992
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 11/11/2022	199.992

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
14.169.318	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Agency (Acc T0) Shares, 0.00%	1.408.944
162.900.000	Credit Suisse AG, FRN, 3.72%, 01/09/2023	146.300
115.000.000	AXA Banque SA, 0.00%, 09/10/2023	114.863
100.000.000	Standard Chartered Bank, 0.00%, 01/06/2023	99.290
28.915.000	Credit Suisse AG, FRN, 3.18%, 31/05/2024	28.281
1.000.000	DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main, FRN, 4.22%, 28/02/2025	1.001

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

BLACKROCK ICS STERLING GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Käufe			Kosten
Menge	Anlagen		Tsd. GBP
350.007.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 24/07/2023		347.219
268.662.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 12/12/2022		268.151
270.279.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 11/09/2023		267.956
257.723.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2023		256.829
215.442.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 19/12/2022		214.975
208.100.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 03/04/2023		207.812
207.500.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2023		206.700
181.875.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 11/04/2023		180.254
172.620.000	UK Treasury Bill Discount Notes, 5.49%, 15/01/2024		169.599
169.495.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 05/06/2023		168.936
138.133.000	UK Treasury Bill Discount Notes, 0.44%, 30/10/2023		137.330
138.000.000	UK Treasury Bill Discount Notes, 3.50%, 02/01/2024		135.954
125.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 22/05/2023		124.589
116.345.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 30/01/2023		116.224
111.926.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 31/07/2023		111.491
100.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 27/03/2023		99.107
100.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2023		99.002
100.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 19/06/2023		98.973
100.000.000	UK Treasury Bill Discount Notes, 5.50%, 08/01/2024		98.355
100.000.000	UK Treasury Bill Discount Notes, 4.42%, 02/10/2023		97.842
93.825.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 18/09/2023		93.450
89.100.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 03/01/2023		88.866
85.495.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 29/08/2023		85.264
78.110.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 25/09/2023		76.517
75.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 03/07/2023		74.200
68.098.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 07/11/2022		68.054
67.506.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 17/07/2023		67.382
65.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 09/01/2023		64.797
59.531.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 20/03/2023		59.353
57.864.000	UK Treasury Bill Discount Notes, 5.33%, 11/12/2023		56.803
55.700.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 13/03/2023		55.670
50.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 28/12/2022		49.869
50.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 14/08/2023		48.985
50.000.000	UK Treasury Bill Discount Notes, 4.56%, 16/10/2023		48.889

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

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. GBP
200.000.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 17/10/2022	199.916
200.000.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 24/10/2022	199.916
200.000.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 15/11/2022	199.887
200.000.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 22/11/2022	199.887
200.000.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 08/11/2022	199.820
200.000.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 06/12/2022	199.775
185.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 05/09/2023	182.040
185.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA Discount Notes, 5.95%, 02/04/2024	178.797
175.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 04/05/2023	174.720
175.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 20/04/2023	174.720
167.000.000	Kingdom of Belgium, 0.00%, 06/04/2023	166.727
160.000.000	KBC Bank NV, 0.00%, 16/02/2023	158.660
155.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2023	154.419
150.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 24/10/2022	149.936
150.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 02/11/2022	149.920
150.000.000	FMS Wertmanagement, 0.00%, 04/04/2023	149.770
150.000.000	Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 03/11/2022	149.738
150.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 07/11/2022	149.703
146.000.000	Matfin, 0.00%, 25/09/2023	144.951
146.000.000	Matchpoint Finance plc Discount Notes, 5.30%, 27/11/2023	144.659

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. GBP
105.000.000	Standard Chartered Bank, 3.70%, 02/02/2023	105.018
100.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 16/12/2022	99.791
67.000.000	Standard Chartered Bank, 2.00%, 07/11/2022	67.000
58.000.000	Standard Chartered plc, 2.17%, 05/12/2022	57.999
50.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 23/01/2023	49.966
25.000.000	Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 03/11/2022	24.986
20.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 2.71%, 16/12/2022	20.000

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

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. GBP
1.540.000.000	Kingdom of Netherlands, 0.00%, 25/01/2023	1.531.299
1.379.000.000	Nationwide Building Society, 4.18%, 28/04/2023	1.379.000
1.375.000.000	Nationwide Building Society, 4.43%, 05/06/2023	1.375.000
1.373.000.000	Nationwide Building Society, 4.18%, 05/05/2023	1.373.000
1.372.000.000	Nationwide Building Society, 4.18%, 12/05/2023	1.372.000
1.364.000.000	Nationwide Building Society, 4.93%, 17/07/2023	1.364.000
1.363.000.000	Nationwide Building Society, 4.93%, 21/07/2023	1.363.000
1.360.000.000	Nationwide Building Society, 4.18%, 24/04/2023	1.360.000
1.359.000.000	Nationwide Building Society, 5.18%, 29/08/2023	1.359.000
1.359.000.000	Nationwide Building Society, 4.43%, 30/05/2023	1.359.000
1.359.000.000	Nationwide Building Society, 4.43%, 24/05/2023	1.359.000
1.358.000.000	Nationwide Building Society, 4.93%, 27/07/2023	1.358.000
1.358.000.000	Nationwide Building Society, 4.93%, 31/07/2023	1.358.000
1.355.000.000	Nationwide Building Society, 4.18%, 18/04/2023	1.355.000
1.354.000.000	Nationwide Building Society, 4.93%, 11/07/2023	1.354.000
1.352.000.000	Nationwide Building Society, 4.93%, 04/08/2023	1.352.000
1.352.000.000	Nationwide Building Society, 5.18%, 10/08/2023	1.352.000
1.352.000.000	Nationwide Building Society, 5.18%, 16/08/2023	1.352.000
1.352.000.000	Nationwide Building Society, 5.18%, 22/08/2023	1.352.000
1.341.000.000	Nationwide Building Society, 4.43%, 18/05/2023	1.341.000

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. GBP
522.000.000	Standard Chartered Bank, 3.70%, 02/02/2023	522.091
400.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 16/12/2022	399.164
268.000.000	Standard Chartered Bank, 2.00%, 07/11/2022	267.999
250.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 23/01/2023	249.828
229.000.000	Standard Chartered plc, 2.17%, 05/12/2022	228.996
229.000.000	Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 03/11/2022	228.870
100.000.000	Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 01/02/2023	99.539
90.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.62%, 03/02/2023	90.002
80.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 2.71%, 16/12/2022	79.999
60.000.000	Toronto-Dominion Bank (The), FRN, 5.70%, 17/06/2024	60.037
60.000.000	Sunderland Receivables SA, 0.00%, 12/01/2023	59.847
40.000.000	Toronto-Dominion Bank (The), 4.99%, 23/10/2023	39.966

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

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. GBP
100.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 28/04/2023	99.644
82.000.000	Toyota Motor Financial Services UK Plc, 0.00%, 12/09/2023	81.988
80.000.000	Belfius Bank SA Discount Notes, 5.37%, 21/11/2023	78.887
75.000.000	Belfius Financing Co., 0.00%, 01/06/2023	74.201
70.000.000	BNP Paribas SA, 4.66%, 10/10/2023	70.000
70.000.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.00%, 04/11/2022	69.970
70.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.00%, 22/05/2023	69.297
70.000.000	MUFG Bank Ltd., 0.00%, 09/05/2023	69.285
70.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA Discount Notes, 4.89%, 09/11/2023	68.272
67.500.000	Toyota Motor Financial Services UK Plc, 0.00%, 14/09/2023	67.490
70.000.000	Societe Generale SA Discount Notes, 4.66%, 31/01/2024	66.965
70.000.000	Jyske Bank A/S Discount Notes, 4.61%, 13/02/2024	66.847
70.000.000	La Banque Postale SA Discount Notes, 4.79%, 23/02/2024	66.751
65.000.000	National Westminster Bank plc, 0.00%, 13/02/2023	64.408
70.000.000	GlaxoSmithKline Finance plc, 0.00%, 14/08/2023	60.242
68.000.000	Universal Music Group NV, 0.00%, 06/06/2023	59.872
60.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 14/11/2022	59.866
60.000.000	NTT Finance Uk Ltd., 0.00%, 13/01/2023	59.797
59.800.000	Eurotitrisation - SAT Magenta, 0.00%, 03/04/2023	59.779
60.000.000	BMW International Investment BV, 0.00%, 24/03/2023	59.654

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

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. USD
150.000.000	Credit Industriel et Commercial, 0.00%, 04/01/2023	149.982
130.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 13/10/2022	129.989
130.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 04/01/2023	129.984
130.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 19/12/2022	129.953
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 01/11/2022	124.989
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 28/10/2022	124.989
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 27/10/2022	124.989
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 25/10/2022	124.989
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 21/10/2022	124.989
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 20/10/2022	124.989
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 19/10/2022	124.989
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 14/10/2022	124.989
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 12/10/2022	124.989
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 07/10/2022	124.989
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 06/10/2022	124.989
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 05/10/2022	124.989
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 04/10/2022	124.989
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 18/10/2022	124.989
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 08/11/2022	124.987
125.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 09/11/2022	124.987

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. USD
35.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 24/01/2023	34.926
32.000.000	Credit Suisse AG, FRN, 4.08%, 10/02/2023	31.869
20.000.000	International Development Association, 0.00%, 30/01/2023	19.983
20.000.000	BRED Banque Populaire, 0.00%, 27/07/2023	19.914
15.000.000	Toronto-Dominion Bank (The), 5.05%, 31/03/2023	15.006
15.000.000	BRED Banque Populaire, 0.00%, 04/05/2023	14.984
15.000.000	Bank of Montreal, 0.00%, 18/08/2023	14.954
10.000.000	Erste Abwicklungsanstalt, 0.00%, 02/02/2023	9.982
10.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 31/01/2023	9.972
5.000.000	BRED Banque Populaire, 0.00%, 02/05/2023	4.996

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

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. USD
1.380.000.000	Kingdom of Netherlands, 0.00%, 26/01/2023	1.372.007
1.090.000.000	DNB Bank ASA, 4.80%, 03/04/2023	1.090.000
998.000.000	Nationwide Building Society, 0.00%, 05/07/2023	996.870
1.000.000.000	Nationwide Building Society, 0.00%, 05/01/2023	993.192
935.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 25/01/2023	929.780
920.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Discount Notes, 5.34%, 02/10/2023	919.046
910.000.000	Kingdom of Belgium, 0.00%, 20/01/2023	905.245
890.000.000	Kingdom of Sweden, 0.00%, 02/02/2023	887.830
750.000.000	Microsoft Corp.Discount Notes, 5.33%, 23/10/2023	745.694
725.000.000	Kingdom of Belgium, 0.00%, 11/04/2023	723.065
721.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 21/09/2023	718.185
702.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale Discount Notes, 5.35%, 02/10/2023	700.542
697.000.000	Bank of America NA, 4.85%, 03/04/2023	697.000
703.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 26/07/2023	696.473
681.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 07/09/2023	680.899
681.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 08/09/2023	680.899
681.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 12/09/2023	680.899
681.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 13/09/2023	680.899
681.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 14/09/2023	680.899
681.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 15/09/2023	680.899

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. USD
500.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 24/01/2023	498.846
305.000.000	International Development Association, 0.00%, 30/01/2023	304.743
235.000.000	BRED Banque Populaire, 0.00%, 27/07/2023	233.986
233.000.000	BNP Paribas SA, 4.90%, 01/05/2023	233.002
190.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 31/01/2023	189.459
183.000.000	Cooperatieve Rabobank UA, 0.00%, 15/06/2023	182.374
175.000.000	Toronto-Dominion Bank (The), 5.05%, 31/03/2023	175.074
165.000.000	Bank of Montreal, 0.00%, 18/08/2023	164.494
160.000.000	BRED Banque Populaire, 0.00%, 04/05/2023	159.828
120.000.000	Erste Abwicklungsanstalt, 0.00%, 02/02/2023	119.784
75.000.000	BRED Banque Populaire, 0.00%, 02/05/2023	74.940
50.000.000	Finland T-Bill, 0.00%, 15/03/2023	49.425
40.000.000	Alpine Securitization Ltd., 4.32%, 21/02/2023	39.892
35.000.000	Alpine Securitization Ltd., 4.32%, 21/02/2023	34.906

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

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. USD
216.975.465	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Agency (Dis) Shares, 0.00%	216.975
140.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 03/01/2023	139.959
132.500.000	Western Union Co (The) Corporate Commercial Paper, 0.00%, 28/07/2023	132.451
130.000.000	Western Union Co (The) Corporate Commercial Paper, 0.00%, 29/06/2023	129.981
130.000.000	Western Union Co (The) Corporate Commercial Paper, 0.00%, 19/07/2023	129.981
128.300.000	CVS Caremark Corp., 0.00%, 30/06/2023	128.281
125.000.000	Enterprise Products Operating LLC, 0.00%, 16/11/2022	124.954
124.500.000	Western Union Co (The) Corporate Commercial Paper, 0.00%, 20/07/2023	124.482
123.000.000	Western Union Co (The) Corporate Commercial Paper, 0.00%, 28/06/2023	122.969
123.000.000	Western Union Co (The) Corporate Commercial Paper, 0.00%, 05/07/2023	122.964
122.000.000	Western Union Co (The) Corporate Commercial Paper, 0.00%, 25/07/2023	121.982
120.000.000	Western Union Co. (The), 0.00%, 07/07/2023	119.983
117.200.000	Amphenol Corp., 0.00%, 21/02/2023	117.110
116.264.000	Keurig Dr Pepper, Inc., 0.00%, 31/03/2023	116.142
111.000.000	Western Union Co (The) Corporate Commercial Paper, 0.00%, 15/08/2023	110.983
110.000.000	Enterprise Products Operating LLC, 0.00%, 21/07/2023	109.984
110.000.000	Enterprise Products Operating LLC, 0.00%, 15/11/2022	109.941
107.700.000	Amphenol Corp., 0.00%, 06/03/2023	107.658
107.000.000	Western Union Co (The) Corporate Commercial Paper, 0.00%, 27/07/2023	106.984
106.750.000	Western Union Co (The) Corporate Commercial Paper, 0.00%, 27/06/2023	106.734

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. USD
210.920.647	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Agency (Dis) Shares, 0.00%	210.921
45.000.000	BRED Banque Populaire, 0.00%, 27/07/2023	44.806
30.500.000	Nutrien Financial US LLC, 0.00%, 21/08/2023	30.454
25.000.000	Thermo Fisher Scientific, Inc., 0.00%, 09/02/2023	24.997
25.000.000	Hewlett Packard Enterprise Co., 0.00%, 24/02/2023	24.993
25.000.000	Mercedes-Benz Finance North America LLC, 0.00%, 27/02/2023	24.987
25.000.000	BRED Banque Populaire, 0.00%, 04/05/2023	24.973
21.330.000	Fidelity National Information Services, Inc., 0.00%, 26/06/2023	21.321
20.000.000	BRED Banque Populaire, 0.00%, 02/05/2023	19.984
15.000.000	Bank of Montreal, 0.00%, 18/08/2023	14.954
11.900.000	DNB Bank ASA, 0.00%, 18/08/2023	11.888
10.000.000	Cooperatieve Rabobank UA, 0.00%, 15/06/2023	9.966
10.000.000	Credit Suisse AG, FRN, 5.00%, 10/07/2023	8.600
10.000.000	Credit Suisse AG, FRN, 5.10%, 19/01/2024	8.600
6.276.000	Nutrien Ltd., 0.00%, 18/08/2023	6.269
5.000.000	CDP Financial, Inc., 0.00%, 27/06/2023	4.997

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

BLACKROCK ICS US TREASURY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. USD
2.138.720.000	US Treasury Bill, 0.00%, 25/07/2023	2.129.772
2.020.000.000	US Treasury, FRN, 5.44%, 31/07/2024	2.020.704
2.000.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023	1.988.088
1.900.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023	1.892.478
1.901.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 20/12/2022	1.890.143
1.695.820.000	US Treasury Bill Discount Notes, 5.30%, 24/10/2023	1.688.137
1.537.440.000	US Treasury Bill, 0.00%, 19/09/2023	1.530.107
1.500.000.000	US Treasury Bill Discount Notes, 5.32%, 02/11/2023	1.490.751
1.400.000.000	US Treasury Bill Discount Notes, 5.30%, 03/10/2023	1.394.251
1.250.000.000	US Cash Management Bill, 0.00%, 17/04/2023	1.247.238
1.250.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 29/08/2023	1.244.872
1.250.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 12/09/2023	1.244.868
1.250.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 10/01/2023	1.242.514
1.000.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 15/08/2023	995.952
1.000.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 24/08/2023	993.927
857.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/03/2023	847.329
635.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 02/02/2023	628.467
604.000.000	US Treasury, FRN, 5.39%, 31/01/2024	603.937
563.000.000	US Treasury, FRN, 4.45%, 31/01/2023	563.151
544.775.000	US Treasury Bill, 0.00%, 22/08/2023	542.548
500.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 05/09/2023	498.012
500.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 17/01/2023	496.873
500.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 24/01/2023	496.796
440.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 31/08/2023	435.853
426.310.000	US Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023	423.739
400.810.000	US Treasury Bill, 0.00%, 08/08/2023	399.205
400.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 21/11/2023	393.032
375.030.000	US Treasury Bill Discount Notes, 5.31%, 05/10/2023	372.720

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. USD
2.450.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 15/11/2022	2.444.022
1.901.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 20/12/2022	1.891.114
1.250.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 10/01/2023	1.247.828
1.161.740.000	US Treasury Bill, 0.00%, 16/03/2023	1.156.576
1.100.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 29/08/2023	1.098.971
635.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 02/02/2023	629.016
500.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 17/01/2023	499.111
500.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 24/01/2023	498.911
440.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 31/08/2023	437.990
401.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 08/11/2022	400.565
400.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 21/11/2023	393.878
375.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 22/08/2023	374.061
350.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 05/09/2023	349.285
350.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 29/12/2022	349.146
280.025.000	US Treasury Bill, 0.00%, 18/05/2023	276.681
250.000.000	US Treasury, FRN, 5.44%, 31/10/2023	250.159
250.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 05/01/2023	249.219
249.195.000	US Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2023	248.785
225.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 13/12/2022	224.824
200.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 31/01/2023	199.386
200.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 23/03/2023	198.917
200.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/03/2023	198.520
198.525.000	US Treasury Bill Discount Notes, 5.41%, 11/01/2024	193.915
188.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 12/01/2023	187.751

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

INFORMATIONEN FÜR ANLEGER IN DER SCHWEIZ (UNGEPRÜFT)

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

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

Name des Fonds	Auflegungsdatum	2022		2021		2020	
		Fondsrendite %	Benchmarkrendite %	Fondsrendite %	Benchmarkrendite %	Fondsrendite %	Benchmarkrendite %
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	30. April 2010	(0,21)	(0,01)	(0,75)	(0,57)	(0,76)	(0,62)
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Acc)	24. April 2013	0,06	(0,01)	(0,60)	(0,69)	(0,51)	(0,63)
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	30. April 2010	0,01	(0,01)	(0,74)	(0,69)	(0,65)	(0,63)
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Core	30. April 2010	(0,06)	k. A.	(0,65)	(0,66)	(0,46)	(0,52)
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	23. September 2010	1,29	1,40	(0,01)	0,06	0,11	0,20
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Dis)	22. Juli 2019	1,39	1,40	k. A.	(0,07)	0,17	0,06
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	30. April 2010	1,40	1,40	0,01	(0,07)	0,19	0,06
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Core	30. April 2010	1,33	1,39	(0,05)	(0,06)	0,50	0,36
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Dis)	24. Juli 2019	1,77	1,64	0,02	(0,03)	0,52	0,30
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	30. April 2010	1,78	1,64	0,02	(0,03)	0,53	0,30
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Select	23. September 2010	1,89	1,70	0,08	0,05	1,16	0,75
BlackRock ICS US Treasury Fund - Anteilklasse Core (Acc)	30. April 2010	1,56	1,64	0,01	0,04	0,32	0,45

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

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

Die TER für jede Anteilklasse, mit Ausnahme der primären Anteilklasse, ist in der folgenden Tabelle für den Zwölfmonatszeitraum zum 30. September 2023 angegeben:

Name des Fonds	Klasse des Fonds	TER (in %)	
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Anteilklasse Agency (Acc)	0,03	
	Anteilklasse Agency (Dis)	0,03	
	Anteilklasse Core (Acc T0)	0,20	
	Anteilklasse Core (Dis)	0,20	
	Anteilklasse G Accumulating	0,20	
	Anteilklasse G Accumulating T0	0,20	
	Anteilklasse Heritage (Acc T0)	0,12	
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,13	
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,13	
	Anteilklasse Premier (Acc T0)	0,10	
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,10	
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10	
	Anteilklasse Select (Acc T0)	0,15	
	Anteilklasse Select (Dis)	0,15	
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	Anteilklasse Admin III (Acc)	0,45	
	Anteilklasse Agency (Acc T0)	0,03	
	Anteilklasse Core (Acc T0)	0,20	
	Anteilklasse Heritage (Acc T0)	0,12	
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,12	
	Anteilklasse Premier (Acc T0)	0,10	
	Anteilklasse Premier (Acc T2)	0,10	
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,10	
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10	
	Anteilklasse Select (Acc T0)	0,15	
	Anteilklasse Select (Acc)	0,15	
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Anteilklasse Admin I (Acc T0)	0,25	
	Anteilklasse Admin I (Acc)	0,25	
	Anteilklasse Admin II (Acc)	0,30	
	Anteilklasse Admin III (Acc T0)	0,45	
	Anteilklasse Admin III (Acc)	0,45	
	Anteilklasse Admin IV (Acc)	0,70	
	Anteilklasse Agency (Acc T0)	0,03	
	Anteilklasse Agency (Acc)	0,03	
	Anteilklasse Agency (Dis)	0,00	
	Anteilklasse Aon Captives (Acc T0)	0,16	
	Anteilklasse Core (Acc T0)	0,20	
	Anteilklasse Core (Dis)	0,20	
	Anteilklasse G Accumulating T0	0,19	
	Anteilklasse Heritage (Acc T0)	0,12	
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,12	
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,13	
	Anteilklasse Premier (Acc T0)	0,10	
	Anteilklasse Premier (Acc T2)	0,10	
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,10	
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10	
	Anteilklasse Select (Acc T0)	0,15	
	Anteilklasse Select (Acc)	0,15	
	Anteilklasse Select (Dis)	0,15	
	BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	Anteilklasse Admin III	0,45
		Anteilklasse Agency	0,03
		Anteilklasse Heritage (Dis)	0,00
Anteilklasse Heritage		0,12	
Anteilklasse J (Acc)		0,06	
Anteilklasse J (Dis)		0,06	
Anteilklasse Premier (Dis)		0,10	
Anteilklasse Premier		0,10	
Anteilklasse Select		0,15	
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Anteilklasse Agency (Acc T0)	0,03	
	Agency (Dis) GBP	0,03	
	Anteilklasse Core (Acc T0)	0,20	
	Anteilklasse Core (Dis)	0,20	

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

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

Name des Fonds	Klasse des Fonds	TER (in %)
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund (Fortsetzung)		
	Anteilklasse Heritage (Acc T0)	0,12
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,12
	Heritage (Dis) GBP	0,13
	Anteilklasse Premier (Acc T0)	0,10
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,10
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10
	Anteilklasse Select (Acc T0)	0,15
	Select (Dis) GBP	0,15
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund		
	Anteilklasse Agency (Acc T0)	0,03
	Anteilklasse Agency (Acc)	0,03
	Anteilklasse Agency (Dis)	0,03
	Anteilklasse Core (Acc T0)	0,20
	Anteilklasse Heritage (Acc T0)	0,12
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,12
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,12
	Anteilklasse J (Acc T3)	0,06
	Anteilklasse J (Dis T3)	0,00
	Anteilklasse Premier (Acc T0)	0,10
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,10
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		
	Anteilklasse Admin I (Acc)	0,25
	Anteilklasse Admin I (Dis)	0,25
	Anteilklasse Admin II (Acc)	0,30
	Anteilklasse Admin II (Dis)	0,30
	Anteilklasse Admin III (Acc)	0,45
	Anteilklasse Admin III (Dis)	0,45
	Anteilklasse Admin IV (Acc)	0,58
	Anteilklasse Agency (Acc)	0,03
	Anteilklasse Agency (Dis)	0,03
	Anteilklasse Aon Captives	0,15
	Anteilklasse Core (Dis)	0,20
	Anteilklasse G Distributing I	0,12
	Anteilklasse G Distributing II	0,25
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,12
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,12
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,10
	Anteilklasse Premier (Dis T1)	0,10
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10
	Anteilklasse S (Acc)	0,10
	Anteilklasse Select (Acc)	0,15
	Anteilklasse Select (Dis)	0,15
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		
	Anteilklasse Agency (Dis)	0,03
	Anteilklasse Agency	0,03
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,00
	Anteilklasse Heritage	0,12
	Anteilklasse J (Acc)	0,06
	Anteilklasse J (Dis)	0,06
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10
	Anteilklasse Premier	0,10
	Anteilklasse Select	0,15
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		
	Anteilklasse Agency (Acc T0)	0,03
	Anteilklasse Agency (Dis)	0,03
	Anteilklasse Core (Acc T0)	0,20
	Anteilklasse Core (Acc)	0,20
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,13
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,12
	Anteilklasse Premier (Acc T0)	0,10
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,10
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10
	Anteilklasse Select (Dis)	0,15
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund		
	Anteilklasse Admin I (Acc)	0,25
	Anteilklasse Admin I (Dis)	0,25
	Anteilklasse Admin II (Acc)	0,30

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

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

Name des Fonds	Klasse des Fonds	TER (in %)	
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund (Fortsetzung)	Anteilklasse Admin II (Dis)	0,30	
	Anteilklasse Admin III (Acc)	0,45	
	Anteilklasse Admin III (Dis)	0,45	
	Anteilklasse Admin IV (Acc)	0,70	
	Anteilklasse Agency (Acc T0)	0,03	
	Anteilklasse Agency (Acc)	0,03	
	Anteilklasse Agency (Dis)	0,03	
	Anteilklasse Aon Captives	0,15	
	Anteilklasse Core (Acc T0)	0,20	
	Anteilklasse Core (Dis)	0,20	
	Klasse FA	0,00	
	Anteilklasse G Accumulating II	0,25	
	Anteilklasse G Accumulating	0,20	
	Anteilklasse G Distributing I	0,15	
	Anteilklasse G Distributing II	0,00	
	Anteilklasse G Distributing	0,20	
	Anteilklasse G Heritage (Acc)	0,12	
	Anteilklasse G Heritage (Dis)	0,12	
	Anteilklasse Heritage (Acc T0)	0,12	
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,12	
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,12	
	Klasse N	0,20	
	Anteilklasse Premier (Acc T0)	0,10	
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,10	
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10	
	Anteilklasse Select (Acc)	0,15	
	Anteilklasse Select (Dis)	0,15	
	BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	Anteilklasse Agency	0,03
		Anteilklasse Core	0,20
		Anteilklasse Heritage (CHF Hedged)	0,14
Anteilklasse Heritage (Dis)		0,00	
Anteilklasse Heritage (SGD Hedged)		0,14	
Anteilklasse Heritage		0,12	
Anteilklasse J (Acc)		0,06	
Anteilklasse J (Dis)		0,06	
Anteilklasse Premier (Dis)		0,10	
Anteilklasse Premier		0,10	
BlackRock ICS US Treasury Fund	Anteilklasse Admin III (Dis)	0,45	
	Anteilklasse Agency (Acc)	0,03	
	Anteilklasse Agency (Dis)	0,03	
	Anteilklasse Core (Dis)	0,20	
	Klasse FA	0,00	
	Anteilklasse G Accumulating	0,20	
	Anteilklasse G Distributing	0,20	
	Anteilklasse G Heritage (Acc)	0,12	
	Anteilklasse G Heritage (Dis)	0,12	
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,12	
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,12	
	Klasse N	0,00	
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,10	
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10	
	Anteilklasse Select (Dis)	0,15	

TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN (UNGEPRÜFT)

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

TRANSAKTIONSKOSTEN (UNGEPRÜFT)

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

VERRECHNUNGSPROVISIONEN (SOFT COMMISSIONS) (UNGEPRÜFT)

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2023 wurden vom Investmentmanager im Namen der jeweiligen Fonds keine Vereinbarungen über Verrechnungsprovisionen abgeschlossen.

WECHSELSEITIGE ANLAGEN (UNGEPRÜFT)

Jeder unten aufgeführte Fonds hielt zum 30. September 2023 die folgenden wechselseitigen Anlagen im Umbrella. Diese Anlagen wurden zu Darstellungszwecken der konsolidierten Ergebnisse des Unternehmens nicht eliminiert.

Fund	Wechselseitige Anlagen im Umbrella	Zeitwert Tsd.	% des Gesamt- nettoinventar- werts des Umbrella
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund - Anteilkategorie Agency (Dis)	85.000	0,05
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Anteilkategorie Agency	163.052	0,09

GESAMTRISIKOEXPOSITION (UNGEPRÜFT)

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

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

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

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

HEBELWIRKUNG (UNGEPRÜFT)

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT)

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

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

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

Vergütungssteuerung

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

Die Umsetzung der Vergütungsrichtlinie wird jährlich zentral und unabhängig auf die Einhaltung der vom MDCC und vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft angenommenen Vergütungsrichtlinien und -verfahren überprüft. Die Angaben zur Vergütung werden vom MDCC und dem Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft erstellt, die die Verantwortung dafür übernehmen.

(a) MDCC

Die Aufgaben des MDCC lauten wie folgt:

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

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

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

Im Jahr 2022 hat der MDCC sieben Sitzungen abgehalten. Die Satzung des MDCC ist auf der Website von BlackRock, Inc. verfügbar (www.blackrock.com).

(b) Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

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

Entscheidungsfindungsprozess

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

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

Jährliche Boni werden aus einem Bonuspool gezahlt.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Entscheidungsfindungsprozess (Fortsetzung)

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

Der MDCC berücksichtigt regelmäßig auch die Empfehlung der Geschäftsleitung für den prozentualen Anteil der auflaufenden betrieblichen Erträge vor Anreizen, der als Vergütungskosten während des Jahres für den Baranteil des gesamten jährlichen Bonuspools ausgewiesen wird (die „Steigerungsrate“).

Die Steigerungsrate des Baranteils am gesamten jährlichen Bonuspool kann vom MDCC während des Jahres auf Grundlage seiner Prüfung der vorstehend beschriebenen Finanzinformationen modifiziert werden. Der MDCC wendet für die Informationen, die er bei der Ermittlung des Volumens des Gesamt-Bonuspools berücksichtigt, oder die Rückstellungen für den Baranteil des Gesamt-Bonuspools keine besonderen Gewichtungen oder Formeln an.

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

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

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

Kontrollfunktionen

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

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

Verbindung zwischen Zahlung und Leistung

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

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Verbindung zwischen Zahlung und Leistung (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Identifizierte Mitarbeiter

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Identifizierte Mitarbeiter (Fortsetzung)

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

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

Quantitative Angaben zur Vergütung

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

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

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

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

Der Gesamtbetrag der von der Verwaltungsgesellschaft ihren Mitarbeitern gewährten Vergütung für das Geschäftsjahr der Verwaltungsgesellschaft zum 31. Dezember 2022 beläuft sich auf 220,40 Mio. USD. Diese Zahl setzt sich aus einer festen Vergütung von 118,00 Mio. USD und einer variablen Vergütung von 102,40 Mio. USD zusammen. Die vorstehend beschriebene Vergütung wurde an insgesamt 3.940 Empfänger gezahlt.

Die von der Verwaltungsgesellschaft für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr der Verwaltungsgesellschaft gezahlte Gesamtvergütung betrug 21,60 Mio. USD an ihre Mitglieder der Geschäftsleitung und 30,80 Mio. USD an andere Mitarbeiter, deren Tätigkeit potenziell wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der Verwaltungsgesellschaft oder ihrer Fonds haben kann. Diese Zahlen beziehen sich auf die Verwaltungsgesellschaft als Ganzes und nicht auf den Fonds.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT)

Techniken des effizienten Portfoliomanagements

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

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

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

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

Umgekehrte Repogeschäfte

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

Die nachstehende Tabelle enthält Angaben zu den umgekehrten Repogeschäften als prozentualer Anteil des Nettoinventarwerts der einzelnen Fonds zum 30. September 2023 und zu den Renditen im Geschäftsjahr zum 30. September 2023.

Fund	Umgekehrte Repogeschäfte		
	Währung	% des NIW	Erzielte Gesamtrenditen Tsd.
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	EUR	88,86	17.350
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	EUR	11,01	6.203
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	EUR	11,10	118.568
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	GBP	105,38	120.177
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	GBP	26,37	67.671
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	GBP	14,80	36.595
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	USD	25,70	39.644
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	USD	14,40	291.931
BlackRock ICS US Treasury Fund	USD	55,67	639.818

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

Die folgende Tabelle enthält Angaben zum Wert der umgekehrten Repogeschäfte und zugehöriger erhaltener Sicherheiten, aufgeteilt nach Kontrahenten, zum 30. September 2023.

Kontrahent	Gründungsland des Kontrahenten	Umgekehrte Repogeschäfte	
		Entliehener Betrag Tsd. EUR	Erhaltene Sicherheiten Tsd. EUR
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund			
BNP Paribas SA	Frankreich	200.000	208.784
Credit Agricole Corporate and Investment Bank	Frankreich	200.000	204.294
MUFG Securities EMEA plc	Japan	200.000	206.334
Natixis SA	Frankreich	200.000	204.128
Santander UK plc	Spanien	200.000	206.442

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Kontrahent	Gründungsland des Kontrahenten	Umgekehrte Repogeschäfte	
		Entliehener Betrag	Erhaltene Sicherheiten
		Tsd. EUR	Tsd. EUR
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund (Fortsetzung)			
Bank of Nova Scotia plc	Kanada	199.000	205.194
NatWest Markets plc	Vereinigtes Königreich	100.000	102.837
Societe Generale	Frankreich	30.000	30.572
	Vereinigte Staaten von Amerika	5.000	5.152
Gesamt		1.334.000	1.373.737
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund			
		Tsd. EUR	Tsd. EUR
NatWest Markets plc	Vereinigtes Königreich	400.000	412.286
BNP Paribas SA	Frankreich	300.000	308.071
Gesamt		700.000	720.357
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund			
		Tsd. EUR	Tsd. EUR
	Vereinigte Staaten von Amerika	900.000	918.548
BofA Securities Europe SA	Niederlande	900.000	912.273
ING Bank NV	Kanada	751.000	765.757
Bank of Nova Scotia plc	Frankreich	750.000	763.795
Natixis SA	Vereinigtes Königreich	600.000	617.821
NatWest Markets plc	Frankreich	500.000	515.258
BNP Paribas SA	Japan	300.000	309.742
MUFG Securities EMEA plc	Spanien	250.000	257.039
Santander UK plc	Frankreich	170.000	173.282
Societe Generale			
Gesamt		5.121.000	5.233.515
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund			
		Tsd. GBP	Tsd. GBP
Canadian Imperial Bank of Commerce	Kanada	699.999	700.001
MUFG Securities EMEA plc	Japan	603.064	603.064
Credit Agricole Corporate and Investment Bank	Frankreich	600.000	600.000
Bank of Nova Scotia plc	Kanada	450.000	450.000
BNP Paribas SA	Frankreich	355.000	362.425
Santander UK plc	Spanien	350.533	350.533
Barclays Bank plc	Vereinigtes Königreich	350.000	362.901
National Australia Bank Ltd.	Australien	350.000	359.209
Societe Generale	Frankreich	350.000	358.968
Standard Chartered Bank	Vereinigtes Königreich	350.000	350.000
Toronto-Dominion Bank (The)	Kanada	350.000	350.000
	Vereinigte Staaten von Amerika	100.001	100.000
Merrill Lynch International			
Gesamt		4.908.597	4.947.101
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund			
		Tsd. GBP	Tsd. GBP
Canadian Imperial Bank of Commerce	Kanada	700.002	700.000
Bank of Nova Scotia plc	Kanada	350.000	350.000
Toronto-Dominion Bank (The)	Kanada	350.000	350.000
Santander UK plc	Spanien	300.457	300.457
Barclays Bank plc	Vereinigtes Königreich	300.000	310.356
Standard Chartered Bank	Vereinigtes Königreich	250.001	250.000
BNP Paribas SA	Frankreich	200.000	206.194
National Australia Bank Ltd.	Australien	50.000	51.532
Gesamt		2.500.460	2.518.539
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund			
		Tsd. GBP	Tsd. GBP
Toronto-Dominion Bank (The)	Kanada	1.299.999	1.300.000
Santander UK plc	Spanien	1.051.167	1.051.167
MUFG Securities EMEA plc	Japan	906.205	906.203
Standard Chartered Bank	Vereinigtes Königreich	500.000	500.000
Bank of Nova Scotia plc	Kanada	400.000	400.000
	Vereinigte Staaten von Amerika	400.000	414.216
Citigroup Global Markets Ltd.	Vereinigtes Königreich	250.000	257.546
Barclays Bank plc	Vereinigte Staaten von Amerika	199.999	200.000
Merrill Lynch International	Kanada	178.192	178.192
Bank of Montreal	Frankreich	45.000	46.189
BNP Paribas SA			
Gesamt		5.230.562	5.253.513
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund			
		Tsd. USD	Tsd. USD
BofA Securities Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	455.500	467.929

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Kontrahent	Gründungsland des Kontrahenten	Umgekehrte Repogeschäfte	
		Entliehener Betrag Tsd. USD	Erhaltene Sicherheiten Tsd. USD
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Fortsetzung)			
Citigroup Global Markets, Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	230.000	234.965
J.P. Morgan Securities LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	192.620	196.177
BNP Paribas SA	Frankreich	120.000	121.556
Gesamt		998.120	1.020.627
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund			
J.P. Morgan Securities LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	3.637.000	3.702.735
BofA Securities Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	1.823.100	1.872.224
Wells Fargo Securities LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	1.380.000	1.415.781
BNP Paribas SA	Frankreich	1.225.000	1.244.178
Citigroup Global Markets, Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	1.010.000	1.026.889
Royal Bank of Canada	Kanada	300.000	303.677
Credit Agricole SA	Frankreich	5.000	5.073
Gesamt		9.380.100	9.570.557
BlackRock ICS US Treasury Fund			
BNP Paribas SA	Frankreich	2.863.000	2.910.155
Societe Generale SA	Frankreich	1.975.000	2.010.551
Credit Agricole SA	Frankreich	1.685.000	1.711.998
Wells Fargo Securities LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	1.625.000	1.646.279
TD Securities (USA) LLC	Kanada	1.350.000	1.369.556
BofA Securities Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	1.040.000	1.058.891
Citigroup Global Markets, Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	795.000	806.680
Barclays Capital, Inc.	Vereinigtes Königreich	500.000	507.052
Bank of Nova Scotia plc	Kanada	273.000	276.767
Natixis SA	Frankreich	250.000	253.971
Royal Bank of Canada	Kanada	175.000	176.308
Gesamt		12.531.000	12.728.208

Die nachstehende Tabelle enthält eine Analyse des Fälligkeitsprofils der umgekehrten Repogeschäfte zum 30. September 2023.

	Währung	Fälligkeitsprofil	
		2-7 Tage Tsd.	Gesamt Tsd.
Umgekehrte Repogeschäfte			
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	EUR	1.334.000	1.334.000
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	EUR	700.000	700.000
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	EUR	5.121.000	5.121.000
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	GBP	4.908.597	4.908.597
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	GBP	2.500.460	2.500.460
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	GBP	5.230.562	5.230.562
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	USD	998.120	998.120
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	USD	9.380.100	9.380.100
BlackRock ICS US Treasury Fund	USD	12.531.000	12.531.000

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Analyse der Sicherheitenwährung

Die nachstehende Tabelle enthält eine Analyse nach Währung der Bar- und Sachsicherheiten, die der jeweilige Fonds zum 30. September 2023 in Form der Vollrechtsübertragung in Bezug auf umgekehrte Repogeschäfte erhalten hat.

Währung	Erhaltene Sach- sicherheiten
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Tsd. EUR
Umgekehrte Repogeschäfte	
EUR	1.373.737
Gesamt	1.373.737
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. EUR
Umgekehrte Repogeschäfte	
EUR	720.357
Gesamt	720.357
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Tsd. EUR
Umgekehrte Repogeschäfte	
EUR	5.233.515
Gesamt	5.233.515
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Tsd. GBP
Umgekehrte Repogeschäfte	
GBP	4.947.101
Gesamt	4.947.101
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. GBP
Umgekehrte Repogeschäfte	
GBP	2.518.539
Gesamt	2.518.539
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	Tsd. GBP
Umgekehrte Repogeschäfte	
GBP	5.253.513
Gesamt	5.253.513
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. USD
Umgekehrte Repogeschäfte	
USD	1.020.627
Gesamt	1.020.627
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	Tsd. USD
Umgekehrte Repogeschäfte	
USD	9.570.557
Gesamt	9.570.557
BlackRock ICS US Treasury Fund	Tsd. USD
Umgekehrte Repogeschäfte	
USD	12.728.208
Gesamt	12.728.208

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT)

Analyse der Art, Qualität und Fälligkeit der Sicherheit

Die nachstehende Tabelle enthält eine Analyse der Art, Qualität und Fälligkeit der von den einzelnen Fonds in Form der Vollrechtsübertragung in Bezug auf umgekehrte Repogeschäfte erhaltenen Sachsicherheiten zum 30. September 2023.

Art und Qualität der Sicherheit	Fälligkeitsprofil							Gesamt
	1 Tag	2 - 7 Tage	8 - 30 Tage	31 - 90 Tage	91 - 365 Tage	Mehr als 365 Tage	Unbefristet	
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	2.334	–	–	198.335	1.173.068	–	1.373.737
Gesamt	–	2.334	–	–	198.335	1.173.068	–	1.373.737
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	–	994	6	93.254	626.103	–	720.357
Gesamt	–	–	994	6	93.254	626.103	–	720.357
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	1.310	43.820	96.950	824.104	4.267.331	–	5.233.515
Gesamt	–	1.310	43.820	96.950	824.104	4.267.331	–	5.233.515
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	3.503.598	–	–	81.783	1.361.720	–	4.947.101
Gesamt	–	3.503.598	–	–	81.783	1.361.720	–	4.947.101
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	1.950.457	–	–	–	568.082	–	2.518.539
Gesamt	–	1.950.457	–	–	–	568.082	–	2.518.539
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	4.535.562	–	–	–	717.951	–	5.253.513
Gesamt	–	4.535.562	–	–	–	717.951	–	5.253.513

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT)

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

Art und Qualität der Sicherheit	Fälligkeitsprofil							Gesamt
	1 Tag	2 - 7 Tage	8 - 30 Tage	31 - 90 Tage	91 - 365 Tage	Mehr als 365 Tage	Unbefristet	
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	–	460	–	43.718	976.449	–	1.020.627
Gesamt	–	–	460	–	43.718	976.449	–	1.020.627
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	3.799	184.230	33.566	167.984	9.180.978	–	9.570.557
Gesamt	–	3.799	184.230	33.566	167.984	9.180.978	–	9.570.557
BlackRock ICS US Treasury Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	–	40.640	5.789	792.263	11.889.516	–	12.728.208
Gesamt	–	–	40.640	5.789	792.263	11.889.516	–	12.728.208

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

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

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

Weiterverwendung der erhaltenen Sicherheiten

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

Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

Zum 30. September 2023 werden alle Sachsicherheiten, die jeder Fonds im Rahmen von umgekehrten Repogeschäften erhält, von der Verwahrstelle des Fonds (oder durch ihre Beauftragten) gehalten, mit Ausnahme von Dreiparteien-Transaktionen mit umgekehrten Repogeschäften, die bei dem Dreiparteien-Agenten gehalten werden.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Konzentration der erhaltenen Sicherheiten

Die nachstehende Tabelle führt die zehn größten Emittenten nach Wert der vom jeweiligen Fonds IN Form der Vollrechtsübertragung erhaltenen Sachsicherheiten für Transaktionen mit umgekehrten Repogeschäften zum 30. September 2023 auf.

Emittent	Wert
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Tsd. EUR
Frankreich Staatsanleihe	1.138.862
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	81.022
Deutsche Staatsanleihe	58.152
Finnland Staatsanleihe	38.777
Bundesschatzanweisungen	38.551
Deutsche Bundesrepublik	18.372
Gesamt	1.373.737
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. EUR
Frankreich Staatsanleihe	499.234
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	180.213
Niederlande Staatsanleihe	40.910
Gesamt	720.357
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Tsd. EUR
Frankreich Staatsanleihe	3.299.366
Deutsche Staatsanleihe	571.899
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	400.432
Bundesschatzanweisungen	379.053
Niederlande Staatsanleihe	377.198
Deutsche Bundesrepublik	116.747
Bundesschatzanweisungen	47.135
Finnland Staatsanleihe	41.685
Gesamt	5.233.515
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Tsd. GBP
UK Treasury	4.947.101
Gesamt	4.947.101
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. GBP
UK Treasury	2.518.539
Gesamt	2.518.539
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	Tsd. GBP
UK Treasury	5.253.513
Gesamt	5.253.513
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. USD
Freddie Mac	500.295
US Treasury	356.522
Ginnie Mae	151.916
Fannie Mae	11.894
Gesamt	1.020.627
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	Tsd. USD
Ginnie Mae	4.704.498
Fannie Mae	3.288.437
US Treasury	1.561.527
Freddie Mac	16.095
Gesamt	9.570.557
BlackRock ICS US Treasury Fund	Tsd. USD
US Treasury	12.728.208
Gesamt	12.728.208

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT)

Glossar und Schlüsseldefinitionen

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

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

Alle diese Daten sind ungeprüft und wurden weder vom Abschlussprüfer des Fonds noch von einer dritten Partei geprüft. Der Begriff „Vermögenswerte“ bezeichnet den Gesamtwert der vom Fonds während des Bezugszeitraums gehaltenen Anlagen.

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

Haftungsausschlüsse

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

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

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

Name des Produkts:

BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund

Unternehmenskennung:

549300TSWW0QQLCYQP55

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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



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

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

Merkmale erfüllt?

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

Von dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

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

Reduzierung der CO₂-Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds.

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

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

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

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

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Produktion oder dem Vertrieb von Teer- oder Ölsanden erzielen.

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

Ausschluss von Emittenten, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt

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

Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben.

Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

Nachhaltigkeitsindikator	Messgröße	2023	2022
Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“	# Anzahl der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße
Sicherstellung, dass mindestens 80 % der Vermögenswerte des Fonds (solche, die nicht in staatlichen und öffentlichen Wertpapieren und Instrumenten angelegt sind) überdurchschnittliche Umweltpraktiken aufweisen, wie sie von MSCI oder einem anderen externen Anbieter von ESG-Research, den der Investmentmanager von Zeit zu Zeit nutzt, ermittelt wurden.	% der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel), die eine überdurchschnittliche Umweltbewertung gemäß den MSCI-Ratingkriterien aufweisen	100 %	100 %
Reduzierung der CO ₂ -Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds	CO ₂ -Emissionsintensität im Vergleich zum Anlageuniversum*	-94,84 %	k. A.**

* Dies bezieht sich auf die First Tier Credit Approved List von BlackRock Cash Management, die Liste der für unsere kurzfristigen Geldmarktfonds zulässigen Emittenten, bevor nachhaltige Kriterien angewendet wurden.

** Der Indikator wurde im Dezember 2022 in die Anlagestrategie aufgenommen, weshalb er im vorherigen Berichtszeitraum nicht berichtet wurde.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

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

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

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



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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden. Ein PAI wird partiell berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition des PAI in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) teilweise erfüllt. Ein PAI wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) vollständig erfüllt.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren				
	Reduzierung der CO2-Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung auf der Grundlage von Kernenergie oder dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen
Treibhausgasemissionen (THG) (Scope 1/2)	P				
THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird	P				
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind		P			
Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken			P		
Emissionen in Wasser			P		
Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle			P		

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren				
	Reduzierung der CO ₂ -Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung auf der Grundlage von Kernenergie oder dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen			F	F	
Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)					F

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023.

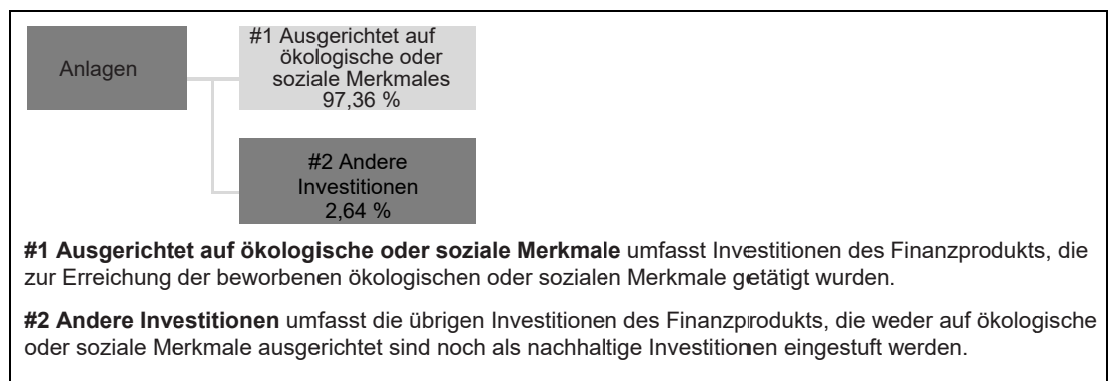
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Erste Group Bank Ag Euro	Finanzinstitute	2,19 %	Österreich
Dz Bank Ag Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	2,00 %	Deutschland
Dz Bank Ag Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	1,47 %	Deutschland
Erste Group Bank Ag Euro	Finanzinstitute	1,46 %	Österreich
Tri-Party Natwest Markets Plc	Finanzinstitute	1,45 %	Europäische Union
Op Corporate Bank Plc	Finanzinstitute	1,43 %	Finnland
Purple Protected Asset Sa Mtn Regs	Finanzinstitute	1,33 %	Luxemburg
Banque Federative Du Credit Mutuel	Finanzinstitute	1,27 %	Frankreich
Mizuho Bank Ltd (London Branch) Eu	Finanzinstitute	1,27 %	Vereinigtes Königreich
Barclays Bank Plc	Finanzinstitute	1,11 %	Vereinigtes Königreich
Dz Bank Ag Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	1,10 %	Deutschland
Dz Bank Ag Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	1,09 %	Deutschland
Societe Generale Sa Euro	Finanzinstitute	1,09 %	Frankreich
Mizuho Bank Ltd (London Branch) Eu	Finanzinstitute	1,09 %	Vereinigtes Königreich
Tri-Party Bnp Paribas	Finanzinstitute	1,09 %	Europäische Union



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensaufteilung des Fonds für den laufenden und den vorangegangenen Berichtszeitraum.

Vermögensallokation	% der Investitionen	
	2023	2022
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	97,36 %	97,88 %
#2 Andere Investitionen	2,64 %	2,12 %

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

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

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

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Banken	Banken	77,84 %
Sonstige Finanzwerte	Sonstige Finanzwerte	8,12 %
Staatsnahe Titel	Agency-Anleihen	7,09 %
Finanzunternehmen	Finanzunternehmen	2,11 %
Basiskonsumgüter	Nahrungsmittel und Getränke	1,36 %
Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	1,27 %
Technologie	Technologie	1,02 %

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

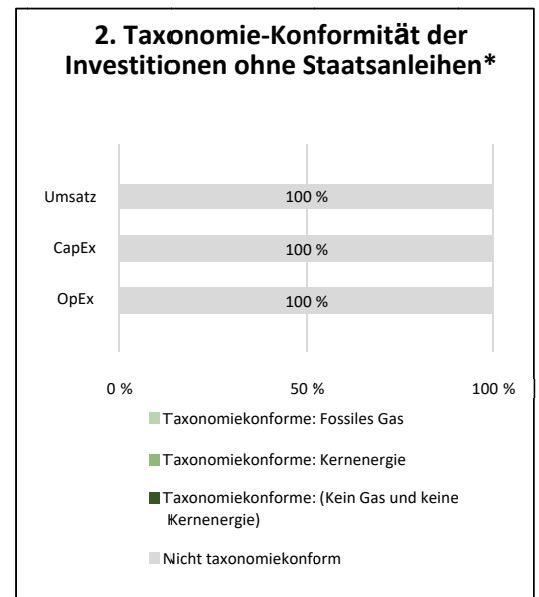
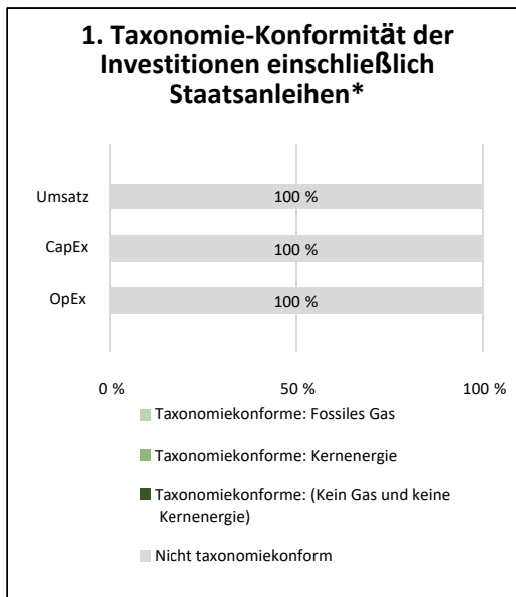
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

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



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

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



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

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

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

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

Für den vorherigen Bezugszeitraum waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.

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

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



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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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



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

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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

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



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

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

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



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

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

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

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

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

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

Name des Produkts:
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund

Unternehmenskennung:
549300YBCJ4SKWVANO22

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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



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

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

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

Von dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht erkennbarer Teile und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen.

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

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

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

Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.

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

Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition herstellen, die zum Vertrieb an Zivilpersonen bestimmt sind.

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

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

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

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

Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben.

Ausschluss aller supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

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

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden. Ein PAI wird partiell berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition des PAI in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) teilweise erfüllt. Ein PAI wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) vollständig erfüllt.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023.

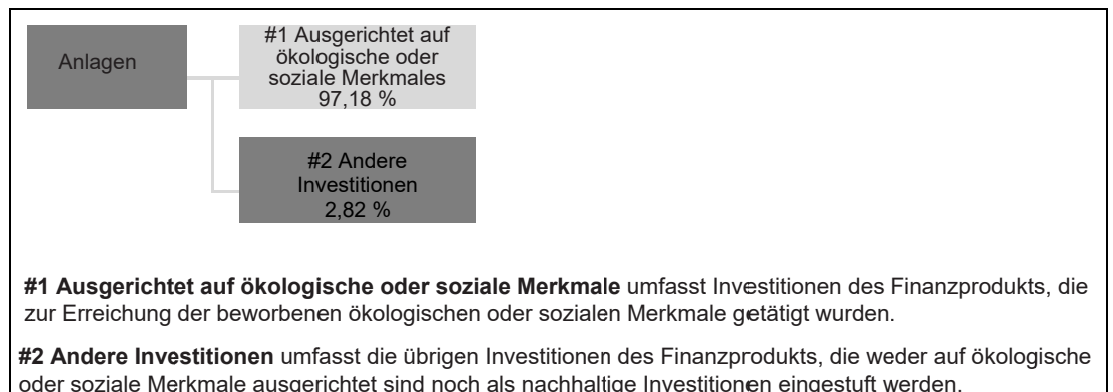
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Erste Group Bank Ag Euro	Finanzinstitute	2,16 %	Österreich
Erste Group Bank Ag Euro	Finanzinstitute	2,14 %	Österreich
Erste Group Bank Ag Euro	Finanzinstitute	1,83 %	Österreich
Banque Federative Du Credit Mutuel	Finanzinstitute	1,17 %	Frankreich
Toronto-Dominion Bank (London Branch)	Finanzinstitute	1,11 %	Vereinigtes Königreich
La Banque Postale	Staatsnahe Titel	1,04 %	Frankreich
La Banque Postale	Staatsnahe Titel	1,04 %	Frankreich
Svenska Handelsbanken Ab	Finanzinstitute	1,01 %	Schweden
Bpce Sa	Finanzinstitute	1,01 %	Frankreich
Purple Protected Asset Sa Mtn Regs	Finanzinstitute	0,98 %	Luxemburg
Agence Centrale Des Organismes De France (Republic Of) Regs	Andere	0,96 %	Frankreich
National Australia Bank Ltd (London Branch)	US-Schatzwechsel	0,94 %	Frankreich
	Finanzinstitute	0,94 %	Vereinigtes Königreich
Standard Chartered Bank	Finanzinstitute	0,94 %	Vereinigtes Königreich
Bank Of Nova Scotia Mtn Regs	Finanzinstitute	0,94 %	Kanada



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensaufteilung des Fonds für den laufenden und den vorangegangenen Berichtszeitraum.

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

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

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

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

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Banken	Banken	67,91 %
Staatsnahe Titel	Agency-Anleihen	7,90 %
Sonstige Finanzwerte	Sonstige Finanzwerte	5,99 %
Staatsnahe Titel	Kommunalanleihen	4,41 %
Finanzunternehmen	Finanzunternehmen	3,52 %
US-Schatzwechsel	US-Schatzwechsel	3,13 %
Staatsnahe Titel	Supranational	2,54 %
Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	2,07 %
Geldmarktpapiere	Sonstige	1,92 %

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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

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

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

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

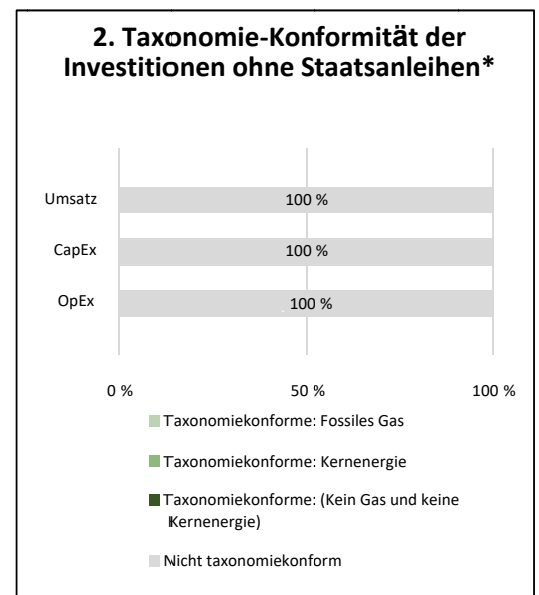
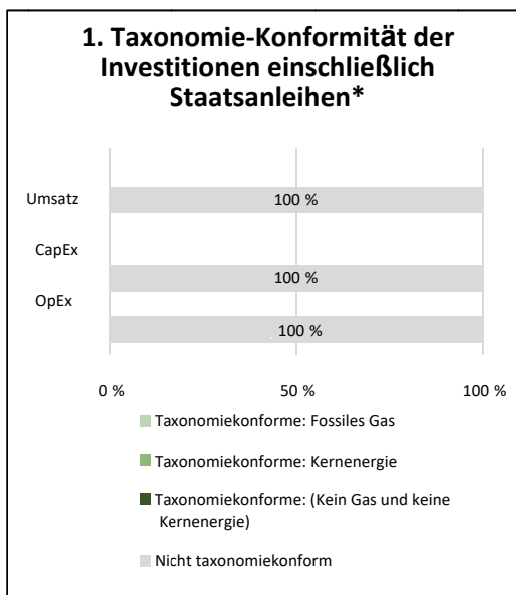
 *Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

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



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

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



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

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

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

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

Für den vorherigen Bezugszeitraum waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

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



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

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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

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



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

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

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



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

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

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

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

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

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

Name des Produkts:

BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund

Unternehmenskennung:

549300MWO3KX3D7D2N57

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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



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

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

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird

gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Von dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht erkennbarer Teile und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen.

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

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

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

Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.

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

Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition herstellen, die zum Vertrieb an Zivilpersonen bestimmt sind.

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

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

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

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

Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben.

Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

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

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden. Ein PAI wird partiell berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition des PAI in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) teilweise erfüllt. Ein PAI wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) vollständig erfüllt.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023.

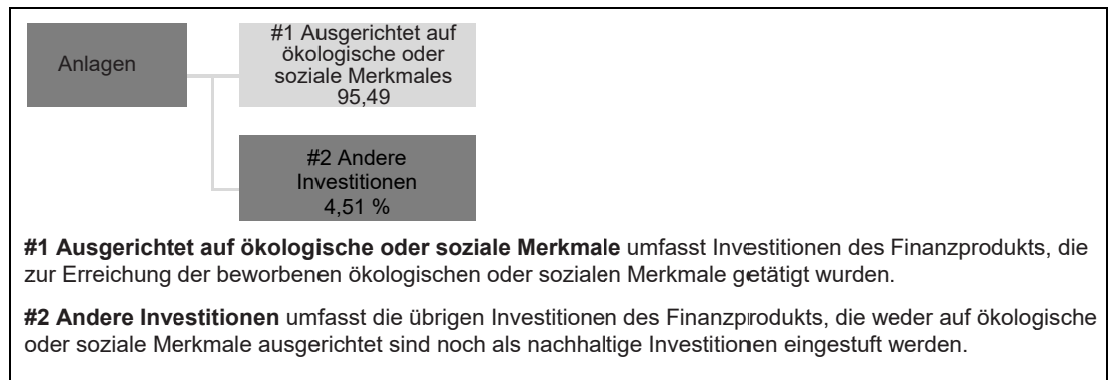
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Macquarie Bank Ltd Mtn Regs	Finanzinstitute	3,90 %	Australien
Hsbc Continental Europe Sa Regs	Finanzinstitute	2,99 %	Frankreich
Dz Bank Ag Deutsche Zentral Genoss Regs	Finanzinstitute	2,83 %	Deutschland
Purple Protected Asset Sa Mtn Regs	Finanzinstitute	2,52 %	Luxemburg
Credit Agricole Sa (London Branch)	Finanzinstitute	2,47 %	Vereinigtes Königreich
Standard Chartered Bank	Finanzinstitute	2,42 %	Vereinigtes Königreich
Toyota Motor Finance (Netherlands) Mtn Regs	Industrie	1,95 %	Niederlande
Banque Federative Du Credit Mutuel	Finanzinstitute	1,83 %	Frankreich
Standard Chartered Bank Mtn Regs	Finanzinstitute	1,64 %	Vereinigtes Königreich
Op Corporate Bank Plc Mtn	Finanzinstitute	1,61 %	Finnland
Barclays Bank Plc	Finanzinstitute	1,57 %	Vereinigtes Königreich
Abn Amro Bank Nv Mtn Regs	Finanzinstitute	1,40 %	Niederlande
Toronto-Dominion Bank (London Branch)	Finanzinstitute	1,39 %	Vereinigtes Königreich
Metropolitan Life Global Funding I Regs	Finanzinstitute	1,38 %	Vereinigte Staaten
Barclays Bank Plc	Finanzinstitute	1,34 %	Vereinigtes Königreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensaufteilung des Fonds für den laufenden und den vorangegangenen Berichtszeitraum.

Vermögensallokation	% der Investitionen	
	2023	2022
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	95,49 %	97,29 %
#2 Andere Investitionen	4,51 %	2,71 %

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

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

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

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Banken	Banken	62,54 %
Sonstige Finanzwerte	Sonstige Finanzwerte	8,47 %
Finanzunternehmen	Finanzunternehmen	7,38 %
Zyklische Konsumgüter	Auto	3,33 %
Basiskonsumgüter	Gesundheitswesen	2,89 %
Strom	Strom	2,49 %
Technologie	Technologie	2,02 %
Grundstoffe	Chemikalien	1,48 %
Versicherungen	Lebensversicherung	1,38 %
Kommunikation	Medien und Unterhaltung	1,32 %
REITs	Einzelhandel-REIT	1,30 %
Energie	Midstream	0,35 %

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

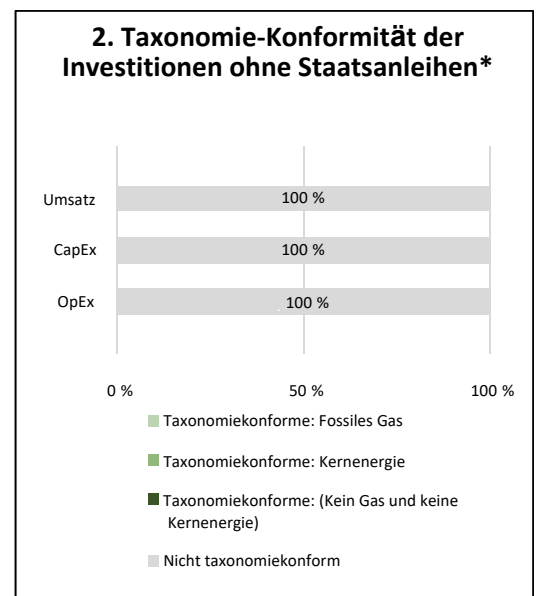
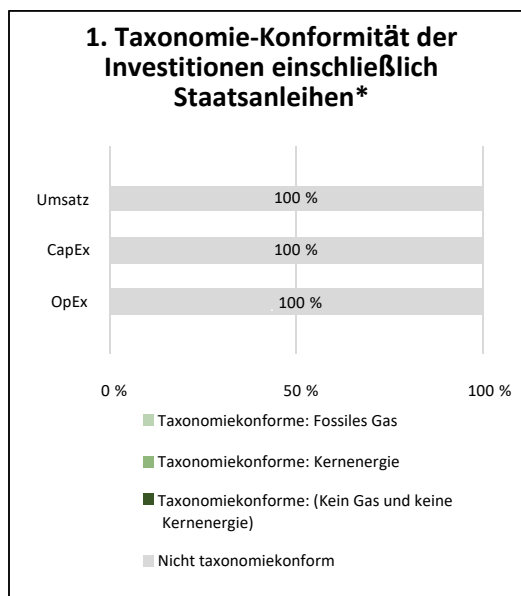
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

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



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

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



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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

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

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


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

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



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

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

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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

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



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

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

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



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

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

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrenswesen einer guten Unternehmensführung anwenden.

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



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

Name des Produkts:

BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund

Unternehmenskennung:

549300PS1MQ5RT4H4U08

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt**: _____ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt**: _____ %

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von _ % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

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

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

Von dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

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

Reduzierung der CO₂-Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds.

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

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

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

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

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Produktion oder dem Vertrieb von Teer- oder Ölsanden erzielen.

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

Ausschluss von Emittenten, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt

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

Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben.

Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

Nachhaltigkeitsindikator	Messgröße	2023	2022
Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“	# Anzahl der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße
Sicherstellung, dass mindestens 80 % der Vermögenswerte des Fonds (solche, die nicht in staatlichen und öffentlichen Wertpapieren und Instrumenten angelegt sind) überdurchschnittliche Umweltpraktiken aufweisen, wie sie von MSCI oder einem anderen externen Anbieter von ESG-Research, den der Investmentmanager von Zeit zu Zeit nutzt, ermittelt wurden.	% der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel), die eine überdurchschnittliche Umweltbewertung gemäß den MSCI-Ratingkriterien aufweisen	100 %	100 %
Reduzierung der CO2-Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds	CO2-Emissionsintensität im Vergleich zum Anlageuniversum*	-94,75 %	k. A.**

* Dies bezieht sich auf die First Tier Credit Approved List von BlackRock Cash Management, die Liste der für unsere kurzfristigen Geldmarktfonds zulässigen Emittenten, bevor nachhaltige Kriterien angewendet wurden.

** Der Indikator wurde im Dezember 2022 in die Anlagestrategie aufgenommen, weshalb er im vorherigen Berichtszeitraum nicht berichtet wurde.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

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

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

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



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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden. Ein PAI wird partiell berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition des PAI in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) teilweise erfüllt. Ein PAI wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) vollständig erfüllt.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren				
	Reduzierung der CO ₂ -Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung auf der Grundlage von Kernenergie oder dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen
Treibhausgasemissionen (THG) (Scope 1/2)	P				
THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird	P				
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind		P			
Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken			P		
Emissionen in Wasser			P		
Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle			P		

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren				
	Reduzierung der CO2-Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung auf der Grundlage von Kernenergie oder dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen			F	F	
Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)					F

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023.

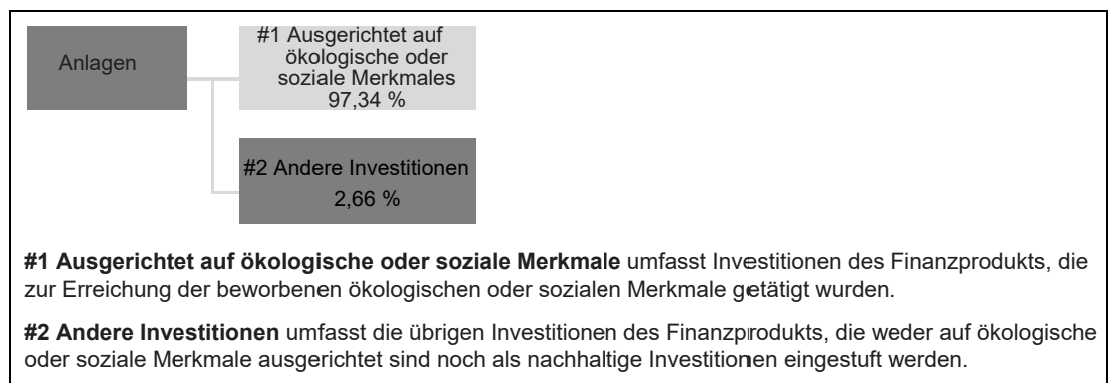
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
HM Treasury Gb	US-Schatzwechsel	1,31 %	Vereinigtes Königreich
MUFG Bank Ltd (London Branch) Gb	Finanzinstitute	1,08 %	Vereinigtes Königreich
MUFG Bank Ltd (London Branch) Gb	Finanzinstitute	1,07 %	Vereinigtes Königreich
MUFG Bank Ltd (London Branch) Gb	Finanzinstitute	1,06 %	Vereinigtes Königreich
MUFG Bank Ltd (London Branch) Gb	Finanzinstitute	1,05 %	Vereinigtes Königreich
HM Treasury Gb	US-Schatzwechsel	1,05 %	Vereinigtes Königreich
Mizuho Bank Ltd (London Branch) Gb	Finanzinstitute	0,94 %	Vereinigtes Königreich
Mizuho Bank Ltd (London Branch) Gb	Finanzinstitute	0,93 %	Vereinigtes Königreich
Mizuho Bank Ltd (London Branch) Gb	Finanzinstitute	0,92 %	Vereinigtes Königreich
Toronto-Dominion Bank (London Branch)	Finanzinstitute	0,91 %	Vereinigtes Königreich
Credit Agricole Sa (London Branch)	Finanzinstitute	0,85 %	Frankreich
Ing Bank Nv (Amsterdam Branch)	Finanzinstitute	0,81 %	Niederlande
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	Finanzinstitute	0,79 %	Vereinigtes Königreich
Rep Uk I/L Gilt Abnat	Finanzinstitute	0,79 %	Vereinigtes Königreich
Tri-Party Barclays Bank Plc	Finanzinstitute	0,79 %	Vereinigtes Königreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensaufteilung des Fonds für den laufenden und den vorangegangenen Berichtszeitraum.

Vermögensallokation	% der Investitionen	
	2023	2022
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	97,34 %	97,55 %
#2 Andere Investitionen	2,66 %	2,45 %

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

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

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Banken	Banken	84,45 %
Sonstige Finanzwerte	Sonstige Finanzwerte	4,10 %
US-Schatzwechsel	US-Schatzwechsel	3,81 %
Staatsnahe Titel	Agency-Anleihen	2,17 %
Finanzunternehmen	Finanzunternehmen	2,10 %
Zyklische Konsumgüter	Auto	1,72 %

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:


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

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

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

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

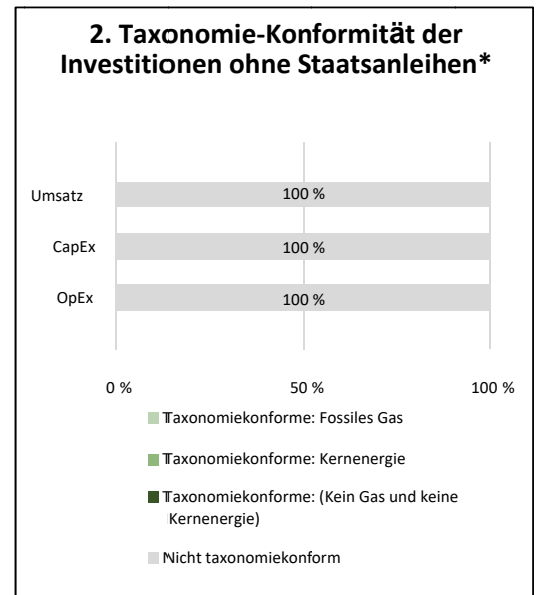
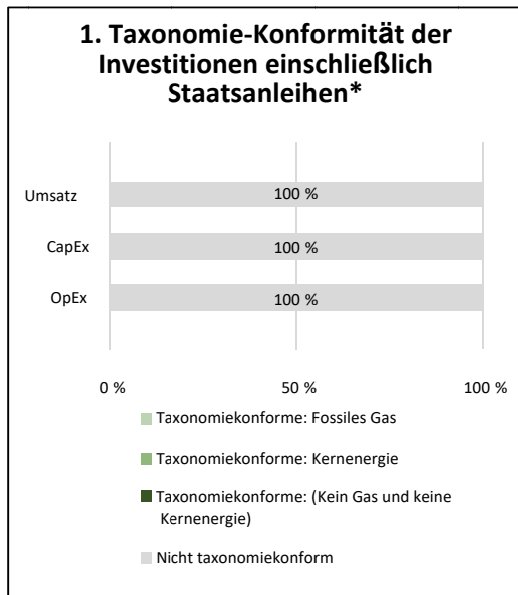
Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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



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

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



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

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

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

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

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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



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

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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

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



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

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

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



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

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

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

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

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

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



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

Name des Produkts:
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund

Unternehmenskennung:
549300KXRVZGAAWQCG88

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

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

Von dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht erkennbarer Teile und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen.

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

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

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

Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.

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

Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition herstellen, die zum Vertrieb an Zivilpersonen bestimmt sind.

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

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

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

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

Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben.

Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

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

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden. Ein PAI wird partiell berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition des PAI in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) teilweise erfüllt. Ein PAI wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) vollständig erfüllt.

NM0124U-3356337-203/233



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023.

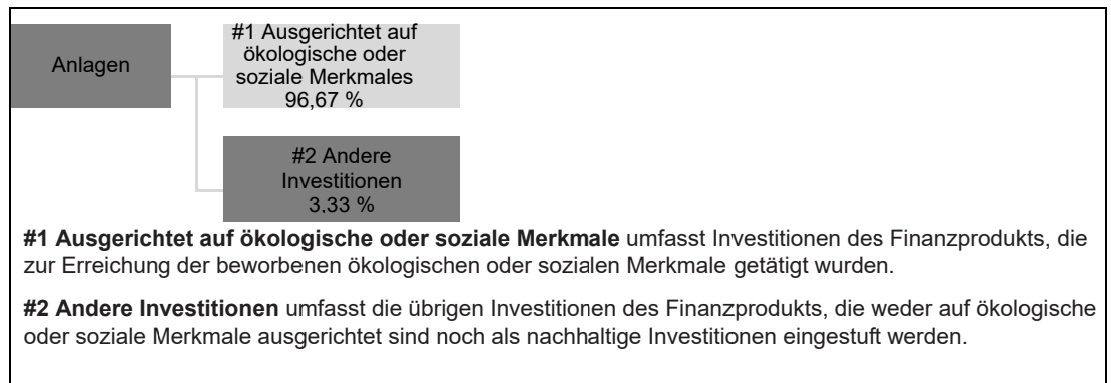
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BNP Paribas (London Branch)	Finanzinstitute	1,03 %	Vereinigtes Königreich
Toronto-Dominion Bank (London Branch)	Finanzinstitute	1,00 %	Vereinigtes Königreich
Cooperatieve Rabobank Ua Gb	Finanzinstitute	0,94 %	Niederlande
Netherlands (Kingdom Of)	Staatsnahe Titel	0,91 %	Niederlande
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	Finanzinstitute	0,90 %	Vereinigtes Königreich
Credit Agricole Sa (London Branch)	Finanzinstitute	0,89 %	Frankreich
New York Life Global Funding Mtn Regs	Finanzinstitute	0,89 %	Vereinigte Staaten
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	Finanzinstitute	0,89 %	Vereinigtes Königreich
Ing Bank Nv (Amsterdam Branch)	Finanzinstitute	0,79 %	Niederlande
Nationwide Building Society	Finanzinstitute	0,78 %	Vereinigtes Königreich
Nationwide Building Society	Finanzinstitute	0,78 %	Vereinigtes Königreich
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	Finanzinstitute	0,77 %	Vereinigtes Königreich
Royal Bank Of Canada (London Branc Mtn Regs)	Finanzinstitute	0,72 %	Vereinigtes Königreich
Canadian Imperial Bank Of Commerce Regs	Finanzinstitute	0,70 %	Kanada
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	Finanzinstitute	0,65 %	Vereinigtes Königreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensaufteilung des Fonds für den laufenden und den vorangegangenen Berichtszeitraum.

Vermögensallokation	% der Investitionen	
	2023	2022
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	96,67 %	96,12 %
#2 Andere Investitionen	3,33 %	3,88 %

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

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

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

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

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Banken	Banken	83,11 %
Staatsnahe Titel	Agency-Anleihen	3,41 %
Finanzunternehmen	Finanzunternehmen	2,98 %
Sonstige Finanzwerte	Sonstige Finanzwerte	2,40 %
Versicherungen	Lebensversicherung	1,51 %
Staatsnahe Titel	Staatsanleihen	1,44 %
Zyklische Konsumgüter	Auto	1,23 %
US-Schatzwechsel	US-Schatzwechsel	1,07 %

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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

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

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

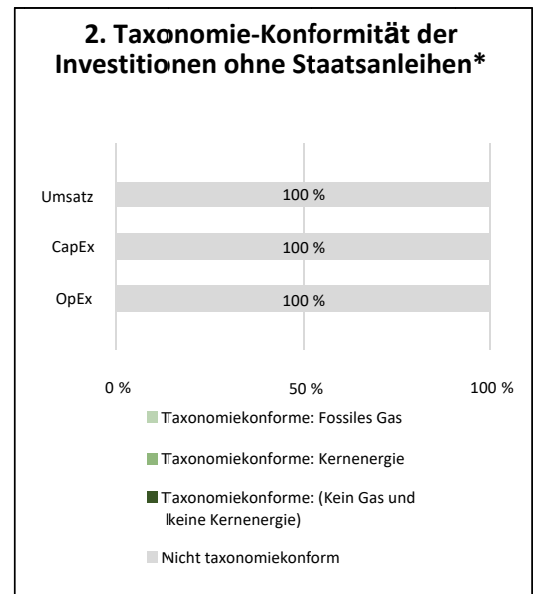
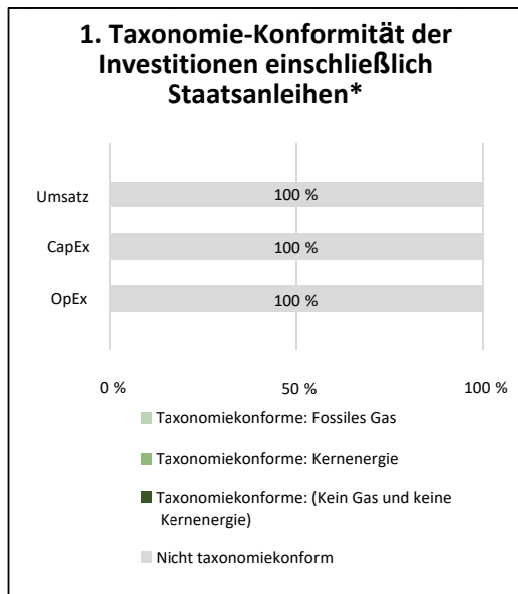
Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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



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

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



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

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

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

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

Für den vorherigen Bezugszeitraum waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

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



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

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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

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



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

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

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



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

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

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

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

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

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



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

Name des Produkts:
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund

Unternehmenskennung:
5493003GYZZKMWFM4131

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

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

Von dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

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

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden. Ein PAI wird partiell berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition des PAI in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) teilweise erfüllt. Ein PAI wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) vollständig erfüllt.



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023.

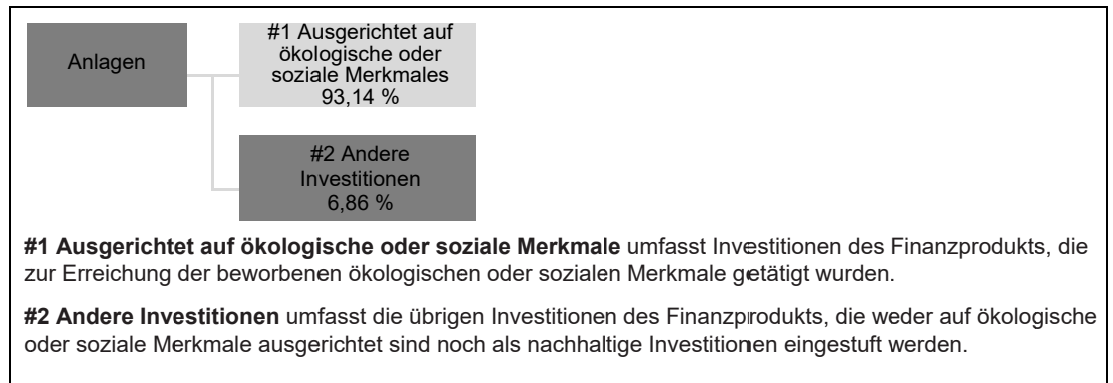
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BLK ICS Gbp Liq Agency Dis	STIF Funds	3,51 %	Irland
BNP Paribas (London Branch)	Finanzinstitute	2,30 %	Vereinigtes Königreich
Royal Bank Of Canada	Finanzinstitute	2,24 %	Vereinigtes Königreich
Societe Generale (London Branch)	Finanzinstitute	2,20 %	Vereinigtes Königreich
Jyske Bank A/S	Finanzinstitute	2,20 %	Dänemark
La Banque Postale	Staatsnahe Titel	2,19 %	Frankreich
Toyota Motor Finance (Netherlands) Mtn Regs	Industrie	2,18 %	Niederlande
Bank Of Montreal (London Branch)	Finanzinstitute	2,04 %	Vereinigtes Königreich
UBS Ag (London Branch)	Finanzinstitute	1,92 %	Vereinigtes Königreich
Op Corporate Bank Plc	Finanzinstitute	1,87 %	Finnland
Banco Santander Sa Gb	Finanzinstitute	1,62 %	Spanien
Macquarie Bank Ltd	Finanzinstitute	1,50 %	Australien
Banque Federative Du Credit Mutuel	Finanzinstitute	1,49 %	Frankreich
Banque Federative Du Credit Mutuel Regs	Finanzinstitute	1,29 %	Frankreich
Royal Bank Of Scotland Internation	Finanzinstitute	1,28 %	Jersey, Kanalinseln



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

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensaufteilung des Fonds für den laufenden und den vorangegangenen Berichtszeitraum.

Vermögensallokation	% der Investitionen	
	2023	2022
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	93,14 %	96,77 %
#2 Andere Investitionen	6,86 %	3,23 %

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

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

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

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Banken	Banken	64,80 %
Sonstige Finanzwerte	Sonstige Finanzwerte	7,67 %
Finanzunternehmen	Finanzunternehmen	6,43 %
Zyklische Konsumgüter	Auto	4,43 %
Staatsnahe Titel	Agency-Anleihen	3,70 %
Geldmarktpapiere	STIF Funds	3,51 %
Kommunikation	Medien und Unterhaltung	2,23 %
Basiskonsumgüter	Nahrungsmittel und Getränke	1,27 %
Grundstoffe	Chemikalien	1,23 %
Strom	Strom	1,22 %
Geldmarktpapiere	Sonstige	1,08 %
REITs	Einzelhandel-REIT	1,00 %
Energie	Midstream	0,32 %

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

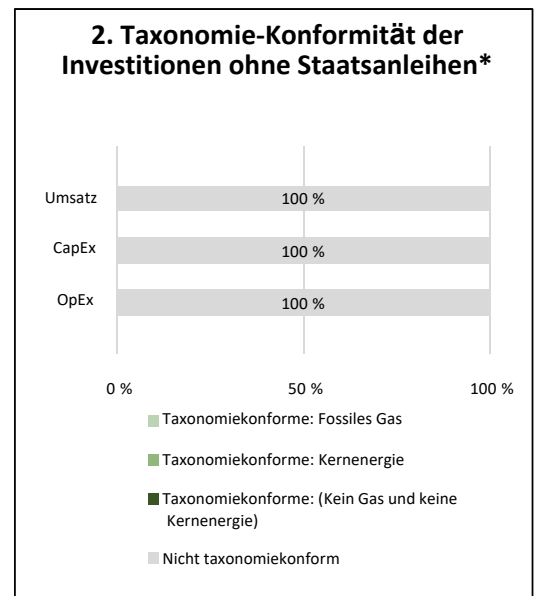
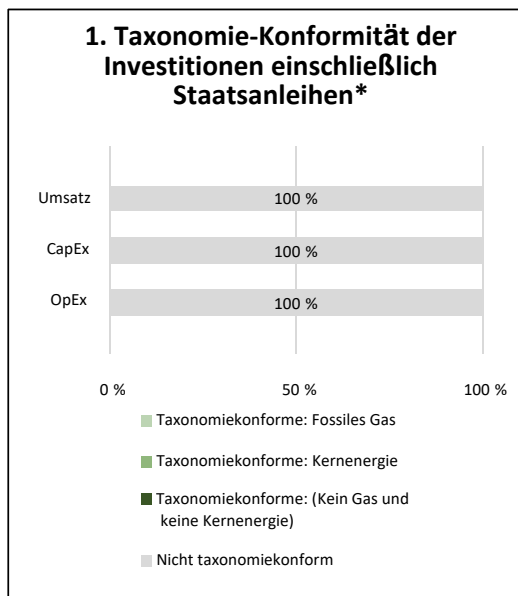
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

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



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

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



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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

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

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

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

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

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


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

Für den vorherigen Bezugszeitraum waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.



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

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

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



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

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



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

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

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



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

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

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



- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

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

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

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

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

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

Name des Produkts:

BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund

Unternehmenskennung:

549300OKSM0SGPTHJ605

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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



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

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

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird

gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Von dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

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

Reduzierung der CO2-Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds.

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

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

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

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

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Produktion oder dem Vertrieb von Teer- oder Ölsanden erzielen.

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

Ausschluss von Emittenten, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt

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

Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben.

Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

Nachhaltigkeitsindikator	Messgröße	2023	2022
Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“	# Anzahl der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße
Sicherstellung, dass mindestens 80 % der Vermögenswerte des Fonds (solche, die nicht in staatlichen und öffentlichen Wertpapieren und Instrumenten angelegt sind) überdurchschnittliche Umweltpraktiken aufweisen, wie sie von MSCI oder einem anderen externen Anbieter von ESG-Research, den der Investmentmanager von Zeit zu Zeit nutzt, ermittelt wurden	% der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel), die eine überdurchschnittliche Umweltbewertung gemäß den MSCI-Ratingkriterien aufweisen	100 %	100 %
Reduzierung der CO2-Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds	CO2-Emissionsintensität im Vergleich zum Anlageuniversum*	-93,21 %	k. A.**

* Dies bezieht sich auf die First Tier Credit Approved List von BlackRock Cash Management, die Liste der für unsere kurzfristigen Geldmarktfonds zulässigen Emittenten, bevor nachhaltige Kriterien angewendet wurden.

** Der Indikator wurde im Dezember 2022 in die Anlagestrategie aufgenommen, weshalb er im vorherigen Berichtszeitraum nicht berichtet wurde.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

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

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

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



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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden. Ein PAI wird partiell berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition des PAI in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) teilweise erfüllt. Ein PAI wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) vollständig erfüllt.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren				
	Reduzierung der CO ₂ -Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung auf der Grundlage von Kernenergie oder dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen
Treibhausgasemissionen (THG) (Scope 1/2)	P				
THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird	P				
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind		P			
Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken			P		
Emissionen in Wasser			P		
Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle			P		

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren				
	Reduzierung der CO2-Emissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Fondsbeständen) im Vergleich zum Anlageuniversum der Liquiditätsfonds	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung auf der Grundlage von Kernenergie oder dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt	Ausschluss von direkten Investitionen in Emittenten, von Geldmarktinstrumenten, die (zum Zeitpunkt der Anlage) mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen			F	F	
Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)					F

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023.

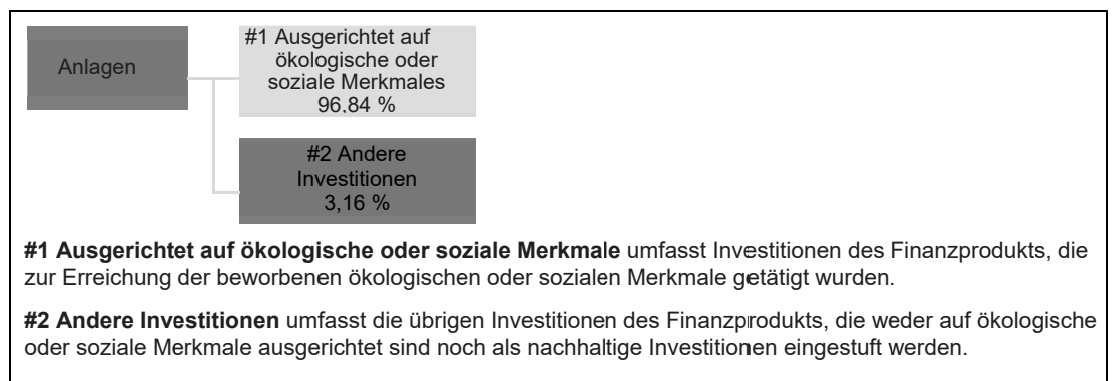
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Tri-Party Bnp Paribas	Finanzinstitute	3,32 %	Vereinigte Staaten
Tri-Party Bofa Securities Inc.	Finanzinstitute	2,95 %	Vereinigte Staaten
Tri-Party Bofa Securities Inc.	Finanzinstitute	2,90 %	Vereinigte Staaten
Tri-Party Bofa Securities Inc.	Finanzinstitute	2,55 %	Vereinigte Staaten
Tri-Party Citigroup Global Markets	Finanzinstitute	1,73 %	Vereinigte Staaten
Tri-Party Citigroup Global Markets	Finanzinstitute	1,47 %	Vereinigte Staaten
Tri-Party Bofa Securities Inc.	Finanzinstitute	1,28 %	Vereinigte Staaten
Tri-Party Citigroup Global Markets	Finanzinstitute	1,28 %	Vereinigte Staaten
Tri-Party J.P. Morgan Securities	Finanzinstitute	1,23 %	Vereinigte Staaten
Royal Bank Of Canada (Toronto Branch)	Finanzinstitute	1,15 %	Kanada
Skandinaviska Enskilda Banken Ab	Finanzinstitute	0,94 %	Vereinigte Staaten
Skandinaviska Enskilda Banken Ab	Finanzinstitute	0,94 %	Vereinigte Staaten
Skandinaviska Enskilda Banken Ab	Finanzinstitute	0,82 %	Vereinigte Staaten
Royal Bank Of Canada (Toronto Branch)	Finanzinstitute	0,77 %	Kanada
Tri-Party Bnp Paribas	Finanzinstitute	0,77 %	Vereinigte Staaten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensaufteilung des Fonds für den laufenden und den vorangegangenen Berichtszeitraum.

Vermögensallokation	% der Investitionen	
	2023	2022
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	96,84 %	96,89 %
#2 Andere Investitionen	3,16 %	3,11 %

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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

- **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**
In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, die 1 % oder mehr der Fondsanlagen ausmachen und in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.


Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Banken	Banken	60,53 %
Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	14,21 %
Staatsnahe Titel	Agency-Anleihen	7,67 %
Staatsnahe Titel	Staatsanleihen	3,63 %
Staatsnahe Titel	Kommunalanleihen	3,22 %
Sonstige Finanzwerte	Sonstige Finanzwerte	3,04 %
Finanzunternehmen	Finanzunternehmen	2,01 %
Basiskonsumgüter	Nahrungsmittel und Getränke	1,23 %
Zyklische Konsumgüter	Auto	1,13 %
US-Schatzwechsel	US-Schatzwechsel	1,00 %

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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

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

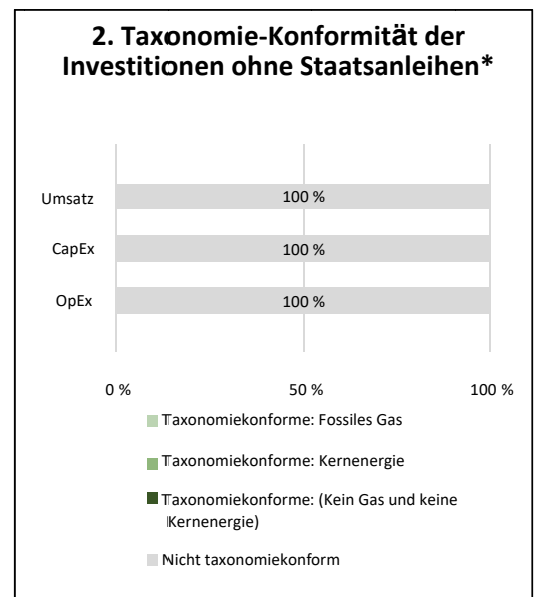
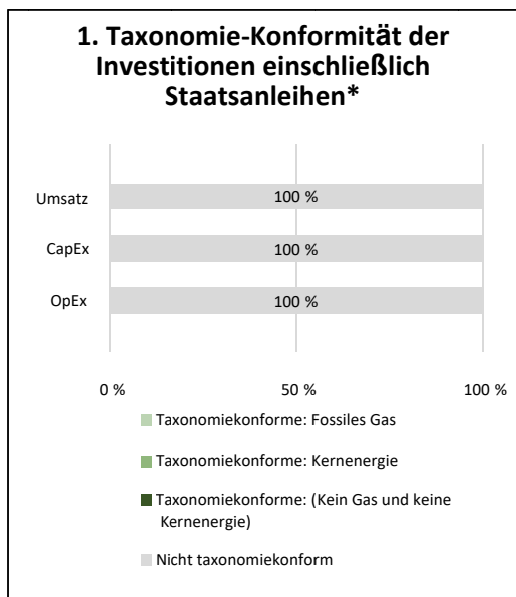
 *Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

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



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

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



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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

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



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

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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

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



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

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

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



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

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

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

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

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

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

Name des Produkts:

BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund

Unternehmenskennung:

5493003UB3VZ7MRZU371

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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



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

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

Merkmale erfüllt?

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

Von dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht erkennbarer Teile und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen.

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

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

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

Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.

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

Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition herstellen, die zum Vertrieb an Zivilpersonen bestimmt sind.

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

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

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

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

Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben.

Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.

NM0124U 3356337 221/233

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

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

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden. Ein PAI wird partiell berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition des PAI in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) teilweise erfüllt. Ein PAI wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock ergeben hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator die regulatorische Definition in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) vollständig erfüllt.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

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

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023.

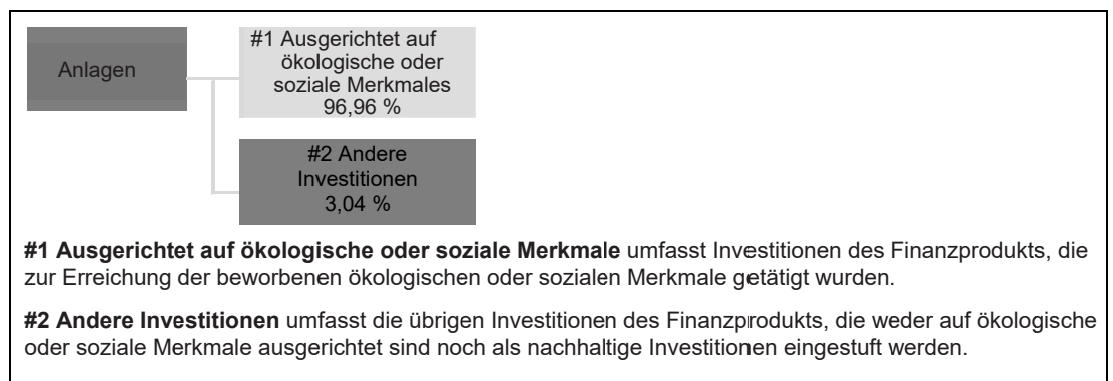
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Tri-Party J.P. Morgan Securities	Finanzinstitute	1,52 %	Vereinigte Staaten
Tri-Party Bnp Paribas	Finanzinstitute	1,36 %	Vereinigte Staaten
First Abu Dhabi Bank Usa Nv	Finanzinstitute	1,22 %	Curaçao
Royal Bank Of Canada (Toronto Branch)	Finanzinstitute	1,14 %	Kanada
Tri-Party Bnp Paribas	Finanzinstitute	0,94 %	Vereinigte Staaten
Skandinaviska Enskilda Banken Ab	Finanzinstitute	0,83 %	Vereinigte Staaten
Skandinaviska Enskilda Banken Ab	Finanzinstitute	0,82 %	Vereinigte Staaten
Tri-Party Bofa Securities Inc.	Finanzinstitute	0,76 %	Vereinigte Staaten
Tri-Party Bnp Paribas	Finanzinstitute	0,72 %	Vereinigte Staaten
First Abu Dhabi Bank Usa Nv	Finanzinstitute	0,72 %	Curaçao
Rep Us Treasury Fijpm	Sonstige	0,68 %	Vereinigte Staaten
Rep Us Treasury Fijpm	Sonstige	0,62 %	Vereinigte Staaten
Tri-Party Wells Fargo Securities	Finanzinstitute	0,58 %	Vereinigte Staaten
Tri-Party Wells Fargo Securities	Finanzinstitute	0,58 %	Vereinigte Staaten
Tri-Party Wells Fargo Securities	Finanzinstitute	0,58 %	Vereinigte Staaten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensaufteilung des Fonds für den laufenden und den vorangegangenen Berichtszeitraum.

Vermögensallokation	% der Investitionen	
	2023	2022
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	96,96 %	97,00 %
#2 Andere Investitionen	3,04 %	3,00 %

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

- **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**
In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, die 1 % oder mehr der Fondsanlagen ausmachen und in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Banken	Banken	68,38 %
Staatsnahe Titel	Agency-Anleihen	7,53 %
Sonstige Finanzwerte	Sonstige Finanzwerte	5,45 %
Geldmarktpapiere	Sonstige	3,51 %
Staatsnahe Titel	Staatsanleihen	3,31 %
Staatsnahe Titel	Kommunalanleihen	3,03 %
Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	2,62 %
Finanzunternehmen	Finanzunternehmen	1,95 %
US-Schatzwechsel	US-Schatzwechsel	1,38 %

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



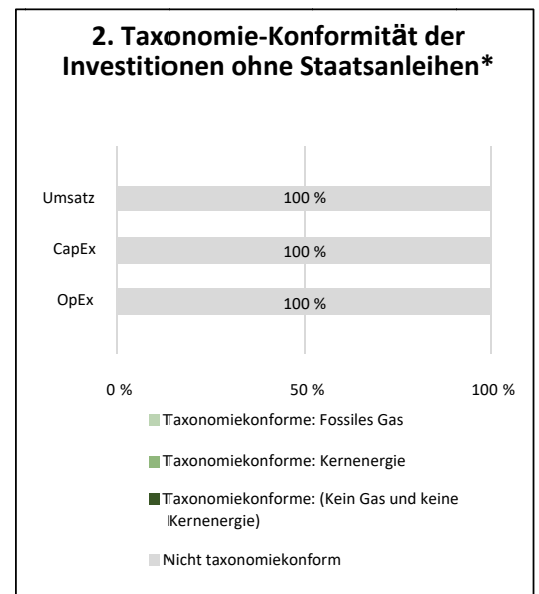
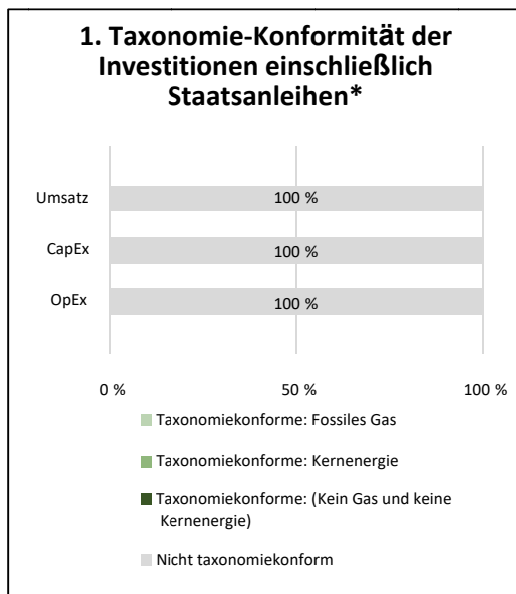
*Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilspektoren (wie im Branchenklassifikationssystem von Barclays definiert): Integriert, Unabhängig, Midstream, Ölfelddienstleistungen, Raffination oder Metall- und Bergbauunternehmen.



In welchem Maß waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**
Im Bezugszeitraum sind 0 % der Fondsanlagen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen.
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**
Für den vorherigen Bezugszeitraum waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen* mit einem Umweltziel?

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Investitionen umfassten Barmittel. Diese Bestände machen allerdings nicht mehr als 20 % aus. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Anlagen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageverwalter überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Anlageverwalter davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Verbesserungsmaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Anlageverwalter mit dem Emittenten Verbesserungsmaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageverwalter kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:

BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund

Unternehmenskennung:

549300S5H1NIVFSPNC81

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
● ● <input type="checkbox"/> Ja	● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : _____ % <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthält es einen Mindestanteil von _ % an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : _____ %	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die der Fonds während des Berichtszeitraums beworben hat. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den nachfolgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“. Er gibt Auskunft darüber, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Von dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht erkennbarer Teile und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen.

Ausschluss von Emittenten, die Einkünfte aus der direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Komponenten von Atomwaffen oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Zusatzleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen.

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen.

Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Handel und Angebot von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen.

Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition herstellen, die zum Vertrieb an Zivilpersonen bestimmt sind.

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition für zivile Zwecke erzielen.

Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten.

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen

Ausschluss von Emittenten, die ein MSCI-ESG-Rating von CCC haben.

Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben.

Ausschluss von Direktinvestitionen in supranationalen Organismen und Agenturen, die ein MSCI-ESG-Rating von B oder darunter haben.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Performance der Nachhaltigkeitsindikatoren, die zur Messung der Erreichung der einzelnen vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale verwendet werden, wie im Prospekt des Fonds näher erläutert.

Nachhaltigkeitsindikator	Messgröße	2023	2022
Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“	# Anzahl der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Die obige Tabelle gibt Aufschluss über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren im vorangegangenen Berichtszeitraum (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte beachten Sie den folgenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem beschrieben wird, wie der Fonds die PAI auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren				
	Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht erkennbarer Teile und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen	Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen	Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten	Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten	Ausschluss von Emittenten, die einen MSCI-Score für Kontroversen von „0“ haben
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind		P	P		
Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken					P
Emissionen in Wasser					P
Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle					P
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen				F	F
Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	F				

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023.

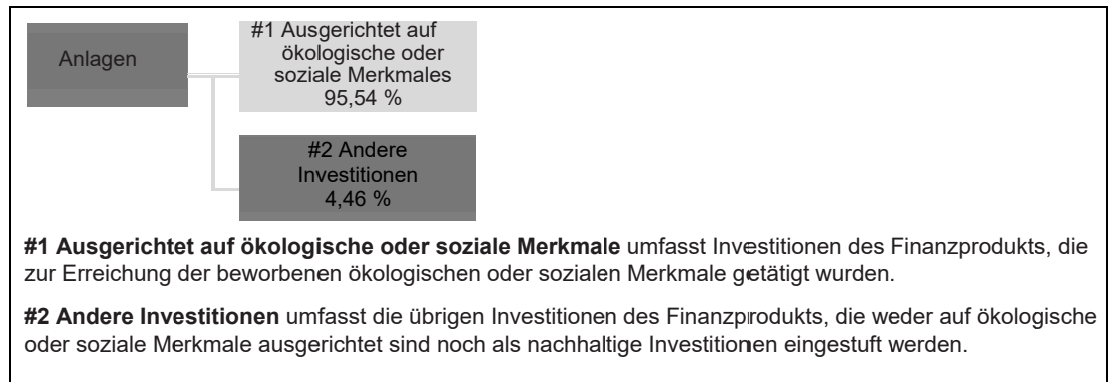
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Blk Ics Usd Liq Agency Dis	STIF Funds	4,45 %	Irland
Basf Se	Industrie	0,85 %	Deutschland
Treasury Bill	US-Schatzwechsel	0,74 %	Vereinigte Staaten
Credit Agricole Sa (London Branch)	Finanzinstitute	0,61 %	Vereinigtes Königreich
Societe Generale Sa	Finanzinstitute	0,53 %	Frankreich
Federation Des Caisses Desjardins	Finanzinstitute	0,52 %	Kanada
Bofa Securities Inc	Finanzinstitute	0,51 %	Vereinigte Staaten
Landesbank Baden-Wuerttemberg New York	Finanzinstitute	0,50 %	Vereinigte Staaten
Keurig Dr Pepper Inc	Industrie	0,50 %	Vereinigte Staaten
Nordea Bank Abp	Finanzinstitute	0,48 %	Finnland
Ubs Ag (London Branch)	Finanzinstitute	0,48 %	Vereinigtes Königreich
Equinor Asa	Staatsnahe Titel	0,48 %	Norwegen
Citigroup Global Markets Inc.	Finanzinstitute	0,47 %	Vereinigte Staaten
Bred Banque Populaire	Finanzinstitute	0,47 %	Frankreich
Op Corporate Bank Plc	Finanzinstitute	0,46 %	Finnland



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensaufteilung des Fonds für den laufenden und den vorangegangenen Berichtszeitraum.

Vermögensallokation	% der Investitionen	
	2023	2022
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	95,54 %	99,40 %
#2 Andere Investitionen	4,46 %	0,60 %

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

- **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Banken	Banken	51,38 %
Zyklische Konsumgüter	Auto	5,26 %
Sonstige Finanzwerte	Sonstige Finanzwerte	4,88 %
Geldmarktpapiere	STIF Funds	4,45 %
Staatsnahe Titel	Agency-Anleihen	4,20 %
Finanzunternehmen	Finanzunternehmen	3,85 %
Technologie	Technologie	3,09 %
Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	2,80 %
Strom	Strom	2,16 %
Grundstoffe	Chemikalien	1,84 %
Energie	Midstream	1,73 %
Zyklische Konsumgüter	Einzelhändler	1,58 %
US-Schatzwechsel	US-Schatzwechsel	1,51 %
Erdgas	Erdgas	1,45 %
Staatsnahe Titel	Kommunalanleihen	1,24 %
Basiskonsumgüter	Nahrungsmittel und Getränke	1,01 %
Grundstoffe	Metalle und Bergbau	0,12 %

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilsektoren (wie im Branchenklassifikationssystem von Barclays definiert): Integriert, Unabhängig, Ölfelddienstleistungen oder Raffination.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

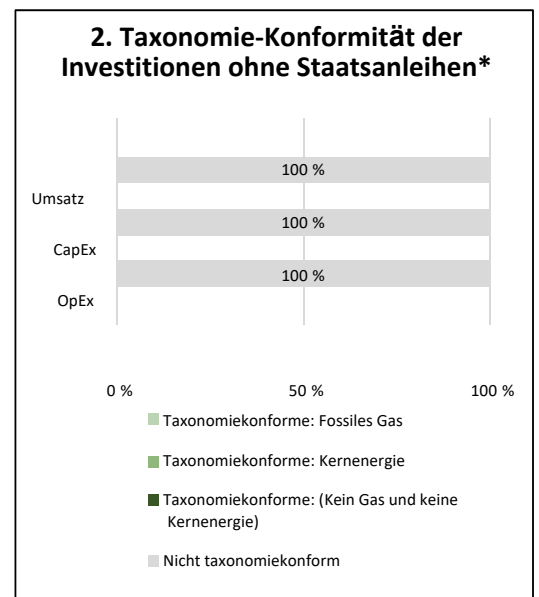
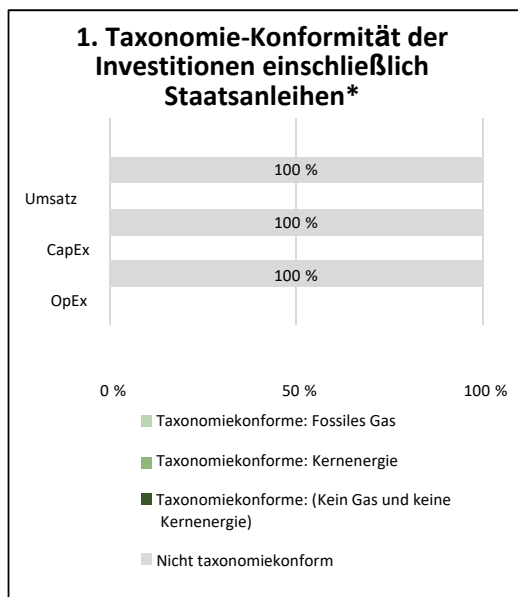
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



In welchem Maß waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum sind 0 % der Fondsanlagen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen.


- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Für den vorherigen Bezugszeitraum waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen* mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

 *Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Investitionen umfassten Barmittel und Derivate. Diese Bestände machen allerdings nicht mehr als 20 % aus. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Anlagen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Anlageverwalter hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageverwalter überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Anlageverwalter davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Verbesserungsmaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Anlageverwalter mit dem Emittenten Verbesserungsmaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageverwalter kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.



- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Sie wünschen weitere Auskünfte?

[blackrockinternational.com](https://www.blackrockinternational.com) | +44 (0)20 7743 3300

© 2024 BlackRock, Inc. Alle Rechte vorbehalten. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS und iSHARES sind Marken von BlackRock, Inc. oder ihren Tochtergesellschaften in den Vereinigten Staaten und andernorts. Sämtliche Markenzeichen sind diejenigen ihrer jeweiligen Eigentümer.

BlackRock[®]

Go paperless. . .
It's Easy, Economical and Green!
Go to www.blackrock.com/edelivery

