iShares
by BlackRock

Halbjahresbericht für das Sondervermögen

iShares SLI UCITS ETF (DE)

Für den Berichtszeitraum vom 01.05.2022 bis 31.10.2022

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2022 BIS 31.10.2022

Inhaltsverzeichnis

Hinweis und Lizenzvermerk	3
Ergänzende Angaben für Anleger in der Schweiz	4
Bericht des Vorstands	5
Halbjahresbericht für iShares SLI UCITS ETF (DE)	6
Allgemeine Informationen	11

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2022 BIS 31.10.2022

Hinweis

Das in diesem Bericht genannte Sondervermögen ist ein Fonds nach deutschem Recht. Der Kauf von Fondsanteilen erfolgt auf der Basis des zurzeit gültigen Prospekts und der Anlagebedingungen, ergänzt durch den jeweiligen letzten Jahresbericht und zusätzlich durch den jeweiligen Halbjahresbericht, falls ein solcher jüngeren Datums als der letzte Jahresbericht vorliegt.

Die in deutscher Sprache erstellten Jahres- und Halbjahresberichte wurden in andere Sprachen übersetzt.

Rechtlich bindend ist allein die deutsche Fassung.

Lizenzvermerk

Rechtliche Informationen

Die deutschen iShares Fonds, die in diesem Dokument erwähnt werden, sind Sondervermögen, die dem deutschen Kapitalanlagegesetzbuch unterliegen. Diese Fonds werden von BlackRock Asset Management Deutschland AG verwaltet und von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht reguliert.

Für Anleger in Deutschland

Die Verkaufsprospekte der in Deutschland aufgelegten Fonds sind in elektronischer Form und Druckform kostenlos bei der BlackRock Asset Management Deutschland AG, Lenbachplatz 1, 80333 München erhältlich, Tel: +49 (0) 89 42729 – 5858, Fax: +49 (0) 89 42729 – 5958, info@iShares.de.

Risikohinweise

Der Anlagewert sämtlicher iShares Fonds kann Schwankungen unterworfen sein und Anleger erhalten ihren Anlagebetrag möglicherweise nicht zurück. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung und bietet keine Garantie für einen Erfolg in der Zukunft. Anlagerisiken aus Kurs- und Währungsverlusten sowie aus erhöhter Volatilität und Marktkonzentration können nicht ausgeschlossen werden.

Index-Haftungsausschlüsse

Die in dieser Präsentation dargestellten Effekten werden von der SIX Swiss Exchange weder unterstützt, abgetreten, verkauft noch beworben. Jegliche Haftung ist ausgeschlossen. Der SLI® ist eine eingetragene Marke der SIX Swiss Exchange. Dessen Verwendung ist lizenzpflichtig.

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2022 BIS 31.10.2022

Ergänzende Angaben für Anleger in der Schweiz

Die Verkaufsprospekte inkl. Anlagebedingungen, Jahres- und Halbjahresberichte sind bei der Kapitalanlagegesellschaft kostenlos erhältlich. In einigen Ländern stellen auch die Zahl- bzw. Vertriebsstellen oder die steuerlichen Vertreter diese Informationen zur Verfügung.

Zahlstelle in der Schweiz:

State Street Bank International GmbH, München, Zweigniederlassung Zürich
Beethovenstraße 19
8027 Zürich, Schweiz

Vertreter in der Schweiz:

BlackRock Asset Management Schweiz AG
Bahnhofstrasse 39
8001 Zürich, Schweiz

Der Prospekt, die wesentlichen Informationen für den Anleger (KIIDs), die Anlagebedingungen/Satzung und die Jahres- und Halbjahresberichte des Fonds können kostenlos und auf einfache Anfrage von dem Vertreter des Fonds in der Schweiz bezogen werden. Dies gilt auch für die Aufstellung der Käufe/Verkäufe.

Zusätzliche Angaben für Investoren im Ausland:

iShares SLI UCITS ETF (DE)

Gesamtkostenquote (TER): 0,51%

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen in den vorangegangenen 12 Monaten getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Wertentwicklung des Fonds der letzten drei Kalenderjahre:

31.12.2018 - 31.12.2019	+28,55%
31.12.2019 - 31.12.2020	+5,15%
31.12.2020 - 31.12.2021	+24,77%

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2022 BIS 31.10.2022

Bericht des Vorstands

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

die BlackRock Asset Management Deutschland AG blickt auf eine dynamische Entwicklung am Markt für Exchange Traded Products (ETP) im Berichtszeitraum Q1-Q3 2022 zurück. Von dieser Entwicklung hat besonders iShares profitiert. Auf europäischer Ebene erzielte iShares in den ersten drei Quartalen 2022 Nettomittelzuflüsse von rund 31 Mrd. Euro bzw. 30,4 Mrd. US-Dollar (Vorjahreszeitraum Q1-Q3 2021: 54,9 Mrd. EUR bzw. 63,6 Mrd. US-Dollar). Unter der Marke iShares ist BlackRock weltweit Marktführer bei ETFs.

Das ETF-Angebot von iShares umfasst derzeit 651 in Deutschland zugelassene Anteilsklassen. Dies ermöglicht Investoren hierzulande einen einfachen und diversifizierten Zugang zu einer Vielzahl von weltweiten Märkten und Anlageklassen. Rund ein Zehntel (64) dieser Anteilsklassen sind in Deutschland aufgelegt und am „(DE)“ im Fondsnamen erkennbar.

Zum 31. Oktober 2022 betrug das verwaltete Volumen der deutschen Fonds 39,3 Milliarden Euro bzw. 38,9 Milliarden US-Dollar. Das darin enthaltene Volumen der 23 zum öffentlichen Vertrieb zugelassenen Teilgesellschaftsvermögen (TGVs) betrug zum selben Stichtag 8,4 Milliarden Euro bzw. 8,3 Milliarden US-Dollar. Der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie detailliert über die Entwicklung unserer Indexfonds.

Es mehren sich die Anzeichen für eine Rezession der deutschen Wirtschaft im Sinne eines deutlichen, breit angelegten und länger anhaltenden Rückgangs der Wirtschaftsleistung. Dies ist in erster Linie darauf zurückzuführen, dass sich die gesamtwirtschaftlichen Angebotsbedingungen – insbesondere die Energieversorgung – infolge des Angriffskrieges Russlands gegen die Ukraine erheblich verschlechterten. Die hohe Inflation und die Unsicherheit in Bezug auf die Energieversorgung und ihre Kosten beeinträchtigen dabei nicht nur die gas- und stromintensive Industrie sowie deren Exportgeschäfte und Investitionen, sondern auch den privaten Konsum und die davon abhängigen Dienstleister.

Nachdem die Wirtschaftsleistung im zweiten Quartal noch leicht gestiegen war, geht sie wohl im laufenden Quartal etwas zurück. Der Einstieg im Juli war bereits durchwachsen. So konnte der Einzelhandel seine realen Umsätze steigern, und der Wegfall der meisten Corona-Schutzmaßnahmen dürfte in Gastronomie und Tourismus noch etwas nachgewirkt haben. Industrie und Bauhauptgewerbe produzierten jedoch spürbar weniger als im Vormonat. Im August waren die Unternehmen laut ifo Institut weniger zufrieden mit den laufenden Geschäften und sahen unverändert pessimistisch in die Zukunft. Die Einkaufsmanager meldeten gemäß S&P Global nachlassende Geschäfte in Industrie und im Dienstleistungssektor. Der vom Marktforschungsinstitut GfK ermittelte Konsumklimaindex sank das dritte Mal in Folge und erreichte ein neues Rekordtief, vor allem, weil die Sparneigung der Verbraucher stark anstieg.

Die schlechte Stimmung in der deutschen Wirtschaft und bei den Verbraucherinnen und Verbrauchern spiegelt auch die jüngst zugespitzte Versorgungslage am Gasmarkt wider, die zudem auf den Strompreis ausstrahlt. Nachdem die russischen Gaslieferungen nach Deutschland weitgehend eingestellt wurden, ist die Lage bei der Gasversorgung in den kommenden Monaten äußerst angespannt. Allerdings könnte aus heutiger Sicht die formale Rationierung von Gas auch ohne die Lieferungen über die Pipeline Nord Stream 1 wohl gerade noch vermieden werden – dank der höheren Lieferungen aus anderen Ländern und der Fortschritte bei Verbrauchseinsparungen und Gaseinspeicherungen. Dafür ist jedoch eine weitere, erhebliche Minderung des Gasverbrauchs notwendig – insbesondere auch bei den privaten Haushalten. Die Gaseinsparungen gehen zum Teil mit ähnlichen Effekten wie eine Rationierung einher, wenn Unternehmen ihre Produktion aus Wirtschaftlichkeitsgründen drosseln oder ganz einstellen. Alles in allem dürfte die Wirtschaftsleistung im vierten Quartal merklich zurückgehen. Dies dürfte wohl auch für das erste Quartal des kommenden Jahres gelten. Ein Einbruch vom Ausmaß des in der Juni- Projektion erstellten adversen Szenarios ist dabei zwar aus heutiger Sicht nicht zu befürchten. Der Ausblick ist jedoch ausgesprochen unsicher.

Institutionelle und private Anleger schätzen iShares ETFs nicht nur als Portfolio-Bausteine, um eigene Anlageideen umzusetzen. Mit zunehmender Verbreitung der Fonds steigt auch die Nachfrage nach ETF-basierten Versicherungslösungen, ETF-Sparplänen und vermögensverwaltenden Produkten auf ETF-Basis. Vor diesem Hintergrund haben wir gemeinsam mit Partnern Modelle konzipiert, die Anlegertypen mit unterschiedlichen Chance-Risiko-Profilen Vorschläge für geeignete Vermögensaufstellungen bieten. Dazu gehörten im Berichtszeitraum die Entwicklung von Musterportfolios für Banken, verschiedene Online-Broker und Anbieter digitaler Vermögensverwaltungsangebote, so genannter „Robo Advisors“. Im europäischen ETF-Markt ist iShares als Anbieter der ersten Stunde unverändert hervorragend positioniert. Wir investieren weiter in exzellenten Service und Produkte, die den Bedürfnissen unserer Kunden gerecht werden. Mit der kontinuierlichen und innovativen Erweiterung unseres Angebots wollen wir unsere Marktführerschaft weiter ausbauen. Zu den strategischen Wettbewerbsvorteilen der iShares ETFs gehören hohe Marktliquidität, enge Bid/Ask Spreads sowie eine hohe Genauigkeit bei der Indexnachbildung.

Für weitere Informationen besuchen Sie bitte unsere Website www.iShares.de oder rufen Sie uns gerne an unter +49 (0) 89 42729 - 5858.

Wir danken Ihnen für Ihr Vertrauen und freuen uns auf eine weiterhin partnerschaftliche Zusammenarbeit.

Ihr Vorstand der BlackRock Asset Management Deutschland AG



Dirk Schmitz



Harald Klug



Peter Scharl



Birgit Ludwig

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2022 BIS 31.10.2022

Vermögensübersicht zum 31.10.2022

	Kurswert in CHF	% des Fonds-vermögens[1)]
I. Vermögensgegenstände	**304.985.599,15**	**100,04**
1. Aktien	**301.617.263,59**	**98,94**
Finanzsektor	76.792.316,61	25,19
Gesundheits- und Pflegewesen	69.220.894,62	22,71
Handel und Dienstleistung	80.067.652,50	26,26
Herstellung industr. Grundstoffe und Halbfabrikate	21.882.737,92	7,18
Industrielle Produktion incl. Bauindustrie	17.066.614,76	5,60
Nahrungsherstellung und Produktion v. Konsumgütern	27.272.212,48	8,95
Technologiesektor	3.678.331,80	1,21
Telekommunikation	5.636.502,90	1,85
2. Derivate	**-10.126,80**	**-0,00**
Finanzterminkontrakte	-10.126,80	-0,00
3. Forderungen	**1.532.654,46**	**0,50**
4. Bankguthaben	**1.499.124,10**	**0,49**
5. Sonstige Vermögensgegenstände	**346.683,80**	**0,11**
II. Verbindlichkeiten	**-124.009,87**	**-0,04**
Sonstige Verbindlichkeiten	-124.009,87	-0,04
III. Fondsvermögen	**304.861.589,28**	**100,00**

1) Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2022 BIS 31.10.2022

Vermögensaufstellung zum 31.10.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.10.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in CHF	% des Fonds-vermögens[2)]
Wertpapiervermögen									**301.617.263,59**	**98,94**
Börsengehandelte Wertpapiere									**301.617.263,59**	**98,94**
Aktien									**273.341.202,19**	**89,66**
ABB Ltd. Namens-Aktien SF 0,12	CH0012221716		STK	507.814	61.825	6.921	CHF	27,840	14.137.541,76	4,64
Adecco Group AG Namens-Aktien SF 0,1	CH0012138605		STK	75.711	7.843	705	CHF	31,340	2.372.782,74	0,78
Alcon AG Namens-Aktien SF -,04	CH0432492467		STK	207.853	20.670	14.502	CHF	60,940	12.666.561,82	4,15
ams-OSRAM AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000A18XM4		STK	123.645	14.074	1.198	CHF	5,676	701.809,02	0,23
Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien SF 1	CH0210483332		STK	132.549	12.201	5.680	CHF	97,940	12.981.849,06	4,26
Credit Suisse Group AG Namens-Aktien SF -,04	CH0012138530		STK	1.129.877	127.644	13.897	CHF	4,130	4.666.392,01	1,53
Geberit AG Nam.-Akt. (Dispost.) SF -,10	CH0030170408		STK	16.095	1.811	196	CHF	445,300	7.167.103,50	2,35
Givaudan SA Namens-Aktien SF 10	CH0010645932		STK	3.567	399	42	CHF	2.990,000	10.665.330,00	3,50
Holcim Ltd. Namens-Aktien SF 2	CH0012214059		STK	253.061	28.415	3.074	CHF	45,480	11.509.214,28	3,78
Julius Baer Gruppe AG Namens-Aktien SF -,02	CH0102484968		STK	95.979	8.151	1.474	CHF	47,970	4.604.112,63	1,51
Kühne & Nagel Internat. AG Namens-Aktien SF 1	CH0025238863		STK	25.512	2.879	314	CHF	213,400	5.444.260,80	1,79
Logitech International S.A. Namens-Aktien SF -,25	CH0025751329		STK	73.788	6.337	2.426	CHF	49,850	3.678.331,80	1,21
Lonza Group AG Namens-Aktien SF 1	CH0013841017		STK	26.439	3.929	361	CHF	515,400	13.626.660,60	4,47
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350		STK	250.112	25.994	19.048	CHF	109,040	27.272.212,48	8,95
Novartis AG Namens-Aktien SF 0,50	CH0012005267		STK	349.546	33.296	44.149	CHF	80,900	28.278.271,40	9,28
Partners Group Holding AG Namens-Aktien SF -,01	CH0024608827		STK	10.173	1.138	122	CHF	899,400	9.149.596,20	3,00
Schindler Holding AG Inhaber-Part.sch. SF -,10	CH0024638196		STK	18.290	2.020	167	CHF	163,250	2.985.842,50	0,98
SGS S.A. Namens-Aktien SF 1	CH0002497458		STK	2.718	296	24	CHF	2.209,000	6.004.062,00	1,97
Sika AG Namens-Aktien SF 0,01	CH0418792922		STK	62.063	13.712	794	CHF	225,800	14.013.825,40	4,60
Sonova Holding AG Namens-Aktien SF 0,05	CH0012549785		STK	21.397	1.927	1.829	CHF	236,700	5.064.669,90	1,66
Straumann Holding AG Namens-Aktien SF 0,01	CH1175448666		STK	50.779	5.839	625	CHF	95,380	4.843.301,02	1,59
Swatch Group AG, The Inhaber-Aktien SF 2,25	CH0012255151		STK	12.995	1.433	119	CHF	225,400	2.929.073,00	0,96
Swiss Life Holding AG Namens-Aktien SF 0,10	CH0014852781		STK	13.829	1.276	172	CHF	484,900	6.705.682,10	2,20
Swiss Re AG Namens-Aktien SF -,10	CH0126881561		STK	129.642	14.859	1.846	CHF	74,400	9.645.364,80	3,16
Swisscom AG Namens-Aktien SF 1	CH0008742519		STK	11.403	1.287	140	CHF	494,300	5.636.502,90	1,85
Temenos AG Nam.-Aktien SF 5	CH0012453913		STK	30.236	3.440	279	CHF	59,700	1.805.089,20	0,59
UBS Group AG Namens-Aktien SF -,10	CH0244767585		STK	885.663	103.069	109.749	CHF	15,890	14.073.185,07	4,62
VAT Group AG Namens-Aktien SF -,10	CH0311864901		STK	12.083	1.336	111	CHF	228,800	2.764.590,40	0,91
Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien SF 0,10	CH0011075394		STK	65.406	5.656	976	CHF	427,300	27.947.983,80	9,17
Sonstige Beteiligungswertpapiere									**28.276.061,40**	**9,28**
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	CH0012032048		STK	85.028	14.226	8.393	CHF	332,550	28.276.061,40	9,28
Derivate									**-10.126,80**	**-0,00**
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
Aktienindex-Derivate									**-10.126,80**	**-0,00**
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte									**-10.126,80**	**-0,00**
Swiss Leader Index Future (FSLI) Dez. 22		EDT	Anzahl	199			CHF		-10.126,80	-0,00
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									**1.499.124,10**	**0,49**
Bankguthaben									**1.499.124,10**	**0,49**
EUR-Guthaben									**7.904,47**	**0,00**
Verwahrstelle: State Street Bank International GmbH			EUR	7.991,65			%	100,000	7.904,47	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									**1.491.219,63**	**0,49**
Verwahrstelle: State Street Bank International GmbH			CHF	1.491.219,63			%	100,000	1.491.219,63	0,49

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2022 BIS 31.10.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.10.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in CHF	% des Fonds-ver-mögens[2)]
Sonstige Vermögensgegenstände								**1.879.338,26**	**0,62**
Quellensteuerrückerstattungsansprüche			CHF	1.532.654,46				1.532.654,46	0,50
Initial Margin			CHF	328.000,00				328.000,00	0,11
Geleistete Variation Margin			CHF	18.683,80				18.683,80	0,01
Sonstige Verbindlichkeiten								**-124.009,87**	**-0,04**
Verwaltungsvergütung			CHF	-120.876,02				-120.876,02	-0,04
Sonstige Verbindlichkeiten			EUR	-3.168,41				-3.133,85	-0,00

Fondsvermögen	**CHF**	**304.861.589,28**	**100,00**
Anteilwert	CHF	112,08	
Umlaufende Anteile	STK	2.720.000	

2) Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Wertpapiere					
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Accelleron Industries Ltd. Namens-Aktien SF 0,01	CH1169360919	STK	24.214	24.214	
Derivate					
(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					**4.095**

Basiswert(e):
Swiss Leader Index (Price) (CHF) (SLI)

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2022 BIS 31.10.2022

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.05.2022 bis 31.10.2022

I. Erträge		
1. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	CHF	1.478.666,46
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	CHF	-7.248,13
3. Abzug ausländischer Quellensteuer	CHF	-406.546,27
Summe der Erträge	**CHF**	**1.064.872,06**
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	CHF	-103,91
2. Verwaltungsvergütung	CHF	-799.772,29
3. Sonstige Aufwendungen	CHF	-19.774,74
Summe der Aufwendungen	**CHF**	**-819.650,94**
III. Ordentlicher Nettoertrag	**CHF**	**245.221,12**
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	CHF	1.032.396,32
2. Realisierte Verluste	CHF	-666.198,81
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	**CHF**	**366.197,51**
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	**CHF**	**611.418,63**
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	CHF	-30.461.770,70
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	CHF	-11.732.510,64
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	**CHF**	**-42.194.281,34**
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	**CHF**	**-41.582.862,71**

Negative Einlagezinsen werden mit den Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland verrechnet. Dies kann zu einem negativen Ausweis der „Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland“ führen.

Entwicklung des Sondervermögens

				2022
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres			**CHF**	**325.934.025,41**
1. Ausschüttung für das Vorjahr			CHF	-4.125.597,70
2. Mittelzufluss/Mittelabfluss (netto)			CHF	24.682.593,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	CHF	27.631.228,00		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	CHF	-2.948.635,00		
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			CHF	-46.568,72
4. Ergebnis des Geschäftsjahres			CHF	-41.582.862,71
davon nicht realisierte Gewinne	CHF	-30.461.770,70		
davon nicht realisierte Verluste	CHF	-11.732.510,64		
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres			**CHF**	**304.861.589,28**

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2022 BIS 31.10.2022

Anhang

Sonstige Angaben

Anzahl umlaufende Anteile und Wert eines Anteils am Berichtsstichtag gem. § 16 Abs. 1 Nr. 1 KARBV

Anteilwert	CHF	112,08
Umlaufende Anteile	STK	2.720.000

Angaben zum Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände gem. § 16 Abs. 1 Nr. 2 KARBV

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Derivate:	Schlusskurse des jeweiligen Bewertungstages
Sämtliche Wertpapiere:	Schlusskurse des jeweiligen Bewertungstages

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Berichtszeitraumes sowie zum Berichtsstichtag grundsätzlich auf Basis handelbarer Börsenkurse.
Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Die Bewertung von Derivaten, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen sind, erfolgt zum Schlusskurs des jeweiligen Bewertungstages.

Die Bewertung von Bankguthaben und bestehenden Forderungen erfolgt zum aktuellen Nennwert. Die bestehenden Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.10.2022

Euro	(EUR)	1,01103 = 1 Schweizer Franken (CHF)

Marktschlüssel

a) Terminbörsen

EDT	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

Angaben für Indexfonds gem. § 16 Abs. 2 KARBV

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums gem. § 16 Abs. 2 Nr. 1 KARBV	0,41 Prozentpunkte

Weitere zum Verständnis des Berichts erforderliche Angaben gem. § 7 Nr. 9 d) KARBV

Erläuterung zur Berechnung der Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nichtrealisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

Zusätzliche Anhangangaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Im Berichtszeitraum wurden keine Geschäfte i.S.d. Artikel 3 Nr. 11 bzw. Nr. 18 der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012, d.h. Wertpapierfinanzierungsgeschäfte oder Gesamtrendite-Swaps, abgeschlossen.

München, den 31. Oktober 2022
BlackRock Asset Management Deutschland AG (KVG)



Peter Scharl **Harald Klug**

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2022 BIS 31.10.2022

Allgemeine Informationen

Verwaltungsgesellschaft

BlackRock Asset Management Deutschland AG
Lenbachplatz 1
80333 München

Grundkapital per 31.12.2021: 5 Mio. EUR

Haftendes Eigenkapital per 31.12.2021: 67,07 Mio. EUR

Gesellschafter

BlackRock Investment Management (UK) Limited

Geschäftsführung

Dirk Schmitz
Vorstandsvorsitzender
Frankfurt

Harald Klug
Vorstand
München

Peter Scharl
Vorstand
München

Birgit Ludwig
Vorstand
Frankfurt

Aufsichtsrat

Michael Rüdiger (Vorsitzender)
Unabhängiger Aufsichtsrat und Stiftungsrat
Utting am Ammersee

Jane Sloan (stellvertretende Vorsitzende)
BlackRock, Managing Director, Head of Sales EMEA iShares
London, UK

Justine Anderson
BlackRock, Managing Director, COO EMEA
London, UK

Verwahrstelle

State Street Bank International GmbH
Brienner Straße 59
80333 München, Deutschland

Wirtschaftsprüfer

PricewaterhouseCoopers GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Bernhard-Wicki-Straße 8
80636 München, Deutschland

Want to know more?

iShares.de | +49 (0) 89 42729 - 5858

© 2022 BlackRock, Inc. Sämtliche Rechte vorbehalten. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS und iSHARES sind eingetragene Handelsmarken von BlackRock, Inc. oder ihren Niederlassungen in den USA und anderen Ländern. Alle anderen Marken sind Eigentum der jeweiligen Rechtinhaber.

iShares
by BlackRock

Go paperless. . .
It's Easy, Economical and Green!
Go to **www.blackrock.com/edelivery**

NM1222U-2651951-12/12