

Halbjahresbericht für das Sondervermögen

iShares SLI UCITS ETF (DE)

Für den Berichtszeitraum vom 01.05.2021 bis 31.10.2021

**HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM
01.05.2021 BIS 31.10.2021**

Inhaltsverzeichnis

Hinweis und Lizenzvermerk	3
Ergänzende Angaben für Anleger in Liechtenstein, Frankreich und 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 01.05.2021 BIS 31.10.2021

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 jüngerem 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 01.05.2021 BIS 31.10.2021**Ergänzende Angaben für Anleger in Liechtenstein, Frankreich und der Schweiz**

Bei der jeweiligen Zahl- bzw. Vertriebsstelle sind die entsprechenden Verkaufsprospekte inkl. Anlagebedingungen, Jahres- und Halbjahresberichte kostenlos erhältlich.

Zahl- und Vertriebsstelle in Liechtenstein:

Verwaltungs- und Privatbank Aktiengesellschaft
Im Zentrum
9490 Vaduz, Fürstentum Liechtenstein

Zahl- und Vertriebsstelle in Frankreich:

BNP Paribas Securities Services
20, BD. des Italiens
75009 Paris, Frankreich

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:

31.12.2017 - 31.12.2018	-12,97%
31.12.2018 - 31.12.2019	+28,55%
31.12.2019 - 31.12.2020	+5,15%

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 31.10.2021**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 2021 zurück. Von dieser Entwicklung hat besonders iShares profitiert. Auf europäischer Ebene erzielte iShares in den ersten drei Quartalen 2021 Nettomittelzuflüsse von rund 54,9 Mrd. Euro bzw. 63,6 Mrd. US-Dollar (Vorjahreszeitraum 2020: 27,6 Mrd. EUR bzw. 32,3 Mrd. US-Dollar). Unter der Marke iShares ist BlackRock weltweit Marktführer bei ETFs.

Das ETF-Angebot von iShares umfasst derzeit 579 in Deutschland zugelassene Anteilsklassen. Dies ermöglicht Investoren hierzulande einen einfachen und diversifizierten Zugang zu einer Vielzahl von weltweiten Märkten und Anlageklassen. Rund ein Zehntel (60) dieser Anteilsklassen sind in Deutschland aufgelegt und am „(DE)“ im Fondsnamen erkennbar.

Zum 31. Oktober 2021 betrug das verwaltete Volumen der deutschen Fonds 47,8 Milliarden Euro bzw. 55,4 Milliarden US-Dollar. Das darin enthaltene Volumen der 21 zum öffentlichen Vertrieb zugelassenen Teilgesellschaftsvermögen (TGVs) betrug zum selben Stichtag 9,9 Milliarden Euro bzw. 11,4 Milliarden US-Dollar. Der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie detailliert über die Entwicklung unserer Indexfonds.

Die Hoffnung einer vollständigen Normalisierung der Wirtschaftsaktivität schon im Jahr 2021 hat sich bisher nicht erfüllt. Trotz der Entwicklung und Bereitstellung hochwirksamer Impfstoffe gegen Covid-19 blieben in den Industrieländern Beeinträchtigungen der Mobilität länger und teilweise umfassender bestehen als zu Jahresbeginn erwartet, während in Schwellen- und Entwicklungsländern der Impffortschritt weit zurückhängt. In Summe bleibt die Dynamik des wirtschaftlichen Neustarts heraus aus der Covid-Pandemie enttäuschend. In jüngerer Zeit tragen dazu Angebotsengpässe bei. Hat sich mit der Öffnung von Lockdowns die Nachfrage wieder sprunghaft Bahn gebrochen, stand dieser in vielen Fällen ein eingeschränktes Angebot gegenüber. Lieferketten, die infolge der Pandemie unterbrochen und noch nicht überall komplett wieder hergestellt werden konnten, sowie leergefegte Märkte für bestimmte Rohstoffe, Energieträger und industrielle Zwischenprodukte wie Halbleiter wirken weiterhin dämpfend auf den Output. Gleichzeitig fällt es produzierenden Unternehmen leichter, die sich ergebenden höheren Herstellungspreise an die Verbraucher weiterzugeben, da letztere wegen des erzwungenen Konsumverzichts zu Zeiten der Lockdowns unfreiwillig hohe Ersparnisse gebildet haben und zudem nach Monaten des Verzichts bereit sind, höhere Preise zu zahlen. Das Ergebnis ist eine Verstärkung des erwarteten, durch Basiseffekte ausgelösten Inflationsschubes, der nun durch anhaltend gestörte Angebots- und Logistikkapazitäten länger als erwartet andauern und noch weit in das Jahr 2022 hineinreichen dürfte.

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

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 31.10.2021

Vermögensübersicht zum 31.10.2021

	Kurswert in CHF	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	313.265.064,77	100,04
1. Aktien	310.647.843,33	99,21
Finanzsektor	77.289.172,52	24,68
Gesundheits- und Pflegewesen	68.612.078,00	21,91
Handel und Dienstleistung	86.717.434,51	27,69
Herstellung industr. Grundstoffe und Halbfabrikate	24.088.751,76	7,69
Industrielle Produktion incl. Bauindustrie	15.258.964,78	4,87
Nahrungsherstellung und Produktion v. Konsumgütern	29.725.827,88	9,49
Technologiesektor	4.569.693,88	1,46
Telekommunikation	4.385.920,00	1,40
2. Derivate	-19.939,00	-0,01
Finanzterminkontrakte	-19.939,00	-0,01
3. Forderungen	1.868.573,42	0,60
4. Bankguthaben	577.936,02	0,18
5. Sonstige Vermögensgegenstände	190.651,00	0,06
II. Verbindlichkeiten	-138.207,25	-0,04
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme	-14.486,13	-0,00
Sonstige Verbindlichkeiten	-123.721,12	-0,04
III. Fondsvermögen	313.126.857,52	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 01.05.2021 BIS 31.10.2021

Vermögensaufstellung zum 31.10.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.10.2021	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in CHF	% des Fondsvermögens ²⁾
Wertpapiervermögen								310.647.843,33	99,21
Börsengehandelte Wertpapiere								310.647.843,33	99,21
Aktien								281.907.480,53	90,03
ABB Ltd. Namens-Aktien SF 0,12	CH0012221716	STK		420.582	59.636	55.307	CHF 30,290	12.739.428,78	4,07
Adecco Group AG Namens-Aktien SF 0,1	CH0012138605	STK		58.306	9.860	5.068	CHF 46,070	2.686.157,42	0,86
Alcon AG Namens-Aktien SF -,04	CH0432492467	STK		172.982	25.837	16.785	CHF 75,660	13.087.818,12	4,18
ams AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000A18XM4	STK		95.424	14.943	9.484	CHF 18,090	1.726.220,16	0,55
Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien SF 1	CH0210483332	STK		134.801	32.062	30.512	CHF 113,100	15.245.993,10	4,87
Credit Suisse Group AG Namens-Aktien SF -,04	CH0012138530	STK		917.785	274.483	74.258	CHF 9,532	8.748.326,62	2,79
Geberit AG Nam.-Akt. (Dispost.) SF -,10	CH0030170408	STK		12.417	1.888	1.623	CHF 714,800	8.875.671,60	2,83
Givaudan SA Namens-Aktien SF 10	CH0010645932	STK		2.754	411	266	CHF 4.309,000	11.866.986,00	3,79
Holcim Ltd. Namens-Aktien SF 2	CH0012214059	STK		195.339	44.202	18.633	CHF 45,710	8.928.945,69	2,85
Julius Baer Gruppe AG Namens-Aktien SF -,02	CH0102484968	STK		76.628	11.674	8.468	CHF 66,180	5.071.241,04	1,62
Kühne & Nagel Internat. AG Namens-Aktien SF 1	CH0025238863	STK		19.686	3.197	1.915	CHF 288,300	5.675.473,80	1,81
Logitech International S.A. Namens-Aktien SF -,25	CH0025751329	STK		59.954	9.032	5.867	CHF 76,220	4.569.693,88	1,46
Lonza Group AG Namens-Aktien SF 1	CH0013841017	STK		18.309	2.584	5.871	CHF 750,600	13.742.735,40	4,39
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350	STK		246.034	38.468	30.021	CHF 120,820	29.725.827,88	9,49
Novartis AG Namens-Aktien SF 0,50	CH0012005267	STK		354.097	77.851	27.998	CHF 75,640	26.783.897,08	8,55
Partners Group Holding AG Namens-Aktien SF -,01	CH0024608827	STK		7.850	1.167	760	CHF 1.597,500	12.540.375,00	4,00
Schindler Holding AG Inhaber-Part.sch. SF -,10	CH0024638196	STK		14.108	2.142	1.391	CHF 238,200	3.360.525,60	1,07
SGS S.A. Namens-Aktien SF 1	CH0002497458	STK		2.100	314	227	CHF 2.708,000	5.686.800,00	1,82
Sika AG Namens-Aktien SF 0,01	CH0418792922	STK		43.506	5.886	7.499	CHF 310,000	13.486.860,00	4,31
Sonova Holding AG Namens-Aktien SF 0,05	CH0012549785	STK		18.290	2.787	2.226	CHF 378,300	6.919.107,00	2,21
Straumann Holding AG Namens-Aktien SF 0,10	CH0012280076	STK		3.906	588	381	CHF 1.902,000	7.429.212,00	2,37
Swatch Group AG, The Inhaber-Aktien SF 2,25	CH0012255151	STK		10.030	1.534	997	CHF 251,200	2.519.536,00	0,80
Swiss Life Holding AG Namens-Aktien SF 0,10	CH0014852781	STK		10.919	1.660	1.244	CHF 502,600	5.487.889,40	1,75
Swiss Re AG Namens-Aktien SF -,10	CH0126881561	STK		100.048	14.986	9.742	CHF 88,640	8.868.254,72	2,83
Swisscom AG Namens-Aktien SF 1	CH0008742519	STK		8.800	1.323	859	CHF 498,400	4.385.920,00	1,40
Temenos AG Nam.-Aktien SF 5	CH0012453913	STK		23.202	3.603	2.230	CHF 139,850	3.244.799,70	1,04
UBS Group AG Namens-Aktien SF -,10	CH0244767585	STK		927.283	177.176	85.021	CHF 16,645	15.434.625,54	4,93
Vifor Pharma AG Nam.-Akt. SF 0,01	CH0364749348	STK		16.348	16.348	-	CHF 118,100	1.930.698,80	0,62
Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien SF 0,10	CH0011075394	STK		52.078	7.749	5.030	CHF 405,900	21.138.460,20	6,75
Sonstige Beteiligungswertpapiere								28.740.362,80	9,18
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	CH0012032048	STK		81.176	11.866	8.221	CHF 354,050	28.740.362,80	9,18
Derivate								-19.939,00	-0,01
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate								-19.939,00	-0,01
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte								-19.939,00	-0,01
Swiss Leader Index Future (FSLI) Dez. 21		EDT	Anzahl	127			CHF	-19.939,00	-0,01
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								577.936,02	0,18
Bankguthaben								577.936,02	0,18
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen								577.936,02	0,18
Verwahrstelle: State Street Bank International GmbH			CHF	577.936,02		%	100,000	577.936,02	0,18
Sonstige Vermögensgegenstände								2.059.224,42	0,66
Quellensteuerrückerstattungsansprüche			CHF	1.868.573,42				1.868.573,42	0,60
Initial Margin			CHF	177.570,00				177.570,00	0,06
Geleistete Variation Margin			CHF	13.081,00				13.081,00	0,00

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 31.10.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.10.2021	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in CHF	% des Fondsvermögens ²⁾
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme								-14.486,13	-0,00
EUR-Kredite								-14.486,13	-0,00
Verwahrstelle: State Street Bank International GmbH			EUR	-13.699,29		%	100,000	-14.486,13	-0,00
Sonstige Verbindlichkeiten								-123.721,12	-0,04
Verwaltungsvergütung			CHF	-120.703,22				-120.703,22	-0,04
Sonstige Verbindlichkeiten			EUR	-2.853,98				-3.017,90	-0,00
Fondsvermögen							CHF	313.126.857,52	100,00
Anteilwert							CHF	134,68	
Umlaufende Anteile							STK	2.325.000	

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					
Clariant AG Namens-Aktien SF 3,00	CH0012142631	STK	6.491	88.173	
Nichtnotierte Wertpapiere					
Andere Wertpapiere					
Credit Suisse Group AG Anrechte	CH1111011453	STK	-	717.560	
Derivate					
(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					5.772
Basiswert(e):					
Swiss Leader Index (Price) (CHF) (SLI)					

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 31.10.2021

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.05.2021 bis 31.10.2021

I. Erträge

1. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	CHF	823.432,51
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	CHF	-12.991,71
3. Abzug ausländischer Quellensteuer	CHF	-84.479,76
4. Sonstige Erträge	CHF	49.602,43
Summe der Erträge	CHF	775.563,47

II. Aufwendungen

1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	CHF	-269,82
2. Verwaltungsvergütung	CHF	-768.074,32
3. Sonstige Aufwendungen	CHF	-19.112,80
Summe der Aufwendungen	CHF	-787.456,94

III. Ordentlicher Nettoertrag	CHF	-11.893,47
--------------------------------------	------------	-------------------

IV. Veräußerungsgeschäfte

1. Realisierte Gewinne	CHF	11.620.846,92
2. Realisierte Verluste	CHF	-262.979,11
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	CHF	11.357.867,81

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	CHF	11.345.974,34
---	------------	----------------------

1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	CHF	17.450.987,54
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	CHF	-1.027.782,57

VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	CHF	16.423.204,97
--	------------	----------------------

VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	CHF	27.769.179,31
--	------------	----------------------

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

2021			
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	CHF		272.730.296,33
1. Ausschüttung für das Vorjahr	CHF		-3.414.081,00
2. Mittelzufluss/Mittelabfluss (netto)	CHF		16.944.930,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	CHF	43.503.335,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	CHF	-26.558.405,00	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	CHF		-903.467,12
4. Ergebnis des Geschäftsjahres	CHF		27.769.179,31
davon nicht realisierte Gewinne	CHF	17.450.987,54	
davon nicht realisierte Verluste	CHF	-1.027.782,57	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	CHF		313.126.857,52

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 31.10.2021

Anhang

Sonstige Angaben

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

Anteilwert	CHF	134,68
Umlaufende Anteile	STK	2.325.000

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 29.10.2021

Euro	(EUR)	0,94568 = 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	0,40 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 Gesamttrendite-Swaps, abgeschlossen.

München, den 31. Oktober 2021

BlackRock Asset Management Deutschland AG (KVG)



Peter Scharl

Harald Klug

HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 31.10.2021

Allgemeine Informationen

Verwaltungsgesellschaft

BlackRock Asset Management Deutschland AG
Lenbachplatz 1
80333 München

Grundkapital per 31.12.2020: 5 Mio. EUR

Haftendes Eigenkapital per 31.12.2020: 46,90 Mio. EUR

Gesellschafter

BlackRock Investment Management (UK) Limited

Geschäftsführung

Dirk Schmitz
Vorstandsvorsitzender
Frankfurt

Harald Klug
Vorstand
München

Peter Scharl
Vorstand
München

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

Stacey Mullin
BlackRock, Managing Director, COO EMEA
London, UK

Stephen Cohen (stellvertretender Vorsitzender)**
BlackRock, Managing Director, Head of Sales EMEA iShares
London, UK

Verwahrstelle

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

Wirtschaftsprüfer

Deloitte GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Rosenheimer Platz 4
81669 München, Deutschland

(*) seit 09.08.2021

(**) bis 09.08.2021

Want to know more?

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

© 2021 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 Rechteinhaber.

iShares
by BlackRock

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